

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金产品情况

| | |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 景顺长城中证 500ETF 联接 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 001455 |
| 交易代码 | 001455 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 29 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 100,210,569.03 份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个工作日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。 在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。 |

| | |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 159935 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月26日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2014年1月21日 |
| 基金管理人名称 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金以中证500指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。 |
| 业绩比较基准 | 中证500 指数。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2016年7月1日－2016年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -691,207.21 |
| 2. 本期利润 | 2,275,018.54 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0224 |
| 4. 期末基金资产净值 | 82,679,711.87 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.825 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

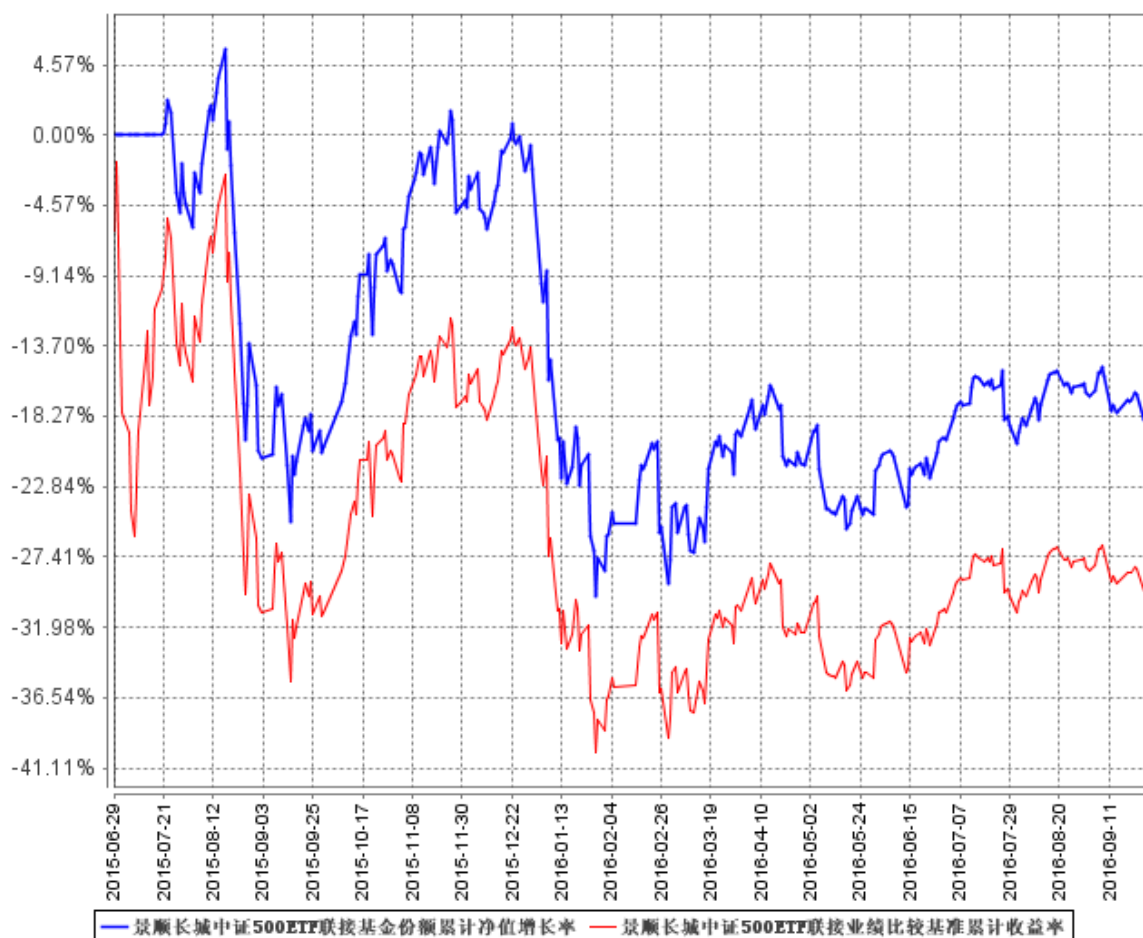
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.74% | 0.94% | 3.19% | 0.96% | -0.45% | -0.02% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2015 年 6 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|-----------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐喻军 | 本基金的基金经理 | 2015年6月29日 | - | 6年 | 理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------|
| | | | | | 专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。 |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度经济基本面有所企稳，一方面得益于基建和地产投资的推动，另一方面工业企业利润持续回升对制造业投资回稳有一定帮助。然而实体经济需求依然疲弱，缺乏持续改善驱动力。受食品价格回落和去年基数影响，3 季度通胀有所回落。货币政策维持 2 季度的操作思路，央行通过公开市场操作和定向宽松维稳市场资金面。上证综指围绕 2900-3100 点位波动，缺乏趋势性行情。

展望第 4 季度，经济数据仍可能低位企稳，财政发力维稳经济的概率较大。美元加息预期回升，美国 12 月份加息概率增大。

本基金是景顺长城中证 500ETF 的联接基金，主要投资于景顺长城中证 500ETF。报告期内，本基金根据申赎情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年 3 季度，本基金份额净值增长率为 2.74%，业绩比较基准收益率为 3.19%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，跟踪误差（年化）控制在 4% 以内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 127,241.00 | 0.15 |
| | 其中：股票 | 127,241.00 | 0.15 |
| 2 | 基金投资 | 76,084,000.00 | 91.25 |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,618,259.06 | 6.74 |
| 8 | 其他资产 | 1,553,687.41 | 1.86 |
| 9 | 合计 | 83,383,187.47 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|-----------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 15,779.00 | 0.02 |

| | | | |
|---|------------------|------------|------|
| C | 制造业 | 77,670.00 | 0.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 3,990.00 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 11,624.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 18,178.00 | 0.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 127,241.00 | 0.15 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 000547 | 航天发展 | 700 | 11,298.00 | 0.01 |
| 2 | 000975 | 银泰资源 | 600 | 8,820.00 | 0.01 |
| 3 | 600687 | 刚泰控股 | 500 | 7,960.00 | 0.01 |
| 4 | 000656 | 金科股份 | 1,300 | 7,280.00 | 0.01 |
| 5 | 600773 | 西藏城投 | 400 | 7,208.00 | 0.01 |
| 6 | 002266 | 浙富控股 | 1,200 | 7,044.00 | 0.01 |
| 7 | 600525 | 长园集团 | 500 | 6,995.00 | 0.01 |
| 8 | 600614 | 鼎立股份 | 800 | 6,520.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----|----------|------|
| 9 | 300088 | 长信科技 | 400 | 6,172.00 | 0.01 |
| 10 | 000050 | 深天马 A | 300 | 5,523.00 | 0.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------------------|---------|--------|--------------|---------------|--------------|
| 1 | 景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型指数基金 | 交易型开放式 | 景顺长城基金管理有限公司 | 76,084,000.00 | 92.02 |

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,678.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,529,523.76 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 996.22 |
| 5 | 应收申购款 | 20,489.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,553,687.41 |

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|-------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 000547 | 航天发展 | 11,298.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 2 | 000975 | 银泰资源 | 8,820.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 3 | 600687 | 刚泰控股 | 7,960.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 4 | 000656 | 金科股份 | 7,280.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 5 | 600773 | 西藏城投 | 7,208.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 6 | 600525 | 长园集团 | 6,995.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 7 | 600614 | 鼎立股份 | 6,520.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 8 | 300088 | 长信科技 | 6,172.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |
| 9 | 000050 | 深天马 A | 5,523.00 | 0.01 | 重大事项停牌 |

5.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 102,848,541.50 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,964,486.17 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 5,602,458.64 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 100,210,569.03 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日