

# 景顺长城货币市场证券投资基金 2016 年 第 2 季度报告

2016 年 6 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 7 月 21 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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	景顺长城货币
场内简称	无
基金主代码	260102
交易代码	260102
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金
系列其他子基金名称	景顺长城动力平衡混合(260103)、景顺长城优选混合(260101)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 10 月 24 日
报告期末基金份额总额	467,997,267.74 份
投资目标	货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。
投资策略	本基金通过宏观经济、政策和市场资金供求的综合分析进行短期利率判断，对各投资品种从收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限等方面进行综合价值比较，在保持基金资产高流动性的前提下构建组合。
业绩比较基准	税后同期 7 天存款利率。
风险收益特征	本基金具有低风险和收益稳定的特点，投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下，获得高于基准的投资回报。
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	
下属分级基金的基金简称	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
下属分级基金的交易代码	260102	260202
报告期末下属分级基金的份额总额	260,788,070.04 份	207,209,197.70 份

### §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4月1日—2016年6月30日）	
	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
1. 本期已实现收益	1,136,293.05	881,271.93
2. 本期利润	1,136,293.05	881,271.93
3. 期末基金资产净值	260,788,070.04	207,209,197.70

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.4693%	0.0037%	0.3357%	0.0000%	0.1336%	0.0037%

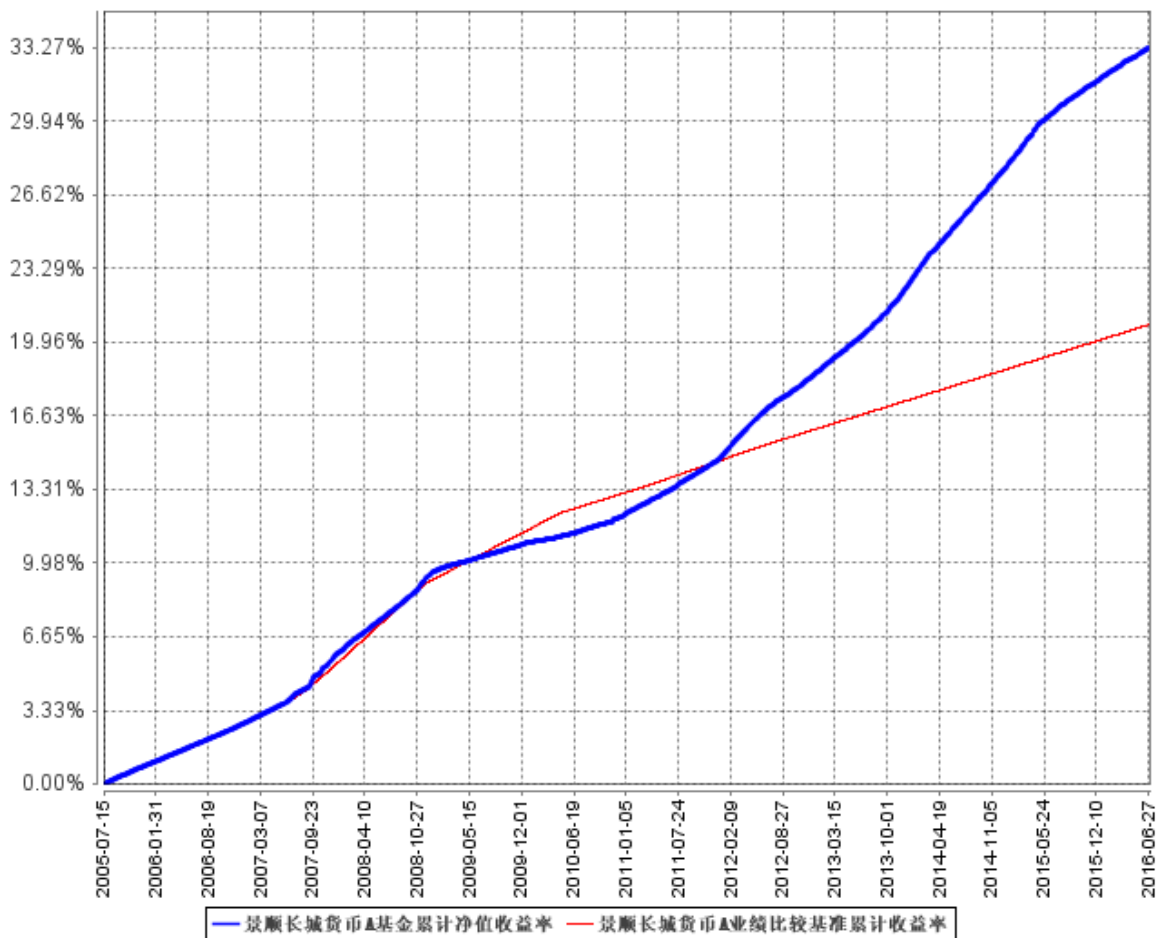
注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

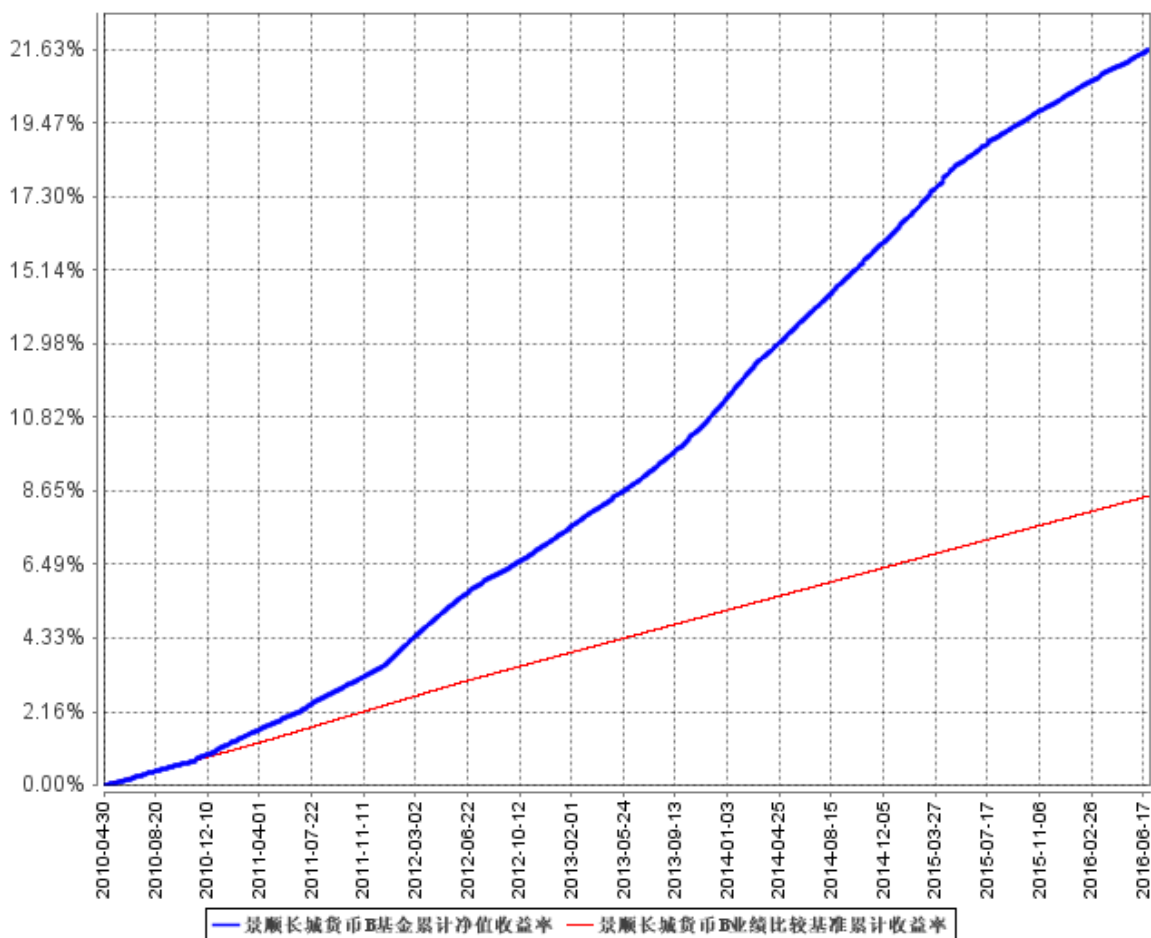
景顺长城货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5292%	0.0037%	0.3357%	0.0000%	0.1935%	0.0037%

注：本基金的收益分配为每日分配，按月结转份额。

### 3.2.2 自基金转型以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：经景顺长城恒丰债券证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并于 2005 年 7 月 7 日获中国证券监督管理委员会证监基金字 2005[121] 号文核准，景顺长城恒丰债券证券投资基金以 2005 年 7 月 14 日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自 2010 年 4 月 30 日起实行基金份额分级。

## §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		
杨锐文	景系列基金基金经理 (分管景系列基金下设之景顺长城优选混合型证券投资基金)，景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 (LOF)，景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金经	2014 年 10 月 25 日	-	6	工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究员职务；自 2014 年 10 月起担任基金经理。

	理				
刘苏	景系列基金基金经理 (分管景系列基金下 设之景顺长城动力平衡证 券投资基金)	2015 年 9 月 29 日	-	11	理学硕士。曾担任深圳 国际信托投资有限公司 (现华润深国投信托) 信托经理, 鹏华基金高 级研究员、基金经理助 理、基金经理职务。 2015 年 5 月加入本公司, 自 2015 年 9 月起担任基 金经理。
刘彦春	景顺长城新兴成长混合 型证券投资基金基金经 理, 景顺长城鼎益混合 型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 景 系列基金基金经理 (分 管景系列基金下之景 顺长城动力平衡证券投 资基金), 景顺长城优 质成长股票型证券投资 基金基金经理, 研究部 总监	2015 年 7 月 10 日	-	13	管理学硕士。曾担任汉 唐证券研究员, 香港中 信投资研究有限公司研 究员, 博时基金研究员、 基金经理助理、基金经 理等职务。2015 年 1 月 加入本公司, 自 2015 年 4 月起担任基金经理。
毛从容	景顺长城稳健回报灵活 配置混合型基金、领先 回报灵活配置混合型基金、 中国回报灵活配置混 合型基金、安享回报 灵活配置混合型基金、 泰和回报灵活配置混 合型基金、景颐双利债券 型基金、景颐增利债券 型基金、景丰货币市场 基金、景颐宏利债券型、 景盛双息收益债券型、 景系列基金基金经理 (分管景系列基金下 设之景顺长城货币市场 基金), 副总经理兼固定 收益部投资总监	2005 年 6 月 1 日	-	16	经济学硕士。曾任职于 交通银行、长城证券金 融研究所, 着重于宏观 和债券市场的研究, 并 担任金融研究所债券业 务小组组长。2003 年 3 月加入本公司, 担任研 究员等职务; 自 2005 年 6 月起担任基金经理
陈威霖	景顺长城货币市场证券 投资基金、景顺长城景 丰货币市场基金基金经 理	2016 年 4 月 20 日	-	5	管理学硕士。曾担任平 安利顺货币经纪公司债 券市场部债券经纪人。 2013 年 6 月加入本公司, 先后担任交易管理部交 易员、固定收益部信用

					研究员；自 2016 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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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；

3、陈威霖女士于 2016 年 4 月 20 日起担任景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金基金经理；

4、毛从容女士于 2016 年 4 月 19 日离任景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金基金经理，2016 年 4 月 25 日离任景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金基金经理，2016 年 6 月 17 日离任景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》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

经济数据方面：今年上半年中采制造业 PMI 指数先抑后扬，1、2 月份受经济下行压力低于 50 荣枯线，在 3 月份稳增长政策刺激下 PMI 突破 50 并维持，恢复到去年年中水平。今年 1-5 月

CPI 同比涨幅均值在 2.14%，受食品价格快速上涨带动，CPI 从 1 月份 1.8% 上涨至 2 月 2.3% 并连续维持 3 个月，5 月份由于鲜菜价格超预期下滑，猪肉价格涨势趋缓影响，CPI 回落至 2%。1-5 月 PPI 同比降幅持续收窄，环比则连续三个月回升并有望持续改善。固定资产投资增长 9.6%，较 1-4 月大幅回落 0.9%，主因是制造业投资大幅回落。民间投资大幅下滑 1.3% 至 3.9%，占全部投资的比重较去年同期下滑 3.4% 至 62.0%。5 月工业增加值同比增长 6.0%，增速与上月持平，比上年同期回落 0.1 个百分点。1-5 月社会消费品零售总额累计同比增速 10.2%，较 1-4 月下滑 0.1 个百分点。1-5 月份规模以上工业企业利润总额同比增长 6.4%，较前值回落 0.1 个百分点。1-5 月份规模以上工业企业主营业务收入同比增长 2.9%，主营业务成本同比增长 2.7%，均升至去年一季度以来新高。1-5 月财政收入同比增长 8.3%，财政支出累计同比增长 13.6%，其中民生相关支出增长较快。

随着食品价格季节性走弱，预计 CPI 将继续小幅回落。大宗商品价格上涨以及基建投资加码对 PPI 形成支撑，上述影响因素仍未消除，后期 PPI 则可能继续改善。企业降杠杆需要政府加杠杆对冲，预计基建投资仍将继续维持高位。房地产投资开始走弱，而制造业投资持续放缓。民间投资今年以来加速下滑，制约投资总量增长，反映经济内生动力依然不足。经济依然向下令消费也随之整体疲弱。伴随政府托底经济政策，预计财政支出继续发力。

金融数据方面：今年 1-5 月累计新增人民币贷款 6.15 万亿，同比多增 8683 亿。其中 1 月新增贷款 2.51 万亿，创历史单月新高。1-5 月新增社会融资总量 8.1 万亿，同比多增达 1.2 亿，主要受到人民币新增贷款和企业债券融资规模上涨导致，票据融资则受到严格监管大幅下滑。今年 1-5 月 M2 持续回落，主要由于高基数的影响。M1 的同比增速达持续攀升至 5 月份的 23.7%，与 M2 的剪刀差继续扩大。

1 季度受到稳增长政策刺激，信贷和社融发力，随着权威人士讲话，供给侧改革重回政策重心，信贷和社融增速有所回落。4 月、5 月新增贷款乏力，主要靠居民中长期按揭贷款拉动，企业贷款需求则明显不足。社融主要受到企业债净发行量减少、票据融资大幅下滑影响。由于信用债市场违约事件时有发生，信用风险担忧持续，短端资金成本易上难下，债市情绪谨慎，过剩产业债券发行困难。票据融资下滑主要与 4 月 27 日银监会 126 号文要求加强票据业务监管有关。M2 增速受到去年基数原因影响，回落趋势或至少持续至今年 7 月。M1 与 M2 的剪刀差继续扩大，主因其一楼市火爆致使居民定期存款向企业活期存款转化，其二实体经济疲弱，企业投资意愿不足，资金仍未脱虚向实，未来资产价格仍有上涨风险。

外汇和国际方面：1-5 月外汇储备（美元口径）合计下降 1386 亿美元至 3.19 万亿美元，除 1 月份单月外汇储备下降 995 亿，其他几个月外汇储备较为平稳。5 月份美国非农数据意外下滑，



使得美国 6 月份加息预期骤降。6 月 24 日英国公投脱欧成功，成为全球市场黑天鹅，导致避险情绪骤升，风险资产遭抛售。欧元、英镑暴跌，日元、美元、黄金大涨。人民币受美元持续升值影响，短期贬值速度加快，但并未造成市场恐慌。短期看，英国脱欧事件造成情绪因素缓解后，超调资产价格会有所恢复。长期看，欧盟全球地位被削弱，利好中国全球话语权，该事件可能成为全球经济动荡的起始性事件，未来风险偏好难以彻底恢复。若美元持续强势会加剧人民币贬值和资金外流，一旦破位贬值会造成流动性恐慌，不排除届时央行降准对冲的可能性。

权威人士发言对市场具有明显引导作用，调整了市场对经济基本面的预期，一方面显示出一季度在房地产带动下的增长并不可持续；另一方面，否定了前期工作重点在通过需求侧刺激经济的方式，后续将着力加强供给侧改革。

2 季度信用风险频发，4 月份开始，信用风险逐步蔓延至国企和央企，桂有色、东北特钢、华昱能源债券的违约以及铁物资兑付风险并暂停债券交易，显示出经济下行的环境下，国有企业也并非避风港；而且部分国有企业逃废债务的道德风险已经开始引起债券市场信心的动摇。同时，钢铁、煤炭等过剩产能的发债主体评级被下调的数量进一步增多。随着 7、8 月信用债到期高峰的到来，预计信用风险事件仍会持续发酵。

6 月美联储议息会议决定维持基准利率不变，下调 GDP、上调通胀预测，耶伦发言整体偏“鸽”派，加息预期大幅延后，新兴市场获得短暂喘息机会。而英国在 6 月 24 日公布了脱欧公投结果，以 51.9:48.1 的去留比例决定脱欧，大大超出市场预期，英镑随即一度下跌 10%，短期市场风险偏好迅速修正，英国股市带领欧股全面下行，同时推高美元、黄金价格，人民币对美元顺势下跌，国内利率债收益率快速下行。

整体来看 2 季度货币政策和市场流动性相比 1 季度边际上有所趋紧，货币政策基调也从稳健偏宽松逐步趋向实质性稳健。而公开市场利率自去年 10 月底以来一直维持在 2.25% 水平、CPI 居高不下、MPA 考核、对半年末资金面的预期紧张都使得资金利率中枢出现了一定程度的上移。叠加 4 月信用风险事件发酵，2 季度来看债券市场波动加大。因此报告期内本组合秉承向持有人提供稳健收益回报原则，久期方面中性策略，同时密切关注信用风险，保持高流动性，在信用选择上避开强周期过剩产能行业，优选高评级、现金流好且负债率较低的信用品种。利率债方面，选择波段作为交易性机会获得超额收益。总体组合配置以高流动性、低信用风险为原则。

下半年基建在宽财政带动下仍可能维持高位，房地产投资有一定的惯性，民间投资下滑趋缓，短期经济增长仍有惯性，加上去年下半年的低基数，经济呈现 L 型走势的概率较大。权威人士定调“经济运行 L 型走势”，政策应该不会进行大幅度刺激，增长和通胀略有走弱的概率较大，供给侧改革重回政策重心。

上半年 CPI 回升力度超预期，主要是蔬菜和猪肉价格超预期回升，以及大宗商品价格的反弹。随着食品价格中鲜菜价格持续回落，猪肉价格涨幅继续放缓，后期食品类价格涨幅预计继续下降，推动下半年 CPI 逐步下行。但需关注石油价格上涨、异常天气因素对 CPI 的冲击。大宗商品价格可能推动 PPI 继续回升，CPI 和 PPI 的剪刀差收窄。

货币政策由宽松回归中性。4 月和 5 月份 M2 增速明显放缓，央行主要通过频繁公开市场操作平滑资金面，为供给侧改革营造中性适度的货币金融环境。MPA 考核半年末的资金面比较平稳。金融去杠杆以及引导资金脱虚向实，预计央行仍会维持短端资金面的平稳。从财政政策看，我们政府举债还有一定空间，今年以来国债和地方政府债券发行规模继续扩大，财政支出在 5 月也大幅增长 17.6%，预计依然会继续加大财政政策刺激力度，继续托底经济。

海外不确定性增加，汇率贬值趋势未改。美国加息预期出现反复，成为干扰市场的风险因素。英国脱欧可能会进一步加大欧盟分裂的风险，市场风险偏好明显下降，避险情绪升温，脱欧后续的演变值得关注。汇率长期取决于中国的经济基本面，长期贬值压力仍存，但近期脱欧事件使得人民币贬值风险进一步释放，考虑在 9 月 G20 峰会前，短期人民币汇率对美元会大概率会趋稳。

综上，在供给侧改革和稳增长的博弈中，实体经济信用扩张放缓，央行仍然非常有必要去维持目前的低利率水平，防范系统性金融风险。而脱欧这一超预期事件使得全球市场短期避险情绪升温，也给各国货币政策继续宽松打开空间。三季度预计央行将进一步通过各种货币政策工具（SLF、MLF、PSL 等）维稳资金面。然而为了对冲资本外流及基础货币增速的下降，降准有一定必要性。组合将拉长久期，以期获得超额收益。预计下半年低评级的信用风险还会暴露，信用利差分化。因此在配置方面，仍然是以高评级券种、同业存单投资、存款为主。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年 2 季度，景顺货币 A 份额净值收益率为 0.4693%，业绩比较基准收益率 0.3357%；景顺货币 B 份额净值收益率为 0.5292%，业绩比较基准收益率 0.3357%。

#### 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	固定收益投资	182,748,798.22	38.94
	其中：债券	182,748,798.22	38.94

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	98,500,747.75	20.99
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	136,692,875.18	29.13
4	其他资产	51,380,301.07	10.95
5	合计	469,322,722.22	100.00

注：银行存款和结算备付金其中包含货币基金定期存款 136,000,000.00 元。

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.11	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

## 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内，本货币基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	40.21	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	18.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	22.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	8.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	89.30	-

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	33,010,716.59	7.05
	其中：政策性金融债	33,010,716.59	7.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,991,383.50	21.37
6	中期票据	-	-
7	同业存单	49,746,698.13	10.63
8	其他	-	-
9	合计	182,748,798.22	39.05
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15 农发 19	300,000	30,010,191.47	6.41
2	011699175	16 华电 SCP002	300,000	30,004,595.11	6.41
3	111617038	16 光大 CD038	300,000	29,829,378.40	6.37
4	071603002	16 中信 CP002	200,000	19,999,382.91	4.27

5	011699212	16 广州港 股 SCP002	200,000	19,997,259.75	4.27
6	011698001	16 南航股 SCP004	200,000	19,991,695.70	4.27
7	111620053	16 广发银 行 CD053	200,000	19,917,319.73	4.26
8	071603005	16 中信 CP005	100,000	9,998,450.03	2.14
9	150416	15 农发 16	30,000	3,000,525.12	0.64

## 5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0856%
报告期内偏离度的最低值	0.0151%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0436%

## 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。

## 5.8 投资组合报告附注

### 5.8.1

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值为 1.0000 元。

### 5.8.2

本报告期内，本基金未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，也不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值 20%的情况。

5.8.3 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。

### 5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收利息	1,469,785.83
4	应收申购款	49,910,515.24
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	51,380,301.07

### 5.8.5 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

项目	景顺长城货币 A	景顺长城货币 B
报告期期初基金份额总额	282,755,392.30	246,358,485.76
报告期期间基金总申购份额	183,652,632.67	225,522,031.83
报告期期间基金总赎回份额	205,619,954.93	264,671,319.89
报告期期末基金份额总额	260,788,070.04	207,209,197.70

注：总申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额，总赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末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景系列开放式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景系列开放式证券投资基金托管协议》；

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 7 月 21 日