景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年4月22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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城沪深300等权重ETF（场内简称：300等权）
基金主代码	159924
交易代码	159924
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年5月7日
报告期末基金份额总额	212,515,929.00份
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	本基金以沪深300等权重指数为标的指数，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（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）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，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（同行业股票优先考虑）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%，年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300等权重指数。
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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“300等权”。

§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（2014年1月1日 － 2014年3月31日）
1.本期已实现收益	-1,999,629.93
2.本期利润	-16,387,743.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0741
4.期末基金资产净值	183,452,127.06
5.期末基金份额净值	0.863

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。

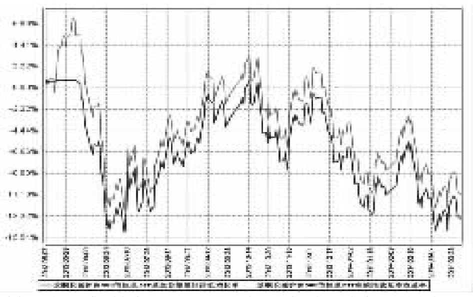
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.00%	1.26%	-7.86%	1.28%	-0.14%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金的资产配置比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的建仓期为自2013年5月7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。基金合同生效日（2013年5月7日）起至本报告期末不满一年。

§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		
江科宏	本基金基金经理，上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理，景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2013年5月7日	-	7	经济学硕士，CFA。2007年至2010年担任本公司风险管理经理职务。2011年2月重新加入本公司，担任研究员等职务；自2012年6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》、《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、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1季度经济基本面整体偏弱，经济数据出现回落迹象；货币政策保持中性，2014年全国人大会议释放全面改革预期。从1季度市场表现来看，指数冲高回落，市场结构分化明显。展望2014年第2季度，在地方政府考核新规淡化GDP、增强债务管理、以及货币政策上防止金融机构加杠杆和“社会融资规模合理增长”的政策导向下，2014年社会融资规模增速可能进一步回落，预示着经济趋下行。但我们认为在7.5%左右的经济增长目标下，经济下行幅度有限，预计A股市场维持震荡整理的走势。

本基金采用完全复制沪深300等权重指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年1季度，本基金份额净值增长率为-8.00%，低于业绩比较基准收益率0.14%。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0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在2%以内。

§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	181,855,633.07	98.98
	其中：股票	181,855,633.07	98.98
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,864,022.21	1.01
7	其他资产	4,318.10	0.00
8	合计	183,723,973.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,453,897.67	1.34
B	采矿业	16,534,018.97	9.01
C	制造业	80,414,632.14	43.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,093,717.73	4.41
E	建筑业	9,215,756.92	5.02
F	批发和零售业	8,752,929.32	4.77
G	交通运输、仓储和邮政业	5,947,545.50	3.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,901,725.08	3.76
J	金融业	23,964,541.15	13.06
K	房地产业	10,000,756.69	5.45
L	租赁和商务服务业	2,496,936.09	1.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,833,921.94	1.00
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	2,905,940.51	1.58
S	综合	2,339,313.36	1.28
	合计	181,855,633.07	99.13

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000778	新兴铸管	170,230	927,753.50	0.51
2	600340	华夏幸福	33,245	925,540.80	0.50
3	002065	东华软件	22,300	900,028.00	0.49
4	600519	贵州茅台	5,760	891,072.00	0.49
5	002594	比亚迪	18,087	870,165.57	0.47
6	600588	用友软件	49,916	862,049.32	0.47
7	600352	浙江龙盛	52,392	851,893.92	0.46
8	600688	上海石化	235,000	808,400.00	0.44
9	000156	华数传媒	31,411	802,236.94	0.44
10	600582	天地科技	89,439	799,584.66	0.44

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,931.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	386.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,318.10

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000156	华数传媒	802,236.94	0.44	筹划重大事项，于2014年4月9日复牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	230,515,929.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	18,000,000.00
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	212,515,929.00

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
2、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
4、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数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。

8.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

8.3 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
2014年4月22日

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年4月22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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城四季金利纯债债券	
基金主代码	000181	
交易代码	000181	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年7月30日	
报告期末基金份额总额	131,938,924.01份	
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。	
投资策略	1、资产配置策略 本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。 2、债券类属资产配置 基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 3、债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。	
业绩比较基准	中证综合债券指数。	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	景顺长城四季金利纯债债券A类	景顺长城四季金利纯债债券C类
下属两级基金的交易代码	000181	000182
报告期末下属两级基金的份额总额	109,041,828.65份	22,897,095.36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（2014年1月1日 － 2014年3月31日）	
	景顺长城四季金利纯债债券A类	景顺长城四季金利纯债债券C类
1.本期已实现收益	2,005,925.99	472,540.34
2.本期利润	2,074,484.03	498,260.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0154
4.期末基金资产净值	111,370,778.37	23,322,067.69
5.期末基金份额净值	1.021	1.019

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

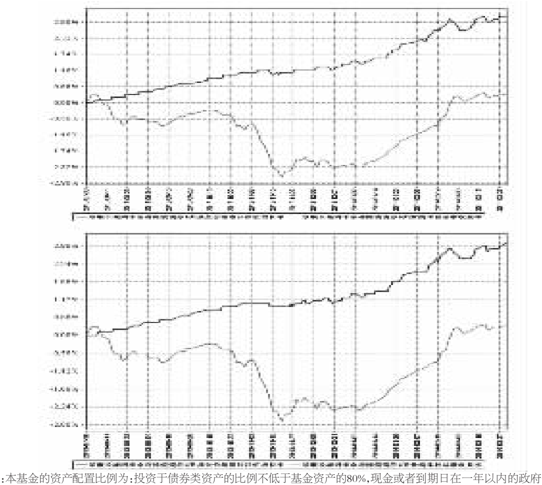
景顺长城四季金利纯债债券A类

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	1.59%	0.08%	2.59%	0.07%	-1.00%	0.01%

景顺长城四季金利纯债债券C类

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	1.60%	0.07%	2.59%	0.07%	-0.99%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金的资产配置比例为：投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期自2013年7月30日合同生效日起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。基金合同生效日（2013年7月30日）起至本报告期末不满一年。

§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		
RU PING(汝平)	本基金基金经理，景顺长城优信增利债券型基金、景兴信用纯债债券型基金、景颐双利债券型基金、景益货币市场基金和鑫月薪定期兑付债券型基金基金经理，固定收益部兼国际投资部投资总监	2013年7月30日	-	18	信息网络（金融类）硕士，物理博士。曾担任摩根士丹利投资管理公司投资分析师、执行董事与固定收益投资部投资经理，摩根士丹利华鑫基金公司固定收益投资部副总监、总监兼基金经理等职务。2012年10月加入本公司，担任固定收益部投资总监兼国际投资部投资总监；自2013年7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。

3、袁媛女士于2014年4月4日起担任景顺长城四季金利纯债债券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》、《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、《景顺长城四季金利纯债债券型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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度，债券市场在基本面有利于债市、资金面稳中偏松等因素影响下，整体回暖出现持续回升，各类券种收益率全线下行。中债总净价指数结束自2013年6月份以来的跌势，上涨1.36%，中债国债总净价指数上涨1.41%，中债企业债净价指数上涨1.49%，中债短融总净价指数上涨0.62%。表现最差的为可转债，中标可转债指数下跌1.06%。

1季度前两个月经济数据全线低于预期。2月出口突然失速，贸易出现逆差，剔除季节性因素后外需仍显疲弱；三大投资增速均现回落；消费增速创19个月新低，反腐、限制“三公”持续对消费产生负作用；占GDP比重超过1/3的工业增速大幅下挫，预示着1季度GDP增速将明显回落，基本面对债市形成支撑。与此同时，银行间市场流动性呈现宽松状态，7天回购利率从节后首个交易日高点5.43%一路下行至3月12日的低点1.90%，基本回到2013年上半年水平。隔夜回购在2%左右徘徊。从统计数据看，1季度7天回购利率均值为4.05%，较去年4季度均值4.74%的水平下行69BP。市场对央行已经改变去年下半年坚持的稳健偏紧的货币政策取向进行猜测，尽管近期央行公开市场回笼加大，但仍透出保持合适流动性的政策思维。低资金成本、基本面支撑与配置力量支持下带动一季度债券收益率大幅下行。

此外，由于宏观经济趋势性下行、政绩考核指标的转变、直接融资渠道及条件的放松，年初以来同业非标市场的筹资需求有下降倾向；而商业银行出于监管要求及配合监管部门的同业业务改革、自身流动性管理要求以及资本金约束等，同业扩张的速度也呈放缓趋势，有利于资金向债市分流。

四季金利基金在1季度经济数据回落和央行货币政策不再偏紧的判断下，加快配置节奏，整体配置思路仍是在确保信用风险和流动风险可控的前提下，适当拉长久期，获取票息和资本利得。主要建仓3-5年的利率债和资质较好的信用债，积极把握1季度利率债和城投债的行情，根据基本面变化，做利率债的波动操作。同时兼顾流动性，配置短期限的短融，进行哑铃组合。

展望2014年第2季度的债券市场，我们认为，年内7.5%经济增速的定调及经济持续下滑态势迫近底线之时系统性政策有望出台，基本面在“稳增长”的政策基调下，未来投资或将成为经济托底的关键，3月经济数据有望边际改善。2月份CPI同比水平较低，全年压力较小，意味着货币政策和改革等仍有空间。未来，随着2季度稳增长政策落地，在去年低基数的助力下，数据表现或有所好转。年初以来，资金面在1月贷款投放、外汇占款激增、存款回流等多重因素影响下维持宽松，经济疲弱和通胀较低为货币政策松动提供条件，且央行进行汇率调控，打击套利资金。虽然外汇占款流入下降倒逼降准概率上升，但央行需要观察资金流向的持续性以及经济走势，实际举动会有所滞后。短期内资金较宽松局面或将延续，但后期不利于资金面的因素也逐渐显现，年内最宽松的时点或已过去。

利率债方面，当前市场分歧在于在前期利好因素一一兑现后，长端利率仍未现大幅下行，由资金和年初配置力量推动的第一轮行情似乎进入尾声，下轮走势更多依赖基本面恶化引发货币政策的出手，市场等待政策面的进一步变化来寻找方向。随着2季度一级发行量增加、资金利率有所回升以及稳增长预期的加强，利率债进入震荡调整，但由于货币政策在外汇占款增长减缓的背景下无大幅收紧必要，且市场多判断本轮稳增长的方式发生变化，因此利率上升幅度也或将有限，2季度存在交易机会。

信用债方面，超日债未能按时付息宣告了债市违约的“靴子”落地，对中国债市影响深远。由于3-5月债券到期量大，叠加年报披露期，经济低速增长时期暴露出2季度信用风险处于高发阶段，需规避由评级下调带来的估值风险和流动性风险。城投债以供给压力延后违约风险。信用债出现分化，信用风险提升，信用债投资以中短久期、资质较好的品种获取持有期票息收益为主。

总体而言，宏观经济和资金面仍将是影响货币市场的主要因素。央行公开市场操作和回购利率将是影响资金面、资金利率和投资者政策预期的关键指标。债市供给特别是信用债仍将增长。银行同业业务的规范和推动金融去杠杆过程仍将继续，对这方面业务的监管也将在发展中不断完善。央行货币政策是债市走向关键要素。本基金策略上着重把握信用债的持有期收益，同时保持适度的组合久期。针对上述复杂的市场环境，本基金将坚持平衡收益与风险的原则，密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，谨慎控制组合的信用风险，以控制利率风险和应对组合规模波动，我们将控制组合的久期和杠杆，适度增加组合流动性以备应对变化。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年1季度，四季金利A份额净值增长率为1.59%，低于业绩比较基准收益率1.00%。

2014年1季度，四季金利C份额净值增长率为1.60%，低于业绩比较基准收益率0.99%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	208,317,280.31	93.81
	其中：债券	208,317,280.31	93.81
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,089,761.52	4.54
7	其他资产	3,652,829.50	1.64
8	合计	222,059,871.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金投资范围不包括股票投资。

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

本基金投资范围不包括股票投资。

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	公允价值（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	30,085,000.00	22.34
	其中：政策性金融债	30,085,000.00	22.34
4	企业债券	76,265,365.00	56.62
5	企业短期融资券	60,247,000.00	44.73
6	中期票据	19,840,000.00	14.73
7	可转债	1,839,397.50	1.37
8	其他	20,040,517.81	14.88
9	合计	208,317,280.31	154.66

注：其他项中为本基金持有的私募债，明细如下：

代码	名称	数量	票面利率（%）	期限（年）
125178	13徐水务	100,000	9.5	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权
125139	13惠农债	50,000	9	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权
125169	13淮软01	50,000	10	3年，附债券存续期内的第2年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041369020	13方正CP001	200,000	20,074,000.00	14.90
2	122276	13魏桥01	200,000	19,540,000.00	14.51
3	111060	10佳城投	135,000	13,707,765.00	10.18
4	140201	14国开01	100,000	10,109,000.00	7.51
5	041352020	13川航集CP001	100,000	10,074,000.00	7.48

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,456.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,586,891.11
5	应收申购款	61,482.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,652,829.50

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110020	南山转债	1,348,200.00	1.00
2	110024	隧道转债	491,197.50	0.36

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金投资范围不包括股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城四季金利纯债债券A类	景顺长城四季金利纯债债券C类
报告期期初基金份额总额	145,344,947.43	48,291,510.53
报告期期间基金总申购份额	4,049,095.63	5,557,304.09
减：报告期期间基金总赎回份额	40,352,214.41	30,951,719.26
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	109,041,828.65	22,897,095.36

注：总申购份额含红利再投、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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金设立的文件；
2、《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
3、《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
4、《景顺长城四季金利纯债债券型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。

8.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

8.3 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
2014年4月22日

景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年4月22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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	景顺长城沪深300指数增强
基金主代码	000311
交易代码	000311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月29日
报告期末基金份额总额	300,441,838.23份
投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	1、资产配置策略：本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的90%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 2、股票投资策略：本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 3、债券投资策略：出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 4、权证、股指期货投资策略：本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。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、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5、中小企业私募债券的投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	95%×沪深300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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（2014年1月1日 － 2014年3月31日）
1.本期已实现收益	-9,304,720.96
2.本期利润	-21,913,783.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0632
4.期末基金资产净值	287,050,451.06
5.期末基金份额净值	0.955

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。

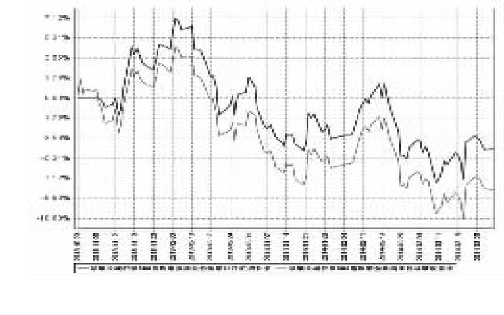
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-6.28%	1.14%	-7.15%	1.13%	0.87%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的90%－95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2013年10月29日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2013年10月29日）起至本报告期末不满一年。

§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		
黎海威	本基金基金经理，量化及ETF投资部投资总监	2013年10月29日	-	11	经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，担任量化及ETF投资部投资总监；自2013年10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》、《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、《景顺长城沪深300指数增强型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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度的宏观经济数据显示经济整体仍处于继续下行状态，国内的流动性在春节前后有一定的放松。大小盘分化在1月份达到了前所未有的程度。而新股IPO在1月份的开闸并没有立刻给成长股带来压力。成长股的调整在春节之后才逐渐展开。此外，信用风险的逐步暴露导致投资者风险偏好有所调整。经济下行的压力和违约风险的冲击使得市场波动加大，风格转换频繁。

面对市场的大幅波动，我们坚持在风险可控的前提下以选股为主来产生超额收益，并在各类因子之间进行了平衡的配置。价值类策略在1月份的表现较差，其后逐渐好转。而其它各类因子（情绪、动量、盈利质量）均表现平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年1季度，本基金份额净值增长率为-6.28%，高于业绩比较基准收益率0.87%。

§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	264,600,821.79	91.64
	其中：股票	264,600,821.79	91.64
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,040,138.42	7.29
7	其他资产	3,104,528.84	1.08
8	合计	288,745,489.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	12,450,397.95	4.34
C	制造业	107,796,450.84	37.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,231,611.44	2.87
E	建筑业	6,811,057.66	2.37
F	批发和零售业	10,309,370.82	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	2,449,383.69	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,499,232.20	1.92
J	金融业	94,230,268.31	32.83
K	房地产业	15,006,665.60	5.23
L	租赁和商务服务业	692,561.28	0.24
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	69,822.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	263,546,821.79	91.81

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	1,054,000.00	0.37
	合计	1,054,000.00	0.37

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	426,635	16,024,410.60	5.58
2	600036	招商银行	1,572,207	15,439,072.74	5.38
3	600000	浦发银行	1,295,634	12,593,562.48	4.39
4	000651	格力电器	376,235	10,534,580.00	3.67
5	600015	华夏银行	1,192,104	10,061,357.76	3.51
6	600030	中信证券	684,859	7,211,565.27	2.51
7	600583	海油工程	889,380	6,803,757.00	2.37
8	000001	平安银行	562,372	6,056,746.44	2.11
9	601166	兴业银行	632,138	6,017,953.76	2.10
10	600795	国电电力	2,407,909	5,682,665.24	1.98

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000009	中国宝安	100,000	1,054,000.00	0.37

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

1、中国平安保险（集团）股份有限公司（下称“中国平安”，股票代码：601318）于2013年10月14日发布公告称：本集团控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48号）。中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元，并处以人民币5,110万元的罚款，暂停其保荐业务许可3个月。

中国平安为沪深300指数成份股，我们的量化模型从多个角度进行了分析，认为其股价已反映相关负面消息，估值合理，情绪和动量都偏正面，因此本基金组合持有了该股票。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国平安进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	168,612.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,479.21
5	应收申购款	2,931,437.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,104,528.84

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	394,320,063.81
报告期期间基金总申购份额	20,247,877.35
减：报告期期间基金总赎回份额	114,126,102.93
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	300,441,838.23

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件；
2、《景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》；
3、《景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》；
4、《景顺长城沪深300指数增强型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。

8.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

8.3 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
2014年4月22日