景顺长城景丰货币市场基金2015年第1号更新招募说明书摘要

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

重要提示

(一)景顺长城景丰货币市场基金(以下简称“基金”或“本基金”)由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《景顺长城景丰货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2014年6月12日证监许可【2014】594号文准予募集注册,本基金的基金合同于2014年9月16日正式生效。

(二)基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三)投资有风险,投资人认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

(五)基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(六)基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(七)投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各级风险。投资本基金可能遇到的风险包括:市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险,等等。本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,本基金的预期收益和预期风险低于债券基金、混合型基金和股票型基金。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

(八)本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2015年3月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年12月31日。本更新招募说明书中财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名　称:景顺长城基金管理有限公司
住　所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层
设立日期:2003年6月12日
法定代表人:赵如冰
批准设立文号:证监基金字[2003]76号
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层
电　话:0755-82370388
客户服务电话:400 8888 606
传　真:0755-22381339
联系人:杨皞阳

(二)基金管理人基本情况

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司,由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦(集团)有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立,并于2003年6月9日获得开业批文,注册资本1.3亿元人民币,目前,各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。

公司设立了两个专门机构:风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司设置如下部门:股票投资部、固定收益部、国际投资部、量化及ETF投资部、专户投资部、研究部、渠道销售部、机构客户部、ETF销售部、市场服务部、产品开发部、交易管理部、基金事务部、信息技术部、人力资源部、财务行政部、法律监察稽核部、总经理办公室。各部门的职责如下:

1、股票投资部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票选择和组合的投资管理。
2、固定收益部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内债券选择和组合的投资管理并完成固定收益的研究。
3、国际投资部:主要负责与QDII、QFII等国际业务相关的投资管理、国际合作和培训等业务。
4、量化及ETF投资部:负责根据投资决策委员会制定的投资原则,以严谨的量化投资流程为依托,负责各类主动和被动量化产品的投资管理。
5、专户投资部:负责完成一对一、一对多等特定客户资产管理产品的投资管理。
6、研究部:负责对宏观经济、行业公司及市场的研究。
7、渠道销售部:负责公司产品在各银行、券商等渠道的销售。
8、机构客户部:负责开发机构客户,并使其认识并了解我公司在企业年金、社保等方面所提供的基金产品及服务。
9、ETF销售部:负责公司ETF类产品的销售及服务。
10、市场服务部:负责公司市场营销策略、计划制定及推广,电子商务和客户服务管理等工作。
11、产品开发部:负责基金产品及其他投资产品的设计、开发、报批等工作。
12、基金事务部:负责公司产品的注册登记、清算和估值核算等工作。
13、信息技术部:负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。
14、交易管理部:负责完成投资部下达的交易指令,并进行事前的风险控制。
15、人力资源部:负责公司各项人力资源管理工作,包括招聘、薪资福利、绩效管理、培训、员工关系、从业资格管理、高管及基金经理资格管理等。
16、财务行政部:负责公司财务管理及日常行政事务管理。
17、法律监察稽核部:负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核,并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。
18、总经理办公室:主要受总经理委托,协调各部门的工作,并负责公司日常办公秩序监督、工作项目管理跟进等,并负责基金风险的评估、控制及管理。

公司已经建立了健全的内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

赵如冰先生,董事长,经济学硕士。曾任葛洲坝水力发电厂主任、研究员级高级工程师,葛洲坝至上海超高压直流输电葛洲坝站站长、书记,葛洲坝水力发电厂办公室主任兼外办主任,华能南方开发公司党组书记、总经理,华能房地产开发公司党组书记、总经理,中佳地产开发公司总经理、党组书记,长城证券有限责任公司董事、副董事长、党委副书记等职。2009年加入本公司,现任公司董事长。

罗德城先生,董事,工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员,并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间,担任香港联交所委员会成员,并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

黄海洲先生,董事,工商管理硕士。1992年9月起,历任招商银行股份有限公司深圳蛇口支行会计、工程管理部员工、人力资源部干部、新江南投资公司副总经理。2005年5月起担任长城证券副总经理、现任长城证券副总经理、党委委员。

许义明先生,董事,总经理,金融工程学硕士。曾先后就职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部,汇丰银行中国区财资部;也曾担任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理、香港景顺资产管理有限公司大中华区业务拓展总监等职务。2009年加入本公司,现任公司董事兼总经理。

伍同明先生,独立董事,文学学士(1972年毕业)。香港会计师公会会员(HKICPA)、英国特许公认会计师(ACCA)、香港执业会计师(CPA)、加拿大公认管理会计师(CMA)。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识,1972-1977受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师行”[KPMG],现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生,独立董事,法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师,在香港马士打律师行、英国律师行Clyde & Co.从事律师工作,1993年发起设立信达律师事务所,担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

李晓西先生,独立董事。曾任国务院研究室宏观经济研究司司长。现任北京师范大学校学术委员会副主任,教授、博士生导师;中国社会科学院研究生院教授、博士生导师;教育部社会科学委员会经济学部召集人。

2、基金管理人监事会成员

王天广先生,监事,金融学学士,注册会计师、律师。1996年7月至1997年8月分别在万科财务顾问公司、中国证监会上市公司监管部工作;1998年起历任中国证监会深圳监管局任副处长、中国银河证券股份有限公司深圳投行部总经理、西南证券股份有限公司总裁助理兼投行总部总经理等职务。2012年2月进入长城证券担任公司副总经理兼投资银行事业部总经理,现任长城证券副总经理、党委委员。

郭慧娜女士,监事,管理理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师,历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士,监事,管理学硕士。曾任职于深圳市天健(信德)会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

3、高级管理人员

赵如冰先生,董事长,简历同上。
许义明先生,总经理,简历同上。
周伟达先生,副总经理,工商管理硕士。曾担任联博香港有限公司分析员、中国研究总监兼上海代表处首席代表、亚洲(除日本外)增长型股票投资负责人、高级副总裁,友邦保险有限公司上海分公司资产管理中心副总裁。2014年加入本公司,现任公司副总经理。

Xie Sheng(谢生)先生,副总经理,工商管理硕士。曾担任加拿大丰业银行商业信贷经理,加拿大道明资产管理公司亚洲市场部总经理,喜实基金渠道总监,湘财荷银基金首席市场官,富国基金总经理助理,民生证券副总裁、执行委员会委员兼资产管理事业部总裁职务。2013年加入本公司,现任公司副总经理。

康乐先生,副总经理,经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理,景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表,中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年加入本公司,现任公司副总经理。

吴建军先生,副总经理,经济学硕士。曾任海通汇通国际信托投资公司证券部副经理,长城证券有限责任公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年加入本公司,现任公司副总经理。

刘焕喜先生,副总经理,投资与金融系博士。历任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师、《证券时报》社编辑记者,长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年加入本公司,曾担任公司督察长,现任公司副总经理。

黄卫明先生,督察长,法学硕士。历任国家工商局市场司主任科员,国泰君安证券公司总裁助理兼人力资源部总经理,中国证监会期货部、非上市公众公司部等主任科员、副处长、处长。2010年加入本公司,现任公司督察长。

4、本基金基金经理简历

本公司采用团队投资方式,即通过整个投资部门全体人员的共同努力,争取良好投资业绩。本基金聘任基金经理如下:

毛从容女士,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。具有15年证券、基金行业从业经验。

5、本基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理毛从容女士曾于2005年6月1日至2014年1月15日担任本公司景顺长城景系列开放式证券投资基金(下文简称“景系列基金”)下设之景顺长城动力平衡证券投资基金基金经理;于2013年11月26日至2014年12月26日担任景顺长城景益货币市场基金基金经理。

6、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理毛从容女士现任景顺长城基金管理有限公司旗下景顺长城货币市场基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理。

7、本系列基金历任基金经理姓名及管理时间

无。

8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下:

许义明先生,总经理;
周伟达先生,副总经理;
余广先生,股票投资部投资总监;
毛从容女士,固定收益部投资总监;
黎海威先生,量化及ETF投资部投资总监;
RU PING(汝平)先生,国际投资部投资总监;
张继荣先生,研究部总监;
杨鹏先生,股票投资部投资副总监兼基金经理。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

名称:兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
成立时间:1988年8月26日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行总行,银复[1988]347号
组织形式:股份有限公司
注册资本:190.52亿元人民币
存续期间:持续经营

(二)发展概况及财务状况:

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本190.52亿元。

开业二十多年来,兴业银行始终坚持“真诚服务,相伴成长”的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。根据2014年业绩快报,截至2014年12月31日,兴业银行资产总额达4.41万亿元,股东权益2450亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润471.08亿元。2014年兴业银行市场地位和品牌形象稳步提升,稳居全球银行50强(英国《银行家》杂志排名)、世界企业500强(美国《财富》杂志排名)和全球上市企业200强(美国《福布斯》杂志排名)行列,在国内外各种权威机构组织的评比中,先后荣获最佳中资银行、最佳战略创新银行、最佳绿色银行、最佳互联网金融平台银行、普惠金融实践最佳银行、最具社会责任上市公司、中华慈善突出贡献(单位)奖、中国最佳雇主等荣誉。

(三)托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室,共有员工97人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(四)基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截止2014年12月31日,兴业银行已托管开放式基金33只——兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深300指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、兴全保本混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、工银瑞信60天理财债券型证券投资基金、银河沪深300成长增强指数分级证券投资基金、工银瑞信金融地产行业股票型证券投资基金、华安沪深300量化增强证券投资基金、国金通用鑫盈货币市场证券投资基金、易方达裕惠回报债券型证券投资基金、大成添利宝货币市场基金、工银瑞信纯债债券型证券投资基金、工银瑞信现金快线货币市场基金、广发活期宝货币市场基金、华福货币市场基金、景顺长城景丰货币市场基金、兴全添利宝货币市场基金、中银薪钱包货币市场基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金,托管基金财产规模1292.93亿元。

(五)基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金资产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督;资产托管部内设独立、专职的稽核监察处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则:风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则:资产托管部设立独立的稽核监察处,该处室保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则:各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6)有效性原则:内控控制体系同所处的环境相适应,以合理的成本实现内控目标,内部制度的制订应当具有前瞻性,并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要,适时进行相应修改和完善;内控控制应当具有高度的权威性,任何人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

(7)审慎性原则:内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控先为”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设。

(8)责任追究原则:各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

4、内部控制制度及措施

(1)制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。
(2)建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。
(3)风险识别与评估:稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。
(4)相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。
(5)人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。
(6)应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

(六)基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定,基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场的信用风险控制、基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金的申购与赎回、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

基金托管人每日按时通过托管业务系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控;如发现接近法律法规和基金合同规定的控制比例情况,严密监视,及时提醒基金管理人;发现违规行为,与基金管理人进行情况核实,并向基金管理人发出书面通知,督促其纠正,同时报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人并及时向中国证监会报告。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名　称:景顺长城基金管理有限公司
住　所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:赵如冰
批准设立文号:证监基金字[2003]76号
电　话:0755-82370388-1661
传　真:0755-22381325
联系人:严丽娟

2、其他销售机构

兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人:高建平
电话:(0591)87844211
联系人:陈丹
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的增减或变更销售机构的相关公告。

二、登记机构

名　称:景顺长城基金管理有限公司
住　所:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
办公地址:深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层
法定代表人:赵如冰
电　话:0755-82370388-1668
传　真:0755-22381325
联系人:杨淑

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:孙睿

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人:杨绍信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:单峰　陈熹

四、基金的名称

景顺长城景丰货币市场基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在保持基金资产安全性和高流动性的基础上,通过运用各种投资工具及投资策略,力争获取高于业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于以下金融工具,包括:

1、现金;
2、通知存款;
3、短期融资券;
4、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;
5、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、协议存款、大额存单;
6、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;
7、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券;
8、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据;
9、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
10、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

未来若法律法规或监管机构允许货币市场基金投资同业存单或其他品种,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的条件下,基金管理人在履行适当程序后,本基金可参与同业存单或其他品种的投资,具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

八、基金的投资策略

1、整体资产配置策略

本基金根据对短期利率变动的合理预判,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,综合分析宏观经济指标,包括全球经济发展形势、国内经济情况、货币政策、财政政策、物价水平变动趋势、利率水平和市场预期、通货膨胀率、货币供应量等,对短期利率走势进行综合判断,同时分析央行公开市场操作、主流资金的短期投资倾向、债券供给、货币市场与资本市场资金互动等,并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。预期市场利率水平上升,适度缩短投资组合的平均剩余期限,以降低组合下跌风险;预期市场利率水平下降,适度延长投资组合的平均剩余期限,以分享债券价格上升的收益。

2、类属配置策略

类属配置是指基金组合在国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等投资品种之间的配置比例。实现基金流动性需求并获得投资收益。

通过对各类别金融工具政策倾向、税收政策、信用等级、收益率水平、资金供求、流动性等因素的研究判断,来确定并动态调整投资组合国债、央行票据、债券回购、金融债、短期融资券及现金等各类属品种的配置比例,以满足投资人对基金流动性的需求,并达到获取投资收益的目的

3、个券选择策略

在个券选择层面,将首先考虑安全性因素,优先选择央票、短期国债等高信用等级的债券品种以规避违约风险。除考虑安全性因素外,在具体的券种选择上,基金管理人将在正确拟合收益率曲线的基础上,找出收益率明显偏高的券种,并客观分析收益率出现偏离的原因。若出现因市场原因所导致的收益率高于公允水平,则该券种价格出现低估,本基金将对此类低估品品种进行重点关注。此外,鉴于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段,从而指导相对价值投资,这也可以帮助基金管理人选择投资于定价低估的短期债券品种。

4、套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异、资金供求失衡、流动性等因素造成不同交易市场或不同交易品种出现定价差异现象,从而使债券市场上存在套利机会。在保证安全性和流动性的前提下,本基金将在充分验证这种套利机会可行性的基础上,适当参与市场的套利,捕捉和把握无风险套利机会,以获取安全的超额收益。

5、回购策略

(1)息差放大策略:该策略是指利用回购利率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是利用买入债券进行正回购,再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种,如此循环至回购期结束卖出债券偿还所融入资金。在进行回购放大操作时,基金管理人将严格遵守相关法律法规关于债券正回购的有关规定。

(2)逆回购策略:基金管理人将密切关注由于新股申购等原因导致短期资金需求激增的机会,通过逆回购的方式融出资金以分享短期资金利率陡升的投资机会。

6、流动性管理策略

本基金将保持高流动性的特性,将建立流动性预警指标,动态调整基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例。同时,密切关注本基金申购/赎回、季节性资金流动等情况,日历效应等,适时通过现金留存、提高流动性券种比例等方式提高基金资产整体的流动性,以确保基金资产的整体变现能力。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)

本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。如果法律法规或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用,或有其他代表性更强、更科学客观的或者更能为市场普遍接受的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,并在更新的招募说明书中列示,而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

十一、投资组合报告(未经审计)

景顺长城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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2014年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	210,602,623.00	8.06
	其中:债券	210,602,623.00	8.06
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,093,802,090.70	41.87
	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	1,286,393,461.90	49.24
4	其他资产	21,651,468.75	0.83
5	合计	2,612,449,644.35	100.00

注:银行存款和结算备付金中包含定期存款1,265,000,000.00元。

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	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00
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:报告期末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基金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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的20%。

3. 基金投资组合平均剩余期限

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	38
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	95
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

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,本基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

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	54.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.67	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	28.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	2.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	1.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.80	-

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	120,084,551.18	4.61
	其中:政策性金融债	120,084,551.18	4.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	90,518,071.82	3.47
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	210,602,623.00	8.08
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	140204	14国开04	550,000	54,987,993.05	2.11
2	140410	14农发10	500,000	50,074,040.91	1.92
3	041469029	14丰台国资CP001	200,000	20,157,383.50	0.77
4	041454038	14恒远CP001	200,000	20,127,170.49	0.77
5	041464045	14岱海CP001	200,000	20,105,032.23	0.77
6	041452043	14红豆CP002	100,000	10,063,265.77	0.39
7	041469047	14顺鑫CP002	100,000	10,057,139.43	0.39
8	011499041	14徐工SCP002	100,000	10,008,080.40	0.38
9	140213	14国开13	100,000	10,007,432.74	0.38
10	140207	14国开07	50,000	5,015,084.48	0.19

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	0.0653%
报告期内偏离度的最低值	-0.0442%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0190%

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。

8. 投资组合报告附注

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。

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。

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。

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	10,009,997.22
3	应收利息	11,641,471.53
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,651,468.75

十二、基金的业绩

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。基金业绩数据截至2014年12月31日。

1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

景顺长城景丰货币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
2014年9月16日-2014年12月31日	1.2078%	0.0036%	0.3958%	0.0000%	0.8120%	0.0036%

注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

景顺长城景丰货币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
2014年9月16日-2014年12月31日	1.2789%	0.0037%	0.3958%	0.0000%	0.8831%	0.0037%

注:本基金的收益分配为每日分配,按月结转份额。

2. 自基金合同生效以来基金累计份额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:本基金的建仓期为2014年9月16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(2014年9月16日)起至本报告期末不满一年。

十三、基金费用概览

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人与基金托管人核对后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支