

景顺长城四季金利债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 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.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 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贵金属投资明细.....	40
7.9 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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.11 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城四季金利债券型证券投资基金	
基金简称	景顺长城四季金利债券	
场内简称	无	
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	
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	
报告期末基金份额总额	394,561,128.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
下属分级基金的交易代码:	000181	000182
报告期末下属分级基金的份额总额	384,840,997.29 份	9,720,131.29 份

2.2 基金产品说明

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	<p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>3、权益资产投资策略</p> <p>(1) 股票投资策略：本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的；</p> <p>(2) 权证投资策略：本基金不直接购买权证等衍生品资产，但有可能持有所</p>

	持股票所派发的权证或因投资分离交易可转债而产生的权证等。本基金管理人将以价值分析为基础，在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率等指标选择权证的卖出时机。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨晔阳	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座九层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		赵如冰	刘士余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
------	----------------	----------------

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	8,262,379.69	589,011.36
本期利润	8,828,928.82	921,680.81
加权平均基金份额本期利润	0.0311	0.0401
本期加权平均净值利润率	2.94%	3.81%
本期基金份额净值增长率	3.10%	2.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配利润	12,284,712.83	282,529.39
期末可供分配基金份额利润	0.0319	0.0291
期末基金资产净值	404,593,397.59	10,191,368.36
期末基金份额净值	1.051	1.048
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	17.45%	16.69%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、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 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

景顺长城四季金利债券 A 类

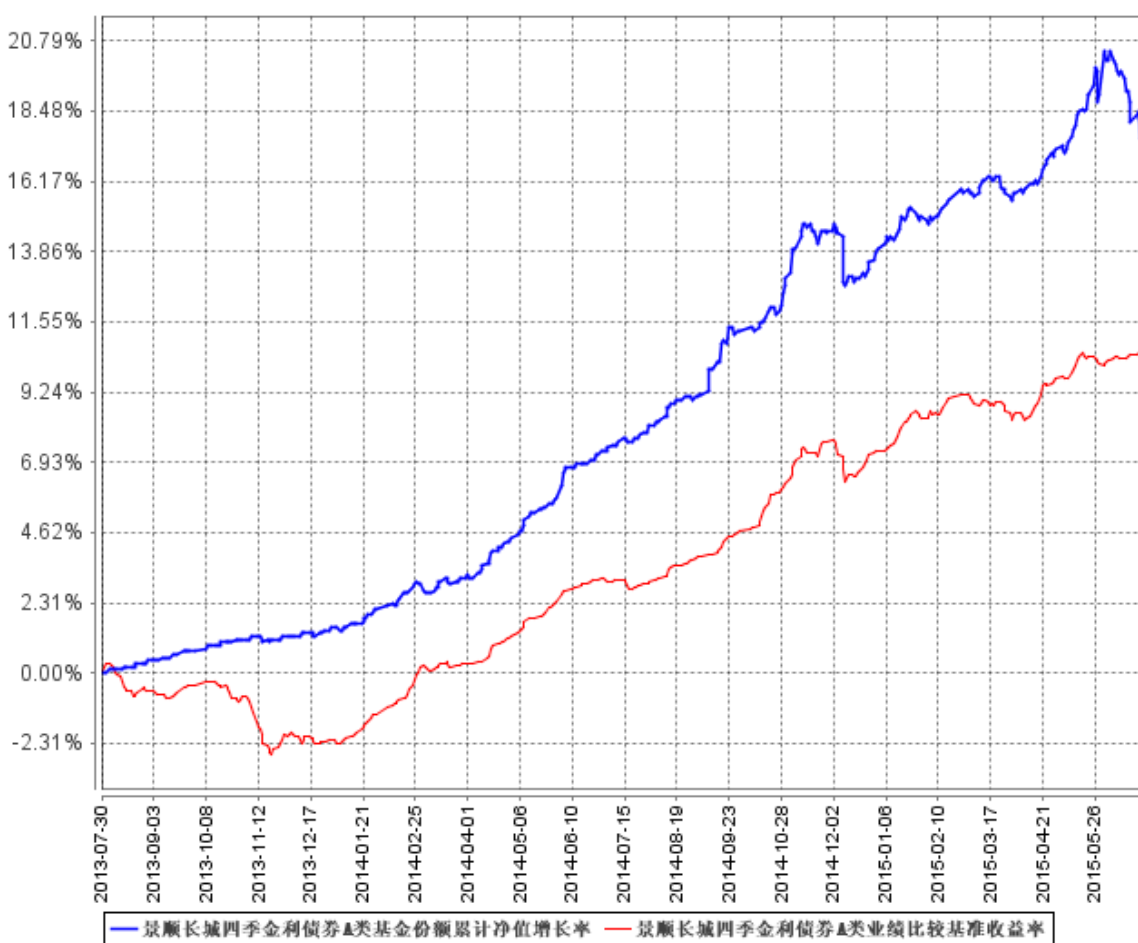
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-1.31%	0.38%	0.40%	0.04%	-1.71%	0.34%
过去三个月	1.64%	0.28%	2.09%	0.08%	-0.45%	0.20%
过去六个月	3.10%	0.21%	3.07%	0.08%	0.03%	0.13%
过去一年	9.46%	0.20%	7.28%	0.09%	2.18%	0.11%
自基金合同生效起至今	17.45%	0.15%	10.62%	0.09%	6.83%	0.06%

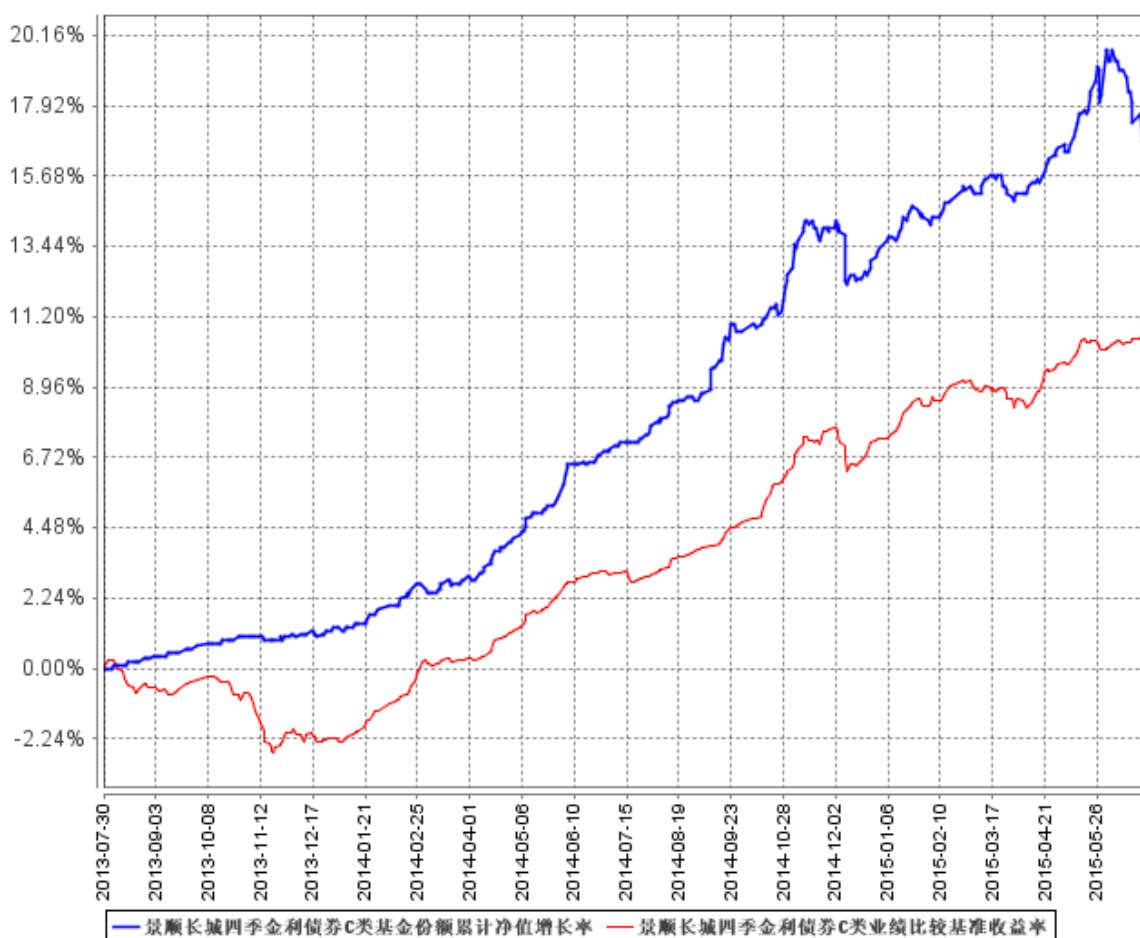
景顺长城四季金利债券 C 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-1.32%	0.38%	0.40%	0.04%	-1.72%	0.34%
过去三个月	1.55%	0.27%	2.09%	0.08%	-0.54%	0.19%
过去六个月	2.91%	0.21%	3.07%	0.08%	-0.16%	0.13%
过去一年	9.17%	0.20%	7.28%	0.09%	1.89%	0.11%
自基金合同生效起至今	16.69%	0.15%	10.62%	0.09%	6.07%	0.06%

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：景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同已于 2013 年 7 月 30 日生效，2015 年 5 月 7 日至 6 月 7 日本基金以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》，调整后的基金更名为景顺长城四季金利债券型证券投资基金，其基金合同于 2015 年 6 月 10 日生效。调整后本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，由长城证券股份有限公司、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%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止2015年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理46只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证800食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、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。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁媛	景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金经理，景顺长城景益货币市场基金基金经理，景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理	2014年4月4日	-	8	经济学硕士。曾任职于齐鲁证券北四环营业部，也曾担任中航证券证券投资部投资经理、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013年7月加入本公司，担任固定收益部资深研究员；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、《景顺长城四季金利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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较

少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

受 1 万亿地方债务置换引发利率债放量猜想且央行未对流动性支持表态以及叠加基本面回暖预期和股市火爆等因素，1 季度债券市场经历“过山车”行情。2 季度债券市场在国内经济下行压力仍存，央行降准降息以及流动性充裕等因素的影响下，收益率以下行为主。从品种表现上看，上半年 10 年期国开债、5 年期国开债、3 年期 AA 中票和 3 年期 AA 城投债的收益率分别下行 0BP、18BP、67BP 和 77BP，信用债表现好于利率债，中短端品种表现好于长端。统计来看，中债新综合指数（财富）上半年较去年年底上涨了 3.12%。分品种看，中债国债总净价指数上涨 1.01%，中债企业债净价指数上涨 1.68%，中债短融总净价指数上涨 0.32%，可转债表现最差，中标可转债下跌 7.8%。权益市场则经历过山车行情，上证综指从 1 月初的 3234 点一路上行至 5178 点的高点，随后大盘一路下挫至 4277 点，较高点下跌 21.07%。

宏观经济方面，连续两个季度经济增长 7%，2 季度经济数据略好于 1 季度，PMI 数据小幅好转，但经济依然缺乏增长动力，消费乏善可陈，进出口数据不佳，投资增速进一步下滑，制造业投资受累去产能，投资中只有基建尚可，房地产销量数据有回升，但传导到新开工尚待观察。通胀小幅回升但处低位，仍在可控范围内。2015 年风险在蔓延也在消解。地方债务置换和平台政策松动将有助于融资平台缓释风险，并发挥稳增长的积极作用。银行不良贷款延续双升，成为银行利润下滑主因。6 月股灾也将对金融和经济产生影响。

上半年，积极财政和货币政策力度空前：财政赤字大幅增加，置换债券从无到有；货币政策宽松，央行通过三次降息，三次降准托底经济，并通过公开市场操作宽松资金面。在宽松货币政策推动下，资金利率回落至近年低点。2 季度银行间和交易所 7 天回购利率均值分别为 2.50% 和 2.82%，较去年 4 季度的 4.12% 和 4.22% 明显回落。

鉴于经济基本面偏弱且数据回暖大概率在 2 季度后，政策预期依然宽松，信用债的票息仍然相对吸引，本基金 2 季度维持久期在 3.5 年左右，维持一般杠杆操作，整体配置思路仍是在控制信用风险和流动风险可控的前提下，保持杠杆在一定水平，主要建仓资质较好的 3 年内城投债和短久期民企短融，获取票息收入。根据基本面变化，适度参与了利率债的交易性机会。同时，积极参与权益市场快速上涨带来的可转债投资机会。本基金本季度完成二级债基改制，鉴于权益市场波动加大，组合严格控制及调整股票的投资比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，四季金利 A 份额净值增长率为 3.10%，高于业绩比较基准收益率 0.03%。

2015 年上半年，四季金利 C 份额净值增长率为 2.91%，低于业绩比较基准收益率 0.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

5 月中下旬以来，融资平台和地方政府融资受限不断放宽，地方政府债务置换额度上升，融资平台的发债限制也放宽，财政政策刺激下，基建投资增速预计在 3 季度有所企稳。6 月中采制造业 PMI 持平，经济维持低位暂稳，驱动力来自稳增长加码和地产回暖，但经济企稳基础不牢，财政货币宽松方向不变。6 月 27 日降准降息主要是为稳定权益市场，央行货币政策依然偏松，但结合股市表现、经济企稳程度等因素，下半年货币政策宽松力度预计将有所减弱，将主要通过定向宽松的方式进行。在利率市场化进一步加速及未来美联储加息影响下，央行需要投放基础货币来释放流动性，今年以来诸如 MLF、SLF、SLO、PSL 等定向工具依然会被采用，考虑到资金外流压力和宽信用支持需要，3 季度或将再次整体降准。财政政策有发力迹象，扩大财政赤字，发行第三批置换债券，盘活存量资金。

资金面上，央行近期连续降低 7 天逆回购利率至 2.5%，有意引导资金利率下行，因此推断 7 天回购 2.5-3%附近应为央行近期合意利率。后期资金利率的下行依赖于央行进一步宽松的货币政策。

地方政府债务置换额度加大，3 季度或将出台第三批置换额度，地方债供给加大将制约利率债表现。万亿地方债务置换降低了城投债的信用风险，城投债配置价值仍在。产业债方面，需要对行业进行深入研究，深挖公司基本面。

7 月初 IPO 暂停带来的打新理财资金的回流成为近期债券市场的主要配置力量。预计 3 季度债券收益率在上下 20BP 的空间上波动，上行幅度不大，毕竟经济基本面仍偏弱。若 3 年期 AA 评级信用债收益率回升至 5.30%-5.5%附近，预计将有配置盘进行加仓。

组合投资上将继续控制债券的久期和维持杠杆比例，密切关注各项宏观经济数据、政策调整和市场资金面情况，以适当久期、中高信用等级信用债为主，利率债配置为辅的操作。权益市场波动加大，组合将控制权益资产的投资比例，以业绩成长较确定的白马股为主要投资标的。积极参与新发转债机会，兼顾权益市场的投资机会，保持对组合的信用风险和流动性风险的关注，努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律

法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的

固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了两次利润分配：

(1) 截至 2014 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 7,545,181.53 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 3,772,590.77 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 1,983,789.20 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 991,894.60 元，本基金的基金管理人已于 2015 年 1 月 14 日完成权益登记，本基金 A 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.26 元，本基金 C 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.24 元，详细信息请查阅相关分红公告。

(2) 截至 2015 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 8,115,920.56 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 4,057,960.28 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 756,261.25 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 378,130.63 元，本基金的基金管理人已于 2015 年 4 月 8 日完成权益登记，本基金 A 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.2 元，本基金 C 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.2 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——景顺长城基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利

益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城四季金利债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,018,024.59	6,891,695.46
结算备付金		1,990,904.37	3,658,744.35
存出保证金		28,879.72	29,481.57
交易性金融资产	6.4.7.2	541,462,292.35	342,214,960.09
其中：股票投资		11,672,268.15	-
基金投资		-	-
债券投资		529,790,024.20	342,214,960.09
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,290,205.15	783,599.22
应收利息	6.4.7.5	15,918,433.36	9,456,435.63
应收股利		-	-
应收申购款		367,826.64	1,020,989.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		565,076,566.18	364,055,906.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		148,499,710.00	157,499,508.50
应付证券清算款		514,172.46	719,628.79
应付赎回款		808,430.11	1,407,746.41
应付管理人报酬		141,106.73	93,618.93
应付托管费		70,553.35	39,281.48
应付销售服务费		3,737.17	17,897.85
应付交易费用	6.4.7.7	38,061.20	12,106.81
应交税费		-	-
应付利息		27,480.24	47,890.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	188,548.97	159,873.89
负债合计		150,291,800.23	159,997,553.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	394,561,128.58	191,698,499.31
未分配利润	6.4.7.10	20,223,637.37	12,359,853.95
所有者权益合计		414,784,765.95	204,058,353.26
负债和所有者权益总计		565,076,566.18	364,055,906.27

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 394,561,128.58 份，其中景顺长城四季金利债券型证券投资基金 A 类份额净值 1.051 元，份额总额 384,840,997.29 份；景顺长城四季金利债券型证券投资基金 C 类份额净值 1.048 元，份额总额 9,720,131.29 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城四季金利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		13,662,139.66	8,844,357.67
1.利息收入		14,139,831.74	5,740,443.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,701.98	500,590.46
债券利息收入		14,065,952.49	5,216,581.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,177.27	23,270.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,391,008.59	1,148,676.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,593,398.35	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	202,389.76	1,148,676.96

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	899,218.58	1,946,355.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,097.93	8,881.45
减：二、费用		3,911,530.03	1,883,350.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	637,687.31	407,644.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	318,843.58	135,881.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,583.57	57,396.92
4. 交易费用	6.4.7.18	49,337.47	5,692.28
5. 利息支出		2,643,976.74	1,067,070.72
其中：卖出回购金融资产支出		2,643,976.74	1,067,070.72
6. 其他费用	6.4.7.19	213,101.36	209,664.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,750,609.63	6,961,007.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,750,609.63	6,961,007.31

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城四季金利债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	191,698,499.31	12,359,853.95	204,058,353.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,750,609.63	9,750,609.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号	202,862,629.27	9,430,814.46	212,293,443.73

填列)			
其中: 1.基金申购款	372,298,171.73	20,425,626.68	392,723,798.41
2.基金赎回款	-169,435,542.46	-10,994,812.22	-180,430,354.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-11,317,640.67	-11,317,640.67
五、期末所有者权益(基金净值)	394,561,128.58	20,223,637.37	414,784,765.95
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	193,636,457.96	2,782,040.86	196,418,498.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,961,007.31	6,961,007.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-115,078,479.88	-2,522,539.20	-117,601,019.08
其中: 1.基金申购款	38,126,274.17	1,214,523.33	39,340,797.50
2.基金赎回款	-153,204,754.05	-3,737,062.53	-156,941,816.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-3,351,415.32	-3,351,415.32
五、期末所有者权益(基金净值)	78,557,978.08	3,869,093.65	82,427,071.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

许义明

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]625号文《关于核准景顺长城四季金利纯债

债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 7 月 26 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第 60467014_H01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 7 月 30 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,064,738,238.25 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 548,206.26 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,065,286,444.51 元，折合 1,065,286,444.51 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。（以下简称“中国农业银行”）

根据《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。在基金管理人认为合适的情况下，基金管理人可以根据相关法律法规的规定，提供本基金不同基金份额类别之间的转换服务。基金份额类别间转换的数量限制、转换费率等事项由基金管理人依法决定并另行公告。

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同已于 2013 年 7 月 30 日生效，2015 年 5 月 7 日至 6 月 7 日本基金以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》，调整后的基金更名为景顺长城四季金利债券型证券投资基金，其基金合同于 2015 年 6 月 10 日生效。调整后本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证综合债券指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基

金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致，会计估计变更的说明参见 6.4.5.2。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的规定，自 2015 年 3 月 24 日起，本基金持有的交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征收营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	3,018,024.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,018,024.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,309,241.20	11,672,268.15	-3,636,973.05

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	224,543,285.07	224,306,924.20	-236,360.87
	银行间市场	301,516,879.75	305,483,100.00	3,966,220.25
	合计	526,060,164.82	529,790,024.20	3,729,859.38
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		541,369,406.02	541,462,292.35	92,886.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末的买入返售金融资产项目余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	688.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	806.31
应收债券利息	15,916,925.34
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.18
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.70
合计	15,918,433.36

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日

交易所市场应付交易费用	27,081.42
银行间市场应付交易费用	10,979.78
合计	38,061.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,176.64
预提费用	187,372.33
合计	188,548.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城四季金利债券 A 类		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,692,654.41	149,692,654.41
本期申购	357,791,673.53	357,791,673.53
本期赎回(以“-”号填列)	-122,643,330.65	-122,643,330.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	384,840,997.29	384,840,997.29

金额单位：人民币元

景顺长城四季金利债券 C 类		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,005,844.90	42,005,844.90
本期申购	14,506,498.20	14,506,498.20
本期赎回(以“-”号填列)	-46,792,211.81	-46,792,211.81
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	9,720,131.29	9,720,131.29

注：本期申购份额包含基金转入份额及红利再投资；本期赎回份额包含基金转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城四季金利债券 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,545,181.53	2,210,165.87	9,755,347.40
本期利润	8,262,379.69	566,549.13	8,828,928.82
本期基金份额交易产生的变动数	6,474,516.61	4,690,972.47	11,165,489.08
其中：基金申购款	10,370,321.66	9,360,622.13	19,730,943.79
基金赎回款	-3,895,805.05	-4,669,649.66	-8,565,454.71
本期已分配利润	-9,997,365.00	-	-9,997,365.00
本期末	12,284,712.83	7,467,687.47	19,752,400.30

单位：人民币元

景顺长城四季金利债券 C 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,983,789.20	620,717.35	2,604,506.55
本期利润	589,011.36	332,669.45	921,680.81
本期基金份额交易产生的变动数	-969,995.50	-764,679.12	-1,734,674.62
其中：基金申购款	357,252.32	337,430.57	694,682.89
基金赎回款	-1,327,247.82	-1,102,109.69	-2,429,357.51
本期已分配利润	-1,320,275.67	-	-1,320,275.67
本期末	282,529.39	188,707.68	471,237.07

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,123.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	22,809.58
其他	17,768.45
合计	69,701.98

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	6,421,971.60
减：卖出股票成本总额	8,015,369.95
买卖股票差价收入	-1,593,398.35

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	372,570,613.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	363,018,003.41
减：应收利息总额	9,350,220.56
买卖债券差价收入	202,389.76

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金于本期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	899,218.58
——股票投资	-3,636,973.05
——债券投资	4,536,191.63
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	899,218.58

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	4,889.97
基金转换费收入	9,207.96
合计	14,097.93

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	38,872.47
银行间市场交易费用	6,215.00
转托管费用	4,250.00
合计	49,337.47

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	18,053.84
银行划款手续费	16,429.03
其他	100.00
合计	213,101.36

6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	24,500,860.80	82.37%	-	-

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
长城证券	40,975,622.68	10.69%	15,429,384.88	12.78%

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长城证券	18,100,000.00	0.74%	1,224,455,000.00	44.26%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
长城证券	22,305.79	82.37%	22,305.79	82.37%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
长城证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6 月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30 日
	当期发生的基金应支付的管理费	637,687.31
其中：支付销售机构的客户维护费	35,284.13	178,889.12

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本基金自 2014 年 12 月 9 日起，基金管理费年费率从 0.60% 调整为 0.40%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	318,843.58	135,881.44

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	10,555.25	10,555.25
中国农业银行	-	24,931.82	24,931.82
长城证券	-	-	-
合计	-	35,487.07	35,487.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	4,031.86	4,031.86
中国农业银行	-	52,182.04	52,182.04
长城证券	-	-	-
合计	-	56,213.90	56,213.90

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

计算方法如下： $H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间与关联方均未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,018,024.59	29,123.95	8,328,900.65	13,420.23

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

景顺长城四季金利债券 A 类

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2015年4月8日	2015年4月8日	0.200	6,113,204.02	21,409.85	6,134,613.87	
2	2015年1月14日	2015年1月14日	0.260	3,834,147.11	28,604.02	3,862,751.13	
合计	-	-	0.460	9,947,351.13	50,013.87	9,997,365.00	

景顺长城四季金利债券 C 类

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2015年4月8日	2015年4月8日	0.200	329,114.26	65,383.03	394,497.29	
2	2015年1月14日	2015年1月14日	0.240	853,354.14	72,424.24	925,778.38	
合计	-	-	0.440	1,182,468.40	137,807.27	1,320,275.67	

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本于期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600643	爱建股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项	16.73	-	-	161,465	3,586,534.61	2,701,309.45	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 59,999,710.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1480466	14 绍交投债	2015 年 7 月 1 日	103.51	100,000	10,351,000.00
1380354	13 崇明债	2015 年 7 月 1 日	105.83	200,000	21,166,000.00
1480060	14 毕节开源债	2015 年 7 月 1 日	107.42	300,000	32,226,000.00
合计				600,000	63,743,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 88,500,000.00 元，分别于 2015 年 7 月 1 日和 2015 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人

配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,018,024.59	-	-	-	-	-	3,018,024.59
结算备付金	1,990,904.37	-	-	-	-	-	1,990,904.37
存出保证金	28,879.72	-	-	-	-	-	28,879.72
交易性金融资产	10,499,892.90	24,355,993.00	90,180,462.55	368,894,800.95	35,858,874.80	11,672,268.15	541,462,292.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,290,205.15	2,290,205.15
应收利息	-	-	-	-	-	15,918,433.36	15,918,433.36
应收申购款	42,778.98	-	-	-	-	325,047.66	367,826.64
资产总计	15,580,480.56	24,355,993.00	90,180,462.55	368,894,800.95	35,858,874.80	30,205,954.32	565,076,566.18
负债							
卖出回购金融资产款	148,499,710.00	-	-	-	-	-	148,499,710.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	514,172.46	514,172.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	808,430.11	808,430.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	141,106.73	141,106.73
应付托管费	-	-	-	-	-	70,553.35	70,553.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,737.17	3,737.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,061.20	38,061.20
应付利息	-	-	-	-	-	27,480.24	27,480.24
其他负债	-	-	-	-	-	188,548.97	188,548.97
负债总计	148,499,710.00	-	-	-	-	1,792,090.23	150,291,800.23
利率敏感度缺口	-132,919,229.44	24,355,993.00	90,180,462.55	368,894,800.95	35,858,874.80	-	-
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,891,695.46	-	-	-	-	-	6,891,695.46
结算备付金	3,658,744.35	-	-	-	-	-	3,658,744.35
存出保证金	29,481.57	-	-	-	-	-	29,481.57
交易性金融资产	-	33,657,396.28	66,995,717.40	195,661,442.09	45,900,404.32	-	342,214,960.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	783,599.22	783,599.22
应收利息	-	-	-	-	-	9,456,435.63	9,456,435.63
应收申购款	1,000,510.50	-	-	-	-	20,479.45	1,020,989.95
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,580,431.88	33,657,396.28	66,995,717.40	195,661,442.09	45,900,404.32	10,260,514.30	364,055,906.27
负债							
卖出回购金融资产款	157,499,508.50	-	-	-	-	-	157,499,508.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-	719,628.79	719,628.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,407,746.41	1,407,746.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	93,618.93	93,618.93

应付托管费	-	-	-	-	-	39,281.48	39,281.48
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,897.85	17,897.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	12,106.81	12,106.81
应付利息	-	-	-	-	-	47,890.35	47,890.35
其他负债	-	-	-	-	-	159,873.89	159,873.89
负债总计	157,499,508.50	-	-	-	-	2,498,044.51	159,997,553.01
利率敏感度缺口	-145,919,076.62	33,657,396.28	66,995,717.40	195,661,442.09	45,900,404.32	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-3,211,663.63	-2,292,733.41
	市场利率下降25个基点	3,246,645.29	2,319,607.03

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同已于2013年7月30日生效，2015年5月7日至6月7日本基金以通讯开会方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》，调整后的基金更名为景顺长城四季金利债券型证券投资基金，其基金合同于2015年6月10日生效。调整后本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。于2015年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	11,672,268.15	2.81	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	529,790,024.20	127.73	342,214,960.09	167.70
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	541,462,292.35	130.54	342,214,960.09	167.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数×80%”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. “沪深 300 指数×80%”上升 5%	414,784.77	-
	2. “沪深 300 指数×80%”下降 5%	-414,784.77	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.14.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项**(1) 公允价值**

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 10,781,358.70 元，划分为第二层次的余额为人民币 530,680,933.65 元，无划分为第三层次的余额（于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 50,238,992.09，划

分为第二层次的余额为人民币 291,975,968.00 元，无划分为第三层次的余额)。

公允价值所属层次间重大变动

对于特殊事项停牌的股票，本基金从进行估值调整之日起将相关股票公允价值所属层次从第一层次转入第二层次，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃的情况，本基金根据估值调整中输入值的可观察性和重要性以及对公允价值的影响程度，于本报告期内将相关债券的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。如上述影响因素消失，债券公允价值所属层次则从第二层次转入第一层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,672,268.15	2.07
	其中：股票	11,672,268.15	2.07
2	固定收益投资	529,790,024.20	93.76
	其中：债券	529,790,024.20	93.76
	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	5,008,928.96	0.89
7	其他各项资产	18,605,344.87	3.29
8	合计	565,076,566.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	3,432,000.00	0.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	518,958.70	0.13
E	建筑业	970,000.00	0.23
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	2,701,309.45	0.65
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	4,050,000.00	0.98
S	综合	-	-
	合计	11,672,268.15	2.81

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300133	华策影视	150,000	4,050,000.00	0.98
2	300032	金龙机电	100,000	3,432,000.00	0.83
3	600643	爱建股份	161,465	2,701,309.45	0.65
4	000090	天健集团	40,000	970,000.00	0.23
5	000958	东方能源	16,822	518,958.70	0.13

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300133	华策影视	8,309,444.00	4.07
2	600643	爱建股份	4,475,032.95	2.19
3	300032	金龙机电	4,260,049.20	2.09
4	000090	天健集团	4,131,941.00	2.02
5	000958	东方能源	1,567,644.00	0.77
6	300330	华虹计通	580,500.00	0.28

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000090	天健集团	2,196,041.00	1.08
2	300133	华策影视	2,145,297.00	1.05
3	000958	东方能源	917,944.60	0.45
4	600643	爱建股份	770,689.00	0.38
5	300330	华虹计通	392,000.00	0.19

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,324,611.15
卖出股票收入（成交）总额	6,421,971.60

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,161,500.00	12.33

	其中：政策性金融债	51,161,500.00	12.33
4	企业债券	379,596,124.20	91.52
5	企业短期融资券	30,182,000.00	7.28
6	中期票据	61,760,000.00	14.89
7	可转债	2,090,400.00	0.50
8	其他	5,000,000.00	1.21
9	合计	529,790,024.20	127.73

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)
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

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	1380312	13 湛江基投债	400,000	42,132,000.00	10.16
2	1480060	14 毕节开源债	300,000	32,226,000.00	7.77
3	124580	14 淮开控	300,000	31,716,000.00	7.65
4	1380354	13 崇明债	200,000	21,166,000.00	5.10
5	140224	14 国开 24	200,000	20,718,000.00	4.99

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	28,879.72
2	应收证券清算款	2,290,205.15
3	应收股利	-
4	应收利息	15,918,433.36
5	应收申购款	367,826.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,605,344.87

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600643	爱建股份	2,701,309.45	0.65	重大事项

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
景顺长城四季金利债券 A 类	708	543,560.73	371,286,093.33	96.48%	13,554,903.96	3.52%
景顺长城四季金利债券 C 类	295	32,949.60	0.00	0.00%	9,720,131.29	100.00%
合计	1,003	393,380.99	371,286,093.33	94.10%	23,275,035.25	5.90%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城四季金利债券 A 类	1.89	0.00%
	景顺长城四季金利债券 C 类	97.89	0.00%
	合计	99.78	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城四季金利债券 A 类	景顺长城四季金利债券 C 类
基金合同生效日 (2013 年 7 月 30 日) 基金份额总额	542,575,663.62	522,710,780.89
本报告期期初基金份额总额	149,692,654.41	42,005,844.90

本报告期基金总申购份额	357,791,673.53	14,506,498.20
减:本报告期基金总赎回份额	122,643,330.65	46,792,211.81
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	384,840,997.29	9,720,131.29

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,大会表决投票时间自 2015 年 5 月 7 日起,至 2015 年 6 月 7 日结束,表决通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》,本次大会决议自 2015 年 6 月 8 日起生效。本次持有人大会决议生效后,根据持有人大会通过的议案及方案说明,《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》将于 2015 年 6 月 10 日生效,《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》同日失效。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 日发布公告,经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过,同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

自 2015 年 6 月 10 日起,本基金的投资策略增加了相应权益资产投资策略(包括股票投资策略和权证投资策略)等相关内容。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券股份有限公司	1	24,500,860.80	82.37%	22,305.79	82.37%	未变更
海通证券股份有限公司	1	5,245,721.95	17.63%	4,775.63	17.63%	未变更
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
财富里昂证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
中国中投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更

中国国际金融 股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
光大证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变更
川财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变更
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
长城证券股份 有限公司	40,975,622.68	10.69%	18,100,000.00	0.74%	-	-
海通证券股份 有限公司	329,897,007.63	86.09%	2,428,400,000.00	99.26%	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

股份有限公司						
财富里昂证券 有限责任公司						
国信证券股份 有限公司						
华泰证券股份 有限公司						
东兴证券股份 有限公司						
平安证券有限 责任公司						
中国中投证券 有限责任公司						
中信证券股份 有限公司						
申银万国证券 股份有限公司						
东方证券股份 有限公司						
国盛证券有限 责任公司						
华福证券有限 责任公司						
中国国际金融 股份有限公司						
广发证券股份 有限公司						
光大证券股份 有限公司						
川财证券有限 责任公司						
招商证券股份 有限公司						
民生证券股份 有限公司						
国泰君安证券 股份有限公司	12,335,224.00	3.22%				
中国银河证券 股份有限公司						

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 9 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 16 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增苏州银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 16 日
4	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 22 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 1 月 23 日
6	关于景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金恢复接受贰佰万元(含)以上申购(含日常申购和定期定额申购)及转换转入业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 2 月 6 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于网上直销交易系统基金转换费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 2 月 11 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统基金转换费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 9 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和讯科技申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
10	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 16 日
11	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 16 日
12	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2014 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 31 日
13	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2014 年年度	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2015 年 3 月 31 日

	报告	金管理人网站	
14	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 4 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加华龙证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 17 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 17 日
17	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 21 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加汇付金融基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇付金融为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日
20	关于景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金限制壹佰万元(含)以上申购(含日常申购和定期定额申购)及转换转入业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 7 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金份额持有人大会的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 7 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加利得基金基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 8 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金份额持有人大会第一次提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 8 日
24	景顺长城基金管理有限公司	中国证券报, 上海证	2015 年 5 月 8 日

	关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
25	景顺长城基金管理有限公司关于以通讯开会方式召开景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金份额持有人大会第二次提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 11 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增川财证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加川财证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 1 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 4 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 9 日
32	景顺长城四季金利债券型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
33	景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
34	景顺长城四季金利债券型证	中国证券报, 上海证	2015 年 6 月 10 日

	券投资基金招募说明书	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
35	景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 10 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 12 日
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国民生银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 18 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加第一创业基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 26 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金于 2015 年 5 月 7 日至 6 月 7 日以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会, 会议审议并通过了《关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金投资范围、投资策略、基金收益分配原则相关事项的议案》, 该议案自 2015 年 6 月 8 日起生效。根据议案《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 10 日生效, 《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》同日失效。有关详细信息参见本公司于 2015 年 5 月 7 日至 6 月 9 日发布的一系列相关公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 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、《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城四季金利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城四季金利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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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
2015年8月29日