

# 景顺长城优信增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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
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
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	45
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城优信增利债券型证券投资基金	
基金简称	景顺长城优信增利债券	
场内简称	无	
基金主代码	261002	
交易代码	261002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 3 月 15 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	
报告期末基金份额总额	516,750,311.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	景顺长城优信增利债券 A 类	景顺长城优信增利债券 C 类
下属分级基金的交易代码:	261002	261102
报告期末下属分级基金的份额总额	507,830,599.19 份	8,919,712.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于信用债券类资产，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	资产配置策略：本基金依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策、以及债券市场和股票市场风险收益特征，分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平，预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平，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。 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	中证全债指数。
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于风险程度较低的投资品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		王永民
		010-66594896
		fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	赵如冰	田国立

## 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	景顺长城优信增利债券 A 类	景顺长城优信增利债券 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	44,639,453.68	390,047.60
本期利润	44,273,540.55	280,190.76
加权平均基金份额本期利润	0.0950	0.0670
本期加权平均净值利润率	7.91%	5.59%
本期基金份额净值增长率	8.48%	8.40%
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	122,420,715.62	2,016,415.91
期末可供分配基金份额利润	0.2411	0.2261
期末基金资产净值	630,251,314.81	10,936,127.97
期末基金份额净值	1.241	1.226
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	25.29%	23.78%

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

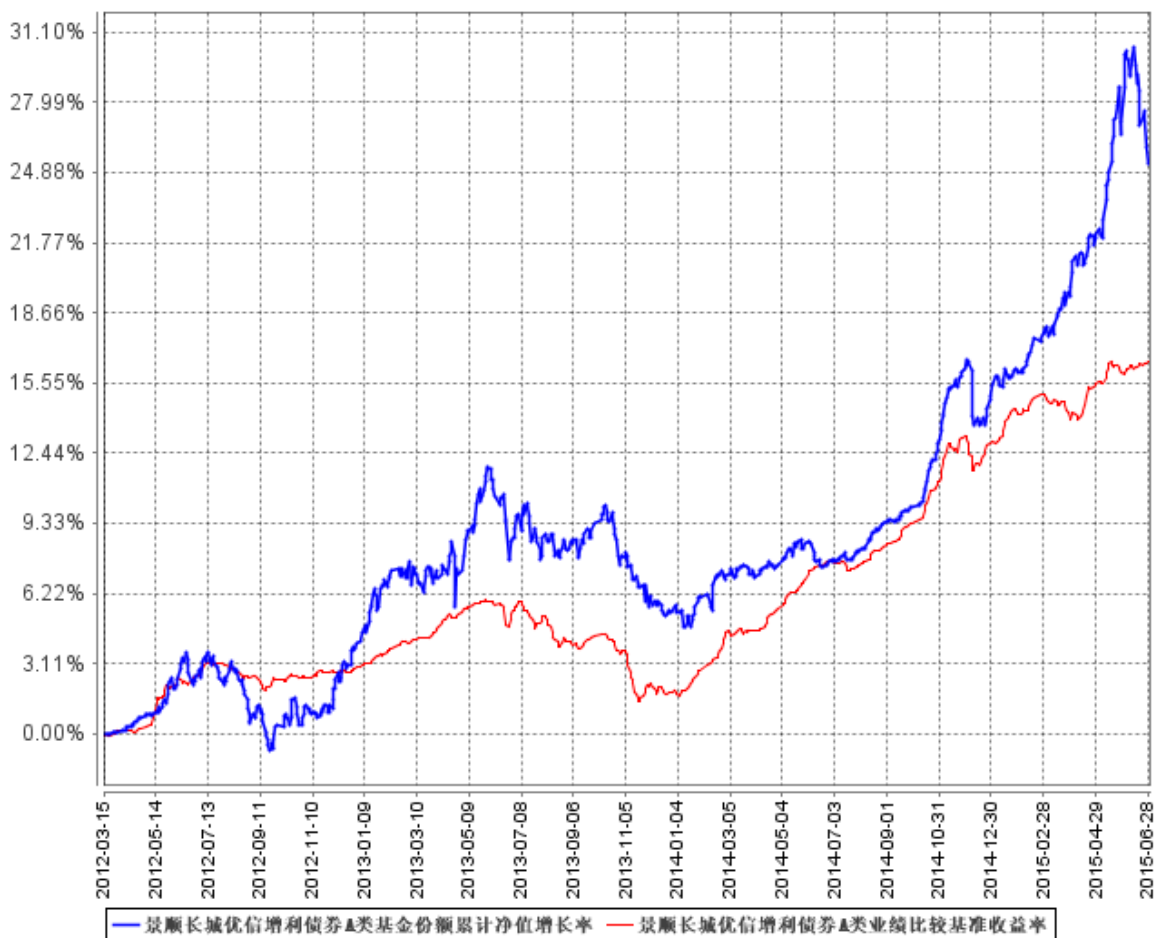
景顺长城优信增利债券 A 类

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	-1.43%	0.61%	0.43%	0.04%	-1.86%	0.57%
过去三个月	4.90%	0.48%	2.21%	0.09%	2.69%	0.39%
过去六个月	8.48%	0.37%	3.17%	0.09%	5.31%	0.28%
过去一年	16.31%	0.30%	8.19%	0.11%	8.12%	0.19%
过去三年	22.11%	0.30%	13.57%	0.09%	8.54%	0.21%
自基金合同生效起至今	25.29%	0.29%	16.51%	0.09%	8.78%	0.20%

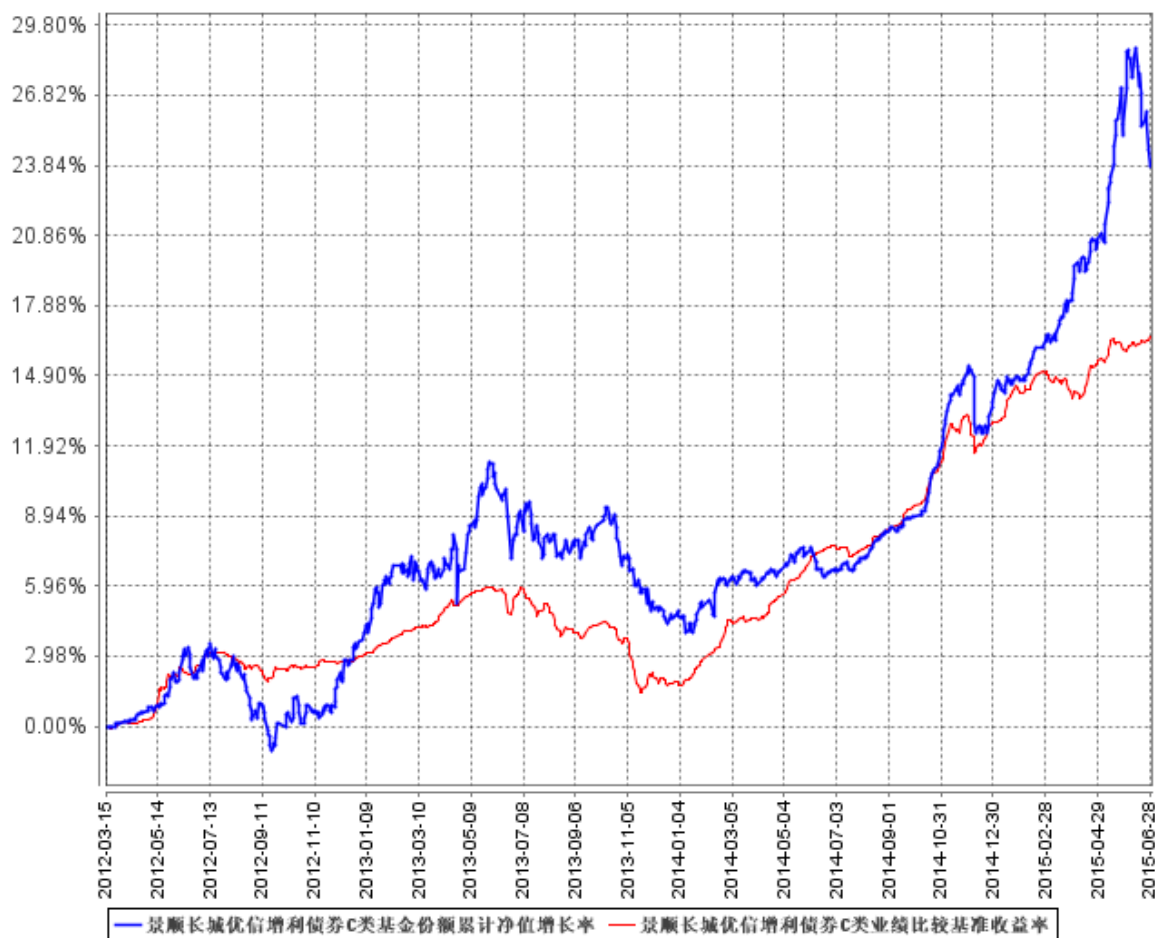
景顺长城优信增利债券 C 类

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	-1.45%	0.61%	0.43%	0.04%	-1.88%	0.57%
过去三个月	4.79%	0.49%	2.21%	0.09%	2.58%	0.40%
过去六个月	8.40%	0.37%	3.17%	0.09%	5.23%	0.28%
过去一年	15.99%	0.30%	8.19%	0.11%	7.80%	0.19%
过去三年	20.88%	0.30%	13.57%	0.09%	7.31%	0.21%
自基金合同生效起至今	23.78%	0.29%	16.51%	0.09%	7.27%	0.20%

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







注：本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的 80%（信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。），投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。按照本基金基金合同的规定，本基金的建仓期为自 2012 年 3 月 15 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。

## § 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		
陈文鹏	景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金经理，景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金基金经理，景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金经理	2014 年 8 月 8 日	-	7	经济学硕士。曾担任鹏元资信评估公司证券评级部分析师、中欧基金固定收益部信用研究员。2012 年 10 月加入本公司，担任固定收益部信用研究员；自 2014 年 6 月起担任基金经理。
RU PING (汝平)	景顺长城稳定收益债券型基金、鑫月薪定期支付债券型基金、优信增利债券型基金基金经理，国际投资部投资总监	2013 年 9 月 2 日	2015 年 1 月 26 日	19	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、RU PING(汝平)先生于 2015 年 1 月 26 日离任景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金经理，于 2015 年 4 月 2 日离任景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理，于 2015 年 4 月 30 日离任景顺长城稳定收益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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城优信增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

经济新常态下，上半年经济仍延续下行态势。消费数据相对平稳，进出口数据受内外需下滑影响表现较差，投资增速进一步下滑，基建和房地产投资增速表现很差。2 季度监管层放松对地方政府和融资平台的融资限制，基建投资增速小幅回升，对短期经济起到一定的托底作用。大宗商品价格维持低位，食品价格未出现超预期因素，上半年通胀压力不大。

经济基本面较差，货币政策进一步宽松，降准降息的频率加快，同时央行还进行了一系列的公开市场操作和定向宽松举措。尽管上半年新股发行力度较大，但除个别时点外，资金面较宽松，有利于债券基金的杠杆操作。

债券供给方面，地方债务置换额度加大导致利率债供给压力上升，实体企业融资需求下降，融资平台发债仍受到一定限制，信用债供给压力不大。需求方面，利率债需求一般，而理财资金对信用债配置需求较大，信用债需求整体尚可。

信用风险方面，随着刚性兑付的打破，违约个券家数不断上升，违约债券集中在产能过剩行业，城投债系统性风险可控，但也出现局部信用风险。

上半年长端利率债受下半年经济企稳和地方债供给冲击较大，收益率下行空间有限。而中短端利率和信用债收益率则稳步下行，上半年 10 年期国开债收益率上行 2BP，而 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 17BP、67BP 和 77BP，信用债表现好于利率债，中短端品种表现好于长端。

组合在保持杠杆比例、控制久期、控制信用风险的前提下，进行了适度调仓，降低中长期信用债，相应增加了短久期民企短融的配置。权益市场上半年表现很好，组合增加了对二级市场股票的配置比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，优信增利 A 份额净值增长率为 8.48%，高于业绩比较基准收益率 5.31%。

2015 年上半年，优信增利 C 份额净值增长率为 8.40%，高于业绩比较基准收益率 5.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面大幅回升可能性不大，但在基建投资带动下，经济数据预计有所企稳。通胀压力不大，但随着猪价回升，下半年通胀预计小幅回升。

货币政策仍将继续宽松，但宽松力度预计不如上半年，基本面在基建带动下有所企稳，而当前资金面已较宽松，实体企业财务费用压力也有所缓解。另外，下半年美元存在加息预期，人民币汇率是否贬值以及资金是否流出海外值得关注。

下半年利率债供给仍存在一定压力，公司债和企业债发行速度加大，信用债供给量预计有所回升。需求方面，利率债需求可能延续上半年的态势，而随着新股发行的暂停，理财资金等回流信用债配置需求旺盛，下半年信用债需求较大。

预计下半年利率债将围绕一定区间波动，10 年国开债的收益率预计在 3.80%到 4.20%的水平，信用利差仍维持低位，信用债配置价格仍可期待。

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，以中短久期、中高信用等级信用债为主，利率债配置为辅的操作。6 月份以来权益市场波动加大，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。

总体而言，本基金将密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，以适当久期、中高等级信用债投资为主、利率债为辅的债券投资思路，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及适用性的情况时，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

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城优信增利债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：景顺长城优信增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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,615,087.59	91,973,162.50
结算备付金		7,740,469.46	13,077,142.47
存出保证金		87,209.06	124,850.44
交易性金融资产	6.4.7.2	1,016,632,442.48	822,489,446.75
其中：股票投资		32,359,535.28	34,537,004.80
基金投资		-	-
债券投资		984,272,907.20	787,952,441.95
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		9,544,398.12	-
应收利息	6.4.7.5	24,495,694.07	20,263,541.30
应收股利		-	-
应收申购款		2,145,537.99	144,521.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,062,260,838.77	948,072,665.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		419,099,692.10	324,288,299.59
应付证券清算款		-	88,977,603.50
应付赎回款		1,089,254.60	38,492.87
应付管理人报酬		201,148.44	180,787.06
应付托管费		100,574.21	90,393.54
应付销售服务费		2,754.29	1,706.86
应付交易费用	6.4.7.7	300,422.76	114,913.73
应交税费		26,449.60	26,449.60
应付利息		50,787.76	125,655.87



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	202,312.23	169,021.77
负债合计		421,073,395.99	414,013,324.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	516,750,311.25	467,022,423.60
未分配利润	6.4.7.10	124,437,131.53	67,036,917.05
所有者权益合计		641,187,442.78	534,059,340.65
负债和所有者权益总计		1,062,260,838.77	948,072,665.04

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 516,750,311.25 份，其中景顺长城优信增利债券型基金 A 类份额净值 1.241 元，份额总额 507,830,599.19 份；景顺长城优信增利债券型基金 C 类份额净值 1.226 元，份额总额 8,919,712.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城优信增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
<b>一、收入</b>		53,496,721.10	1,199,535.79
1.利息收入		25,777,368.41	1,566,198.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,514.92	28,213.98
债券利息收入		25,673,452.61	1,477,070.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,400.88	60,914.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,180,179.55	-144,184.85
其中：股票投资收益	6.4.7.12	24,200,878.42	385,265.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,772,084.18	-532,530.42
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	207,216.95	3,080.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-475,769.97	-227,236.75
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	14,943.11	4,758.80
<b>减：二、费用</b>		8,942,989.79	620,653.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,117,832.67	171,641.02

2. 托管费	6.4.10.2.2	558,916.30	45,770.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,875.89	14,712.82
4. 交易费用	6.4.7.18	822,430.63	18,029.53
5. 利息支出		6,202,965.37	181,283.17
其中：卖出回购金融资产支出		6,202,965.37	181,283.17
6. 其他费用	6.4.7.19	230,968.93	189,215.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44,553,731.31	578,882.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44,553,731.31	578,882.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城优信增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）	467,022,423.60	67,036,917.05	534,059,340.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,553,731.31	44,553,731.31
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）	49,727,887.65	12,846,483.17	62,574,370.82
其中：1.基金申购款	71,276,985.23	17,491,463.02	88,768,448.25
2.基金赎回款	-21,549,097.58	-4,644,979.85	-26,194,077.43
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	516,750,311.25	124,437,131.53	641,187,442.78
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）	29,316,866.13	1,268,763.72	30,585,629.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	578,882.48	578,882.48
三、本期基金份额交易产生的基	259,475,243.74	17,333,459.90	276,808,703.64

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	276,553,820.02	18,234,509.76	294,788,329.78
2.基金赎回款	-17,078,576.28	-901,049.86	-17,979,626.14
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	288,792,109.87	19,181,106.10	307,973,215.97

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                                  吴建军                                  邵媛媛  
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城优信增利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[2011]1832号文《关于核准景顺长城优信增利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《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》作为发起人于2012年2月6日至2012年3月13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(2012)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2012年3月15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1,809,804,251.62元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币730,896.26元,以上实收基金(本息)合计为人民币1,810,535,147.88元,折合1,810,535,147.88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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城优信增利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。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回

购、A 股股票（包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票）、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的 80%。信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数。

#### 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,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按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	1,615,087.59
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,615,087.59

### 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	33,358,306.58	32,359,535.28	-998,771.30
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	360,318,297.04	363,124,207.20
	银行间市场	615,129,081.96	621,148,700.00
	合计	975,447,379.00	984,272,907.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,008,805,685.58	1,016,632,442.48	7,826,756.90

### 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	2,905.09
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	3,133.70
应收债券利息	24,488,619.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,000.04
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	35.28
合计	24,495,694.07

#### 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	290,243.09
银行间市场应付交易费用	10,179.67
合计	300,422.76

#### 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	5,021.10
预提费用	197,291.13
合计	202,312.23

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城优信增利债券 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	463,467,884.62	463,467,884.62
本期申购	57,963,030.34	57,963,030.34

本期赎回(以“-”号填列)	-13,600,315.77	-13,600,315.77
- 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	507,830,599.19	507,830,599.19

金额单位：人民币元

景顺长城优信增利债券 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	3,554,538.98	3,554,538.98
本期申购	13,313,954.89	13,313,954.89
本期赎回(以“-”号填列)	-7,948,781.81	-7,948,781.81
- 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	8,919,712.06	8,919,712.06

注：本期申购份额包含基金转入份额；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

景顺长城优信增利债券 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	82,564,378.42	-15,993,915.16	66,570,463.26
本期利润	44,639,453.68	-365,913.13	44,273,540.55
本期基金份额交易产生的变动数	12,314,757.74	-738,045.93	11,576,711.81
其中：基金申购款	15,531,177.50	-942,596.64	14,588,580.86
基金赎回款	-3,216,419.76	204,550.71	-3,011,869.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	139,518,589.84	-17,097,874.22	122,420,715.62

单位：人民币元

景顺长城优信增利债券 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	588,886.28	-122,432.49	466,453.79
本期利润	390,047.60	-109,856.84	280,190.76
本期基金份额交易产生的变动数	1,337,144.22	-67,372.86	1,269,771.36
其中：基金申购款	3,092,583.79	-189,701.63	2,902,882.16



基金赎回款	-1,755,439.57	122,328.77	-1,633,110.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,316,078.10	-299,662.19	2,016,415.91

#### 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	31,153.77
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	66,901.84
其他	1,459.31
合计	99,514.92

#### 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	273,789,420.76
减：卖出股票成本总额	249,588,542.34
买卖股票差价收入	24,200,878.42

#### 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	334,635,957.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	321,476,049.29
减：应收利息总额	9,387,823.72
买卖债券差价收入	3,772,084.18

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	207,216.95

基金投资产生的股利收益	-
合计	207,216.95

#### 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	-475,769.97
——股票投资	-6,015,811.01
——债券投资	5,540,041.04
——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	-475,769.97

#### 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	3,659.75
基金转换费收入	11,283.36
合计	14,943.11

#### 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	816,313.13
银行间市场交易费用	6,117.50
合计	822,430.63

#### 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	39,671.58
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	24,477.80
合计	230,968.93

#### 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

截至本财务报表批准日，本基金无需作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

于本报告期，并无与本基金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。

##### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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”）	基金管理人的股东、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

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及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

本基金本期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

## 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	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管理费	1,117,832.67	171,641.02
其中：支付销售机构的客户维护费	13,166.43	39,525.50

注：1) 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

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2) 本基金自 2014 年 7 月 9 日起，基金管理费年费率从 0.75% 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	558,916.30	45,770.92

注：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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### 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

	景顺长城优信增利债券 A 类	景顺长城优信增利债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	283.09	283.09
中国银行	-	3,465.56	3,465.56
长城证券	-	69.76	69.76
合计	-	3,818.41	3,818.41
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		
	景顺长城优信增利债券 A 类	景顺长城优信增利债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	427.74	427.74
中国银行	-	7,932.81	7,932.81
长城证券	-	62.75	62.75
合计	-	8,423.30	8,423.30

注：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 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 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

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	30,312,049.73	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-

**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**

本基金的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**

除基金管理人之外，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
中国银行	1,615,087.59	31,153.77	38,658,222.67	16,530.16

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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**

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金于本期未进行利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
132002	15天集EB	2015年6月11日	2015年7月2日	新发债券流通受限	100.00	100.00	1,400	140,000.00	140,000.00	-

**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	2015年6	因重大事	16.73	-	-	200,000	3,463,281.71	3,346,000.00	-

	份	月 30 日	项停牌							
002303	美盈森	2015 年 6 月 9 日	因重大事 项停牌	37.78	2015 年 7 月 13 日	21.43	170,000	4,581,439.28	6,422,600.00	-

### 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 199,799,700.10 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
1182083	11 杉杉 MTN1	2015 年 7 月 1 日	100.85	500,000	50,425,000.00
1180130	11 通泰债	2015 年 7 月 1 日	104.70	300,000	31,410,000.00
1382227	13 黄旅游 MTN1	2015 年 7 月 1 日	101.22	300,000	30,366,000.00
1282357	12 红豆 MTN2	2015 年 7 月 1 日	101.35	200,000	20,270,000.00
1182183	11 杉杉 MTN2	2015 年 7 月 1 日	100.60	200,000	20,120,000.00
1480574	14 中山交通债	2015 年 7 月 1 日	99.61	200,000	19,922,000.00
1282552	12 兴沪集 MTN1	2015 年 7 月 1 日	103.03	100,000	10,303,000.00
1282225	12 泰交通 MTN1	2015 年 7 月 1 日	101.42	100,000	10,142,000.00
1282185	12 邯交建 MTN1	2015 年 7 月 1 日	100.78	100,000	10,078,000.00
合计				2,000,000	203,036,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本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 219,299,992.00 元，于 2015 年 7 月 2 日前（含当日）先后到期。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由金融工具产生的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，并按照合约



规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	1,615,087.59	-	-	-	-	-	1,615,087.59
结算备付金	7,740,469.46	-	-	-	-	-	7,740,469.46
存出保证金	87,209.06	-	-	-	-	-	87,209.06
交易性金融资产	30,340,615.30	64,161,160.55	288,288,023.43	558,835,418.92	42,647,689.00	32,359,535.28	1,016,632,442.48
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,544,398.12	9,544,398.12
应收利息	-	-	-	-	-	24,495,694.07	24,495,694.07
应收申购款	-	-	-	-	-	2,145,537.99	2,145,537.99
资产总计	39,783,381.41	64,161,160.55	288,288,023.43	558,835,418.92	42,647,689.00	68,545,165.46	1,062,260,838.77
负债							
卖出回购金融资产款	419,099,692.10	-	-	-	-	-	419,099,692.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,089,254.60	1,089,254.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	201,148.44	201,148.44
应付托管费	-	-	-	-	-	100,574.21	100,574.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,754.29	2,754.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	300,422.76	300,422.76
应付利息	-	-	-	-	-	50,787.76	50,787.76
应交税费	-	-	-	-	-	26,449.60	26,449.60
其他负债	-	-	-	-	-	202,312.23	202,312.23
负债总计	419,099,692.10	-	-	-	-	1,973,703.89	421,073,395.99
利率敏感度缺口	-379,316,310.69	64,161,160.55	288,288,023.43	558,835,418.92	42,647,689.00	-	-
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	91,973,162.50	-	-	-	-	-	91,973,162.50
结算备付金	13,077,142.47	-	-	-	-	-	13,077,142.47
存出保证金	124,850.44	-	-	-	-	-	124,850.44
交易性金融资产	10,002,000.00	58,304,561.30	84,331,064.00	584,621,656.10	50,693,160.55	34,537,004.80	822,489,446.75
应收利息	-	-	-	-	-	20,263,541.30	20,263,541.30
应收申购款	997.01	-	-	-	-	143,524.57	144,521.58
资产总计	115,178,152.42	58,304,561.30	84,331,064.00	584,621,656.10	50,693,160.55	54,944,070.67	948,072,665.04
负债							
卖出回购金融资产款	324,288,299.59	-	-	-	-	-	324,288,299.59
应付证券清算款	-	-	-	-	-	88,977,603.50	88,977,603.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	38,492.87	38,492.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	180,787.06	180,787.06

应付托管费	-	-	-	-	-	90,393.54	90,393.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,706.86	1,706.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	114,913.73	114,913.73
应付利息	-	-	-	-	-	125,655.87	125,655.87
应交税费	-	-	-	-	-	26,449.60	26,449.60
其他负债	-	-	-	-	-	169,021.77	169,021.77
负债总计	324,288,299.59	-	-	-	-	89,725,024.80	414,013,324.39
利率敏感度缺口	-209,110,147.17	58,304,561.30	84,331,064.00	584,621,656.10	50,693,160.55	-	-

#### 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	-4,534,768.56	-5,020,244.79
	市场利率下降25个基点	4,578,749.34	5,075,162.00

#### 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。

本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%。信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的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	32,359,535.28	5.05	34,537,004.80	6.47
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	984,272,907.20	153.51	787,952,441.95	147.54
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	1,016,632,442.48	158.55	822,489,446.75	154.01

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。		
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）
	“沪深300指数×80%”上升5%	1,602,968.61	2,404,303.64
“沪深300指数×80%”下降5%	-1,602,968.61	-2,404,303.64	

**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22,590,935.28元，划分为第二层次的余额为人民币994,041,507.20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 141,818,893.68 元，划分为第二层次的余额为人民币 680,670,553.07 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

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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	32,359,535.28	3.05
	其中：股票	32,359,535.28	3.05
2	固定收益投资	984,272,907.20	92.66
	其中：债券	984,272,907.20	92.66
	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	9,355,557.05	0.88

7	其他各项资产	36,272,839.24	3.41
8	合计	1,062,260,838.77	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	23,394,159.53	3.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,923,965.75	0.61
E	建筑业	1,665,000.00	0.26
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	10,120.00	0.00
J	金融业	3,346,000.00	0.52
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	20,290.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,359,535.28	5.05

## 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	300032	金龙机电	190,000	6,520,800.00	1.02
2	002303	美盈森	170,000	6,422,600.00	1.00
3	002572	索菲亚	146,331	5,652,766.53	0.88

4	000958	东方能源	127,195	3,923,965.75	0.61
5	600643	爱建股份	200,000	3,346,000.00	0.52
6	002177	御银股份	140,000	2,018,800.00	0.31
7	002533	金杯电工	140,700	1,827,693.00	0.29
8	300262	巴安水务	90,000	1,665,000.00	0.26
9	300100	双林股份	50,000	951,500.00	0.15
10	002776	柏堡龙	500	20,290.00	0.00
11	002771	真视通	500	10,120.00	0.00

## 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	300032	金龙机电	19,370,407.73	3.63
2	000917	电广传媒	15,711,402.46	2.94
3	002177	御银股份	10,840,913.20	2.03
4	600643	爱建股份	10,543,678.88	1.97
5	300357	我武生物	8,576,831.00	1.61
6	000958	东方能源	8,553,399.00	1.60
7	002572	索菲亚	8,242,549.40	1.54
8	300251	光线传媒	7,332,521.06	1.37
9	002081	金螳螂	7,310,834.17	1.37
10	000090	天健集团	7,129,501.99	1.33
11	002303	美盈森	7,036,907.34	1.32
12	300115	长盈精密	7,031,339.00	1.32
13	600804	鹏博士	7,022,321.01	1.31
14	300020	银江股份	6,923,378.60	1.30
15	300342	天银机电	6,562,593.40	1.23
16	600153	建发股份	5,083,118.00	0.95
17	600198	大唐电信	4,913,013.00	0.92
18	600100	同方股份	4,745,537.54	0.89
19	300224	正海磁材	4,662,149.82	0.87
20	000776	广发证券	4,385,782.00	0.82

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	300032	金龙机电	17,487,067.36	3.27
2	000917	电广传媒	16,884,580.51	3.16
3	600048	保利地产	10,719,756.18	2.01
4	300020	银江股份	9,375,670.38	1.76
5	600804	鹏博士	9,121,991.26	1.71
6	002177	御银股份	8,786,465.45	1.65
7	002081	金螳螂	8,587,264.47	1.61
8	600643	爱建股份	7,797,346.13	1.46
9	000958	东方能源	7,768,667.14	1.45
10	300357	我武生物	7,470,479.00	1.40
11	300342	天银机电	7,112,616.84	1.33
12	300251	光线传媒	6,934,941.29	1.30
13	300115	长盈精密	6,734,840.22	1.26
14	000090	天健集团	6,701,096.80	1.25
15	000002	万科A	6,415,911.81	1.20
16	600015	华夏银行	6,257,679.60	1.17
17	600153	建发股份	5,596,109.00	1.05
18	600100	同方股份	5,465,060.72	1.02
19	300224	正海磁材	5,020,369.57	0.94
20	002251	步步高	4,948,205.10	0.93

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	253,426,883.83
卖出股票收入（成交）总额	273,789,420.76

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	30,101,000.00	4.69
	其中：政策性金融债	30,101,000.00	4.69
4	企业债券	480,323,407.20	74.91
5	企业短期融资券	171,150,000.00	26.69
6	中期票据	302,558,500.00	47.19
7	可转债	140,000.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	984,272,907.20	153.51

## 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	1182083	11 杉杉 MTN1	500,000	50,425,000.00	7.86
2	124022	12 韶金叶	451,500	46,852,155.00	7.31
3	101353012	13 步步高 MTN001	400,000	41,000,000.00	6.39
4	011599016	15 红豆 SCP001	400,000	40,404,000.00	6.30
5	011599415	15 渝力帆 SCP003	400,000	40,100,000.00	6.25

## 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	87,209.06
2	应收证券清算款	9,544,398.12
3	应收股利	-
4	应收利息	24,495,694.07
5	应收申购款	2,145,537.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,272,839.24

### 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	002303	美盈森	6,422,600.00	1.00	因重大事项停牌
2	600643	爱建股份	3,346,000.00	0.52	因重大事项停牌

## § 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
景顺长城优信增利债券 A 类	446	1,138,633.63	497,207,581.86	97.91%	10,623,017.33	2.09%
景顺长城优信增利债券 C 类	230	38,781.36	1,156.00	0.01%	8,918,556.06	99.99%
合计	676	764,423.54	497,208,737.86	96.22%	19,541,573.39	3.78%

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	景顺长城优信增利债券 A 类	88.38	0.00%
	景顺长城优信增利债券 C 类	-	-
	合计	88.38	0.00%

注：分级基金管理人的从业人员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）。

## 8.3 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	景顺长城优信增利债券 A 类	景顺长城优信增利债券 C 类
基金合同生效日（2012 年 3 月 15 日）基金份额总额	1,252,918,045.08	557,617,102.80
本报告期期初基金份额总额	463,467,884.62	3,554,538.98
本报告期基金总申购份额	57,963,030.34	13,313,954.89
减：本报告期基金总赎回份额	13,600,315.77	7,948,781.81
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	507,830,599.19	8,919,712.06
-------------	----------------	--------------

注：总申购份额含转换入份额，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

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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、2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 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	
中国银河证券股份有限公司	2	373,560,150.74	70.91%	340,089.46	70.91%	未变更
申银万国证券股份有限公司	1	153,236,803.85	29.09%	139,506.77	29.09%	未变更
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	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
中国银河证券股份有限公司	43,141,735.05	24.46%	1,066,099,000.00	12.65%	-	-
申银万国证券股份有限公司	72,231,445.54	40.96%	7,359,800,000.00	87.35%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	60,968,357.36	34.57%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增苏州银行	中国证券报，上海证券报，证券时报，基	2015年1月16日

	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	金管理人网站	
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	景顺长城优信增利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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	景顺长城优信增利债券型证券投资基金 2014 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 31 日
9	景顺长城优信增利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
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子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 4 月 1 日
11	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
12	景顺长城优信增利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
13	景顺长城优信增利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 4 月 29 日

14	景顺长城优信增利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 4 月 29 日
15	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
16	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
17	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
18	景顺长城基金管理有限公司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	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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

24	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
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在邮储银行开通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 12 日
26	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
27	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

无。

## § 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优信增利债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城优信增利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城优信增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