

# 景顺长城四季金利债券型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 日

## §1 重要提示

### 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 2016 年 8 月 25 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                   |
|-----------------|--------------------|-------------------|
| 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      | 1,603,049,853.68 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<br>A 类  | 景顺长城四季金利债券<br>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 | 1,596,002,447.21 份 | 7,047,406.47 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</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 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   | 杨皞阳                | 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       |

## 2.4 信息披露方式

|                      |               |
|----------------------|---------------|
| 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    |

# §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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) | 报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 9,610,282.19                          | 36,441.76                             |
| 本期利润          | 9,780,780.10                          | -100,313.94                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0062                                | -0.0129                               |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.45%                                | -0.63%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                 |                                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0584                                | 0.0512                                |
| 期末基金资产净值      | 1,776,218,798.62                      | 7,791,468.39                          |
| 期末基金份额净值      | 1.113                                 | 1.106                                 |

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

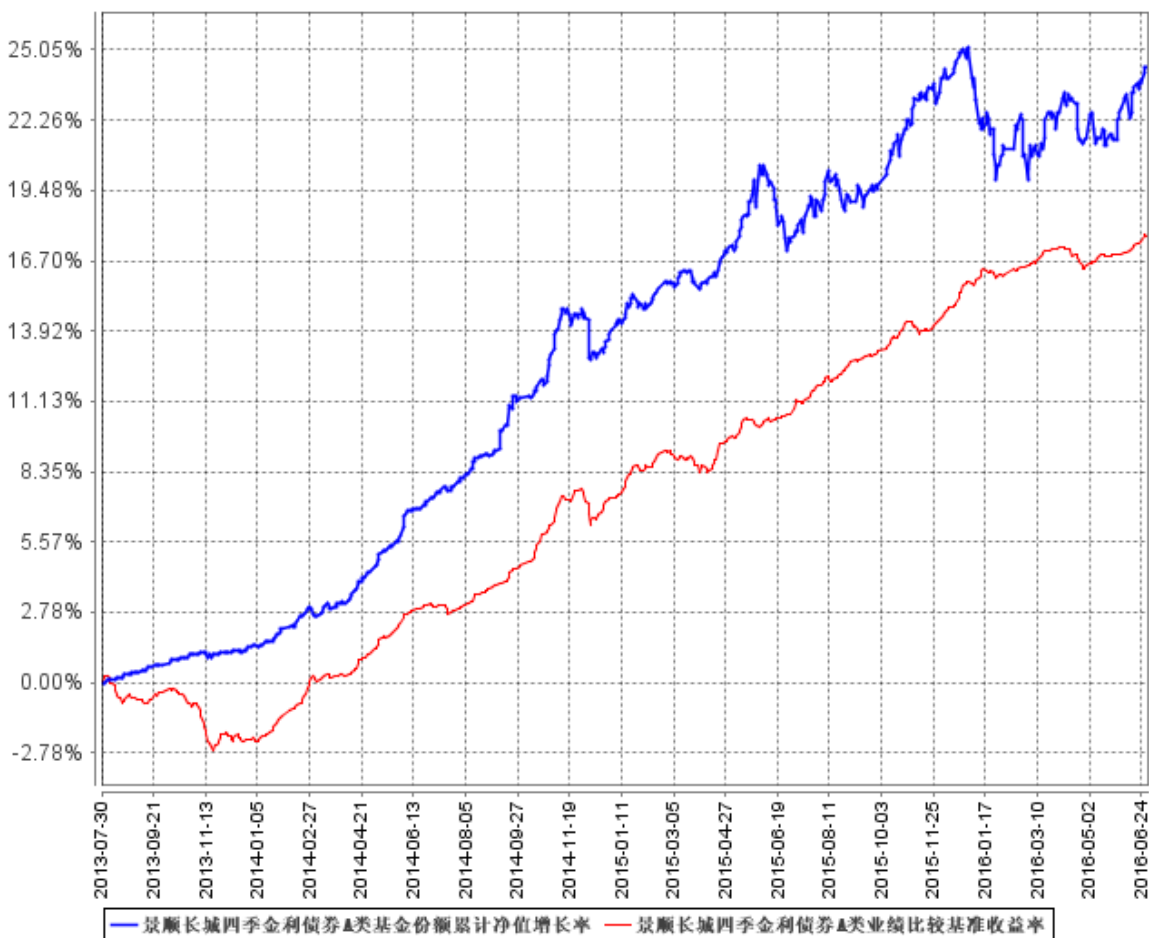
景顺长城四季金利债券 A 类

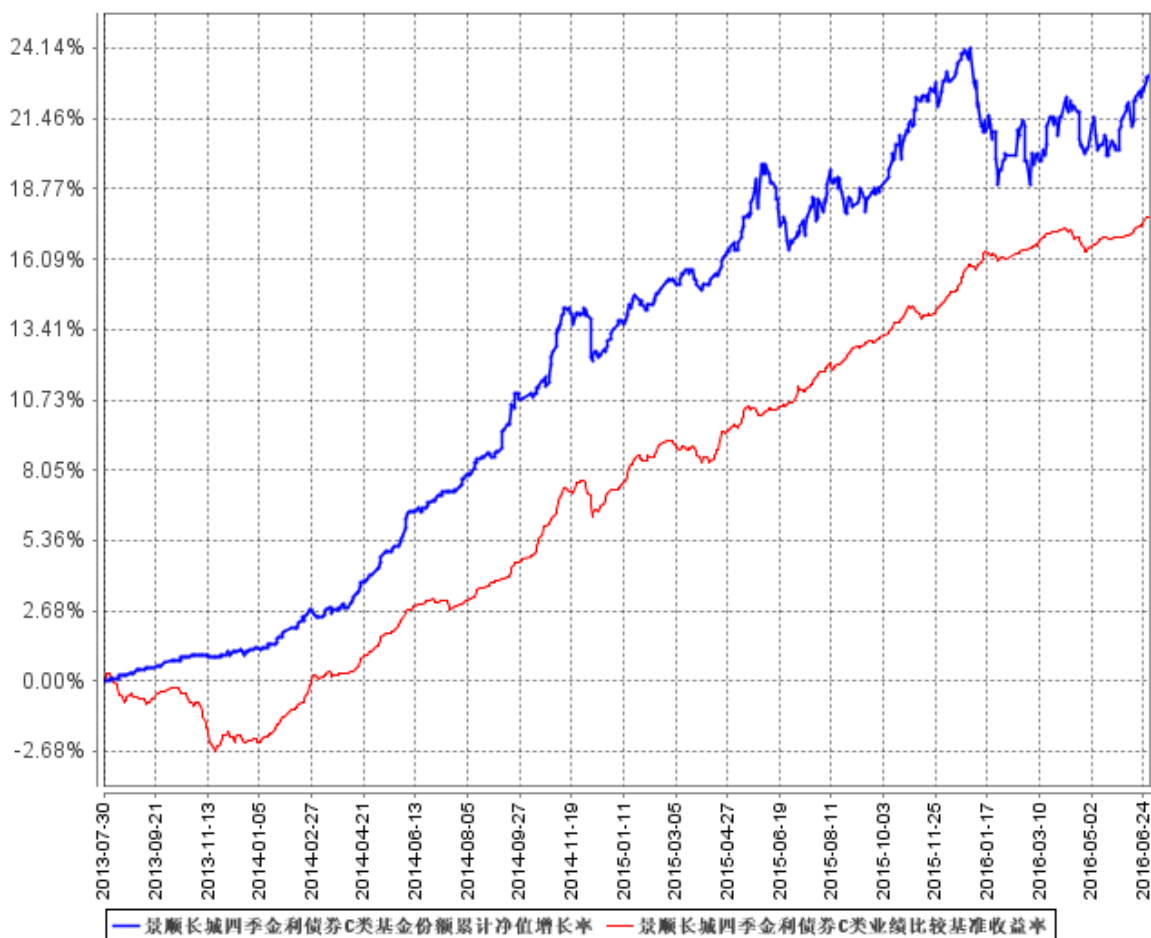
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 1.74%    | 0.26%       | 0.63%      | 0.04%         | 1.11%  | 0.22% |
| 过去三个月      | 1.46%    | 0.28%       | 0.41%      | 0.05%         | 1.05%  | 0.23% |
| 过去六个月      | -0.45%   | 0.34%       | 1.58%      | 0.05%         | -2.03% | 0.29% |
| 过去一年       | 5.90%    | 0.28%       | 6.39%      | 0.06%         | -0.49% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.38%   | 0.21%       | 17.68%     | 0.08%         | 6.70%  | 0.13% |

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      | 1.75%    | 0.26%       | 0.63%      | 0.04%         | 1.12%  | 0.22% |
| 过去三个月      | 1.37%    | 0.28%       | 0.41%      | 0.05%         | 0.96%  | 0.23% |
| 过去六个月      | -0.63%   | 0.34%       | 1.58%      | 0.05%         | -2.21% | 0.29% |
| 过去一年       | 5.53%    | 0.29%       | 6.39%      | 0.06%         | -0.86% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.15%   | 0.21%       | 17.68%     | 0.08%         | 5.47%  | 0.13% |

### 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 日基金管理人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（以下简称“本基金”），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%。调整后，本基金的建仓期为 2015 年 6 月 10 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合符合基金合同的有关约定。

### 3.3 其他指标

无。

## §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2016年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理55只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、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、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、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、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、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、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金。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混合型证券投资基金、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、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金基金经理 | 2014 年 4 月 4 日  | -    | 9      | 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。

### 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

上半年经济数据前高后低，1-2 月信贷数据超市场预期，房地产和基建数据回升，随着信贷数据回落，各项经济数据也开始向下，5 月初“权威人士”定调中国经济长期持续 L 型走势，并且不赞同过度投资和过度信贷刺激经济的做法。民间投资今年以来加速下滑，制约投资总量增长，反映经济内生动力依然不足。这轮经济回稳来自于房地产政策的放松和财政的支持力度加大，以及银行信贷的支持。应该说权威人士定调比较清晰，经济平稳阶段要推供给侧改革，政策不能大水漫灌，经济增速可能面临回落风险，但前期投入的惯性仍在。

货币政策依然中性偏松，权威人士的论调、央行工作报告中都印证了当前货币政策和市场流动性相比一季度边际上有所趋紧，货币政策基调也从稳健偏宽松逐步趋向实质性稳健。而公开市场利率自去年 10 月底以来一直维持在 2.25% 水平、汇率因素、MPA 考核、对半年末资金面的预期紧张都使得资金利率中枢出现了一定程度的上移。

债券市场收益率波动较大，1 季度在配置盘推动下，信用债收益率继续下行，利率债则在基本面回升推动下收益率有所上行。4 月份受基本面继续好转、通胀压力回升和铁物资事件影响，债券收益率出现明显上行。进入 5 月后，在美国加息预期延后、权威人士判断我国经济运行行为 L 型走势、基本面呈现出有利因素等影响下，尤其是英国脱欧公投结果远超市场预期，成为今年以来最大的黑天鹅事件，全球避险情绪急速升温，债券收益率重新回到下行通道。上半年 10 年期国开债、3 年期 AA 中票和 5 年期中票收益率分别上行 6BP、下行 7BP 和下行 6BP 至 3.19%、3.98% 和 4.31%。

上半年权益市场表现不佳，一方面熔断机制一定程度造成市场的恐慌，另一方面，人民币汇率贬值造成权益市场出现较明显的回调。2 季度在加入 MSCI 预期、深港通等因素影响下导致反弹，但不是一帆风顺。上半年上证综指、深证成指和创业板指分别下跌 17.22%、17.17% 和 17.92%。

鉴于经济基本面在 1 季度末有所企稳，宽松货币政策转向稳健，组合在 2 季度初有降杠杆缩久期操作，组合仍主要以信用债配置作为主要的获益来源，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，保持杠杆在合理水平，主要建仓资质较好的 3 年内城投债和短久期短融，获取票息收入。期间阶段性参与利率债的波段机会。上半年权益方面保持灵活仓位，以业绩成长较确定的个股为主要投资标的，根据市场变化及时调整股票的投资比例。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，四季金利 A 类份额净值增长率为-0.45%，业绩比较基准收益率为 1.58%。

2016 年上半年，四季金利 C 类份额净值增长率为-0.63%，业绩比较基准收益率为 1.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年基建在宽财政带动下仍可能维持高位，房地产投资有一定的惯性，民间投资下滑趋缓，短期经济增长仍有惯性，加上去年下半年的低基数，经济呈现 L 型走势的概率较大。权威人士定调“经济运行 L 型走势”，政策应该不会进行大幅度刺激，增长和通胀略有走弱的概率较大，供给侧改革重回政策重心。随着食品价格中鲜菜价格持续回落，猪肉价格涨幅继续放缓，后期食品价格涨幅预计继续下降，推动下半年 CPI 逐步下行，但需关注石油价格上涨、异常天气因素对 CPI 的冲击。大宗商品价格可能推动 PPI 继续回升，CPI 和 PPI 的剪刀差收窄。

预计货币政策将继续围绕维稳国内资金面和应对人民币贬值，货币政策难言收紧，但大幅宽松的可能性不大。金融去杠杆以及引导资金脱虚向实，预计央行仍会维持短端资金面的平稳。关注央行的降准举措和 7 天逆回购利率的变化。财政政策仍有继续放松的空间，当前政府仍有一定的举债空间。预计依然会继续加大财政政策刺激力度，继续托底经济。

宽松的货币政策转向稳健，在供给侧改革和稳增长的博弈中，实体经济信用扩张放缓，央行在强化利率走廊建设的过程中，仍会通过多种工具，将短端利率维持在其合意水平，防范系统性金融风险。2 季度央行加大力度维稳资金面，一是宣布调整人民币存款准备金考核基数，二是将 MLF 询量、PSL 常态化。美元加息预期、经济回稳、物价回升、人民币汇率压力，降息空间很难看到，降准依赖于外占流出情况。央行主要通过公开市场操作提供流动性。

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

综上，经济 L 型增长和通胀走弱，货币政策回归中性的定调，基本面对债市影响偏正面，但监管风险的发酵，信用融资的大幅回落，以及美元加息和汇率问题等待靴子落地。基本面和政策面仍可能阶段性推动收益率下行，年初中国国债和美国国债收益率收窄，制约国内无风险利率的下行。今年以来随着避险情绪的上升，全球利率大幅下行并于近期创出历史新低，而中国债市表现相对落后，且上半年人民币贬值了 2.31%，这为国内收益率下行打开空间。但收益率下行空间预计有限，主因是下半年仍面临人民币贬值压力、房价持续上涨后货币政策放松力度继续放缓。相对看好利率债的阶段性机会，不过需把握好波段。信用融资循环出现问题，下半年低评级的信用风险还会暴露，信用利差分化。看好短久期高评级的信用品种。

2016 年债券市场风险点在于人民币汇率风险和个券信用风险。组合投资上将适当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，保持对组合的信用风险和流动性风险的关注，增加利率债的交易机会。权益方面，未来将会大概率持续震荡的“猴市行情”特征，基本面也不支持市场的大幅上涨。在全球风险偏好明显下降后，国内权益风险偏好不会明显回升，但利空因素不多，A 股指数可能围绕 2700 到 3200 进行波动，存量资金博弈为主，不排除阶段性险资、国家队资金增援的可能。个股方面，精选个股，业绩增长较确定且处于题材的个券上涨动力更强。选股思路为稀缺的优质资产即业绩增长确定的个股。保持适中的权益仓位基础上进行波段操作。积极参与新发转债机会，兼顾权益市场的投资机会。

#### 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。

### 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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合规守信、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报中的财务指标、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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                        |                          |
| 银行存款       | 3,588,290.93           | 2,416,051.42             |
| 结算备付金      | 2,240,044.09           | 1,579,425.38             |
| 存出保证金      | 193,153.90             | 112,995.18               |
| 交易性金融资产    | 2,080,370,835.17       | 888,173,518.56           |
| 其中：股票投资    | 223,614,355.02         | 72,660,407.46            |
| 基金投资       | -                      | -                        |
| 债券投资       | 1,856,756,480.15       | 815,513,111.10           |
| 资产支持证券投资   | -                      | -                        |
| 贵金属投资      | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | -                      | -                        |

|                 |                   |                    |
|-----------------|-------------------|--------------------|
| 买入返售金融资产        | 10,000,135.00     | -                  |
| 应收证券清算款         | -                 | 2,500,000.00       |
| 应收利息            | 37,624,581.36     | 15,163,809.22      |
| 应收股利            | -                 | -                  |
| 应收申购款           | 345,478.10        | 34,587.26          |
| 递延所得税资产         | -                 | -                  |
| 其他资产            | -                 | -                  |
| 资产总计            | 2,134,362,518.55  | 909,980,387.02     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2016年6月30日</b> | <b>2015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          | -                 | -                  |
| 卖出回购金融资产款       | 348,798,916.80    | 95,579,864.88      |
| 应付证券清算款         | -                 | 2,754,018.39       |
| 应付赎回款           | 119,159.13        | 81,799.41          |
| 应付管理人报酬         | 579,951.70        | 226,987.83         |
| 应付托管费           | 289,975.86        | 113,493.92         |
| 应付销售服务费         | 2,688.68          | 3,347.22           |
| 应付交易费用          | 234,940.82        | 108,311.76         |
| 应交税费            | -                 | -                  |
| 应付利息            | 38,700.50         | 21,763.83          |
| 应付利润            | -                 | -                  |
| 递延所得税负债         | -                 | -                  |
| 其他负债            | 287,918.05        | 169,117.62         |
| 负债合计            | 350,352,251.54    | 99,058,704.86      |
| <b>所有者权益:</b>   |                   |                    |
| 实收基金            | 1,603,049,853.68  | 725,190,704.35     |
| 未分配利润           | 180,960,413.33    | 85,730,977.81      |
| 所有者权益合计         | 1,784,010,267.01  | 810,921,682.16     |
| 负债和所有者权益总计      | 2,134,362,518.55  | 909,980,387.02     |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,603,049,853.68 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 1.113 元，份额总额 1,596,002,447.21 份；景顺长城四季金利债券型证券投资基金 C 类份额净值 1.106 元，份额总额 7,047,406.47 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2016年1月1日至<br>2016年6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至<br>2015年6月30日 |
|-----|--------------------------------|-------------------------------------|
|     |                                |                                     |

|                            |                     |                     |
|----------------------------|---------------------|---------------------|
| 一、收入                       | 19,049,007.67       | 13,662,139.66       |
| 1.利息收入                     | 37,613,428.73       | 14,139,831.74       |
| 其中：存款利息收入                  | 92,055.52           | 69,701.98           |
| 债券利息收入                     | 37,308,479.54       | 14,065,952.49       |
| 资产支持证券利息收入                 | -                   | -                   |
| 买入返售金融资产收入                 | 212,893.67          | 4,177.27            |
| 其他利息收入                     | -                   | -                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | -18,598,934.11      | -1,391,008.59       |
| 其中：股票投资收益                  | -17,641,190.67      | -1,593,398.35       |
| 基金投资收益                     | -                   | -                   |
| 债券投资收益                     | -2,305,432.92       | 202,389.76          |
| 资产支持证券投资收益                 | -                   | -                   |
| 贵金属投资收益                    | -                   | -                   |
| 衍生工具收益                     | -                   | -                   |
| 股利收益                       | 1,347,689.48        | -                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 33,742.21           | 899,218.58          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                   | -                   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 770.84              | 14,097.93           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>9,368,541.51</b> | <b>3,911,530.03</b> |
| 1. 管理人报酬                   | 3,424,190.12        | 637,687.31          |
| 2. 托管费                     | 1,712,095.09        | 318,843.58          |
| 3. 销售服务费                   | 16,818.37           | 48,583.57           |
| 4. 交易费用                    | 658,181.60          | 49,337.47           |
| 5. 利息支出                    | 3,338,674.14        | 2,643,976.74        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 3,338,674.14        | 2,643,976.74        |
| 6. 其他费用                    | 218,582.19          | 213,101.36          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>9,680,466.16</b> | <b>9,750,609.63</b> |
| 减：所得税费用                    | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>9,680,466.16</b> | <b>9,750,609.63</b> |

### 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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 | 725,190,704.35                        | 85,730,977.81 | 810,921,682.16 |



|  |                                 |                |                  |
|--|---------------------------------|----------------|------------------|
| (基金净值)                                 |                                 |                |                  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                               | 9,680,466.16   | 9,680,466.16     |
| 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)      | 877,859,149.33                  | 85,548,969.36  | 963,408,118.69   |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,006,147,715.49                | 96,466,691.18  | 1,102,614,406.67 |
| 2.基金赎回款                                | -128,288,566.16                 | -10,917,721.82 | -139,206,287.98  |
| 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)                        | 1,603,049,853.68                | 180,960,413.33 | 1,784,010,267.01 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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“-”号填列)      | 202,862,629.27                  | 9,430,814.46   | 212,293,443.73   |
| 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   |

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>许义明</u> | <u>吴建军</u> | <u>邵媛媛</u> |
| 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

景顺长城四季金利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系由景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金转型而来。景顺长城四季金利纯债债券型证券投资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。

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于2015年5月7日至2015年6月7日以通讯方式召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《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》,内容包括调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金的投资范围、投资策略、估值方法、收益分配原则,以及根据现时有效的法律法规修订基金合同等,并同意将关于调整景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金更名为本基金,大会决议自2015年6月8日起生效。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》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。

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《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城四季金利债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券（含分离型可转换债券）、银行存款等。本基金同时投资于股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律、法规或中国证监会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%；现金或者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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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和会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 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

无。

### 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、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品、买断式买入返售金融商品及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期股票<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期股票<br>成交总额的比例 |
| 长城证券  | 398,656,202.70                        | 83.64%           | 24,500,860.80                              | 82.37%           |

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |                  | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                  |
|-------|---------------------------------------|------------------|--|------------------|
|       | 成交金额                                  | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 长城证券  | 10,121,406.67                         | 5.66%            | 40,975,622.68                              | 10.69%           |

**6.4.8.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月<br>30日 |                    | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                    |
|-------|--------------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
|       | 回购成交金额                         | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券回购<br>成交总额的比例 |
| 长城证券  | 188,900,000.00                 | 10.77%             | 18,100,000.00                   | 0.74%              |

**6.4.8.1.4 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。

**6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日      |                |            |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金总<br>量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 371,269.12                      | 83.64%         | 181,960.41 | 83.10%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                |            |                  |
|       | 当期佣金                            | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 22,305.79                       | 82.37%         | 22,305.79  | 82.37%           |

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。

**6.4.8.2 关联方报酬****6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                 | 3,424,190.12                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 18,183.39                      | 35,284.13                           |

注：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%。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

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,712,095.09                    | 318,843.58                      |

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

#### 6.4.8.2.3 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                              |                |           |
|----------------|---------------------------------|----------------|-----------|
|                | 2016 年 1 月 1 日至 2016 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   | -                               | 460.19         | 460.19    |
| 中国农业银行         | -                               | 7,504.32       | 7,504.32  |
| 长城证券           | -                               | -              | -         |
| 合计             | -                               | 7,964.51       | 7,964.51  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                         |                |           |
|                | 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 |
|----|---|-----------|-----------|

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 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.8.3 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。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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。

##### 6.4.8.4.2 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。

#### 6.4.8.5 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                              |           | 上年度可比期间                         |           |
|--------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|        | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |           | 2015 年 1 月 1 日至 2015 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 | 3,588,290.93                    | 46,952.96 | 3,018,024.59                    | 29,123.95 |

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。

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 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 348,798,916.80 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         |
|-----------|----------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 150208    | 15 国开 08       | 2016 年 7 月 1 日 | 103.74 | 200,000   | 20,748,000.00  |
| 150213    | 15 国开 13       | 2016 年 7 月 1 日 | 102.89 | 100,000   | 10,289,000.00  |
| 150220    | 15 国开 20       | 2016 年 7 月 1 日 | 101.48 | 200,000   | 20,296,000.00  |
| 150222    | 15 国开 22       | 2016 年 7 月 1 日 | 99.99  | 100,000   | 9,999,000.00   |
| 150419    | 15 农发 19       | 2016 年 7 月 1 日 | 100.02 | 300,000   | 30,006,000.00  |
| 160204    | 16 国开 04       | 2016 年 7 月 1 日 | 99.88  | 500,000   | 49,940,000.00  |
| 160210    | 16 国开 10       | 2016 年 7 月 1 日 | 99.95  | 300,000   | 29,985,000.00  |
| 140219    | 14 国开 19       | 2016 年 7 月 1 日 | 105.71 | 100,000   | 10,571,000.00  |
| 140224    | 14 国开 24       | 2016 年 7 月 1 日 | 105.37 | 200,000   | 21,074,000.00  |
| 011599742 | 15 闽交运 SCP005  | 2016 年 7 月 1 日 | 100.54 | 100,000   | 10,054,000.00  |
| 150016    | 15 付息国债 16     | 2016 年 7 月 4 日 | 105.21 | 200,000   | 21,042,000.00  |
| 041564081 | 15 申江两岸 CP002  | 2016 年 7 月 5 日 | 100.51 | 200,000   | 20,102,000.00  |
| 101660012 | 16 建发房产 MTN001 | 2016 年 7 月 7 日 | 99.74  | 300,000   | 29,922,000.00  |
| 101660025 | 16 滁州城投 MTN001 | 2016 年 7 月 7 日 | 98.98  | 200,000   | 19,796,000.00  |
| 011598140 | 15 洋河 SCP001   | 2016 年 7 月 7 日 | 100.26 | 500,000   | 50,130,000.00  |
| 合计        |                |                |        | 3,500,000 | 353,954,000.00 |

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.10.1 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。

### 6.4.10.2 其他事项

#### (1) 公允价值

本基金管理人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 2016 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 247,752,824.72 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,832,618,010.45 元，无划分为第三层次的余额（于 2015 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 72,349,430.46 元，划分为第二层次的余额为人民币 815,824,088.10 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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 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。

### 6.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 25 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              | 223,614,355.02   | 10.48         |
|    | 其中：股票             | 223,614,355.02   | 10.48         |
| 2  | 固定收益投资            | 1,856,756,480.15 | 86.99         |
|    | 其中：债券             | 1,856,756,480.15 | 86.99         |
|    | 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          | 10,000,135.00    | 0.47          |
|    | 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      | 5,828,335.02     | 0.27          |
| 7  | 其他各项资产            | 38,163,213.36    | 1.79          |
| 8  | 合计                | 2,134,362,518.55 | 100.00        |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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              | 195,353,684.06 | 10.95         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,770,000.00   | 0.16          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 5,815,670.96   | 0.33          |
| 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  | 14,830,000.00  | 0.83          |
| J  | 金融业              | -              | -             |
| K  | 房地产业             | 4,845,000.00   | 0.27          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -             |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -              | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -              | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 223,614,355.02 | 12.53 |

## 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 002239 | 奥特佳   | 1,589,893 | 25,613,176.23 | 1.44         |
| 2  | 002533 | 金杯电工  | 1,749,981 | 23,502,244.83 | 1.32         |
| 3  | 002296 | 辉煌科技  | 991,000   | 17,986,650.00 | 1.01         |
| 4  | 000050 | 深天马 A | 740,000   | 15,443,800.00 | 0.87         |
| 5  | 002303 | 美盈森   | 1,254,941 | 15,423,224.89 | 0.86         |
| 6  | 300359 | 全通教育  | 500,000   | 14,830,000.00 | 0.83         |
| 7  | 000418 | 小天鹅 A | 424,755   | 13,855,508.10 | 0.78         |
| 8  | 002394 | 联发股份  | 799,950   | 12,079,245.00 | 0.68         |
| 9  | 000967 | 盈峰环境  | 470,000   | 10,429,300.00 | 0.58         |
| 10 | 002508 | 老板电器  | 282,000   | 10,369,140.00 | 0.58         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

## 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  | 002303 | 美盈森  | 21,394,128.02 | 2.64           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 2  | 002239 | 奥特佳   | 21,329,953.74 | 2.63 |
| 3  | 002394 | 联发股份  | 19,753,109.57 | 2.44 |
| 4  | 002533 | 金杯电工  | 18,426,324.88 | 2.27 |
| 5  | 300359 | 全通教育  | 18,402,449.01 | 2.27 |
| 6  | 000050 | 深天马 A | 16,432,491.11 | 2.03 |
| 7  | 002674 | 兴业科技  | 15,247,151.88 | 1.88 |
| 8  | 002045 | 国光电器  | 14,561,952.03 | 1.80 |
| 9  | 002400 | 省广股份  | 13,511,778.44 | 1.67 |
| 10 | 000967 | 盈峰环境  | 11,474,087.00 | 1.41 |
| 11 | 001979 | 招商蛇口  | 10,942,261.38 | 1.35 |
| 12 | 000418 | 小天鹅 A | 10,407,897.03 | 1.28 |
| 13 | 002296 | 辉煌科技  | 10,034,655.00 | 1.24 |
| 14 | 002426 | 胜利精密  | 9,966,995.44  | 1.23 |
| 15 | 002311 | 海大集团  | 9,471,572.92  | 1.17 |
| 16 | 002508 | 老板电器  | 9,080,240.00  | 1.12 |
| 17 | 600240 | 华业资本  | 8,637,846.94  | 1.07 |
| 18 | 000958 | 东方能源  | 8,403,357.50  | 1.04 |
| 19 | 600313 | 农发种业  | 8,042,656.02  | 0.99 |
| 20 | 002501 | 利源精制  | 7,525,755.00  | 0.93 |

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  | 002400 | 省广股份 | 13,364,348.06 | 1.65           |
| 2  | 002045 | 国光电器 | 13,112,320.12 | 1.62           |
| 3  | 600240 | 华业资本 | 11,979,461.40 | 1.48           |
| 4  | 002674 | 兴业科技 | 11,958,624.39 | 1.47           |
| 5  | 002311 | 海大集团 | 10,986,103.60 | 1.35           |
| 6  | 300071 | 华谊嘉信 | 9,089,097.77  | 1.12           |
| 7  | 002303 | 美盈森  | 8,891,744.64  | 1.10           |
| 8  | 002394 | 联发股份 | 6,987,127.10  | 0.86           |
| 9  | 600203 | 福日电子 | 6,908,551.20  | 0.85           |
| 10 | 002250 | 联化科技 | 6,714,032.00  | 0.83           |
| 11 | 000967 | 盈峰环境 | 6,290,859.54  | 0.78           |
| 12 | 600313 | 农发种业 | 5,998,251.80  | 0.74           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 13 | 002437 | 誉衡药业  | 5,080,070.21 | 0.63 |
| 14 | 300145 | 中金环境  | 5,054,239.00 | 0.62 |
| 15 | 001979 | 招商蛇口  | 4,847,741.00 | 0.60 |
| 16 | 000958 | 东方能源  | 4,456,640.62 | 0.55 |
| 17 | 300187 | 永清环保  | 4,320,910.47 | 0.53 |
| 18 | 300009 | 安科生物  | 4,078,613.63 | 0.50 |
| 19 | 600292 | 远达环保  | 4,023,736.00 | 0.50 |
| 20 | 000050 | 深天马 A | 3,306,933.10 | 0.41 |

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 | 316,217,954.59 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 160,419,223.33 |

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      | 21,042,000.00    | 1.18         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 213,551,000.00   | 11.97        |
|    | 其中：政策性金融债 | 213,551,000.00   | 11.97        |
| 4  | 企业债券      | 676,030,010.45   | 37.89        |
| 5  | 企业短期融资券   | 401,214,000.00   | 22.49        |
| 6  | 中期票据      | 520,781,000.00   | 29.19        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 24,138,469.70    | 1.35         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,856,756,480.15 | 104.08       |

### 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  | 011599817 | 15 东莞控 SCP001 | 700,000 | 70,371,000.00 | 3.94         |

|   |           |                   |         |               |      |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 101662008 | 16 威高<br>MTN001   | 600,000 | 60,246,000.00 | 3.38 |
| 3 | 101560051 | 15 九州通<br>MTN001  | 500,000 | 51,450,000.00 | 2.88 |
| 4 | 101575020 | 15 宜春城投<br>MTN001 | 500,000 | 50,940,000.00 | 2.86 |
| 5 | 011598140 | 15 洋河<br>SCP001   | 500,000 | 50,130,000.00 | 2.81 |

### 7.7 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。

### 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   | 193,153.90    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 37,624,581.36 |
| 5  | 应收申购款   | 345,478.10    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 38,163,213.36 |

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §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 | 661      | 2,414,527.15 | 1,588,007,220.55 | 99.50% | 7,995,226.66  | 0.50%   |
| 景顺长城四季金利债券 C 类 | 325      | 21,684.33    | 0.00             | 0.00%  | 7,047,406.47  | 100.00% |
| 合计             | 986      | 1,625,811.21 | 1,588,007,220.55 | 99.06% | 15,042,633.13 | 0.94%   |

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 | -         | 0.00%    |
|                  | 景顺长城四季金利债券 C 类 | 91.49     | 0.00%    |
|                  | 合计             | 91.49     | 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                   | 716,177,072.70   | 9,013,631.65   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,005,147,256.72 | 1,000,458.77   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 125,321,882.21   | 2,966,683.95   |
| 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                    | 1,596,002,447.21 | 7,047,406.47   |

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 2016 年 1 月 22 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，同意黄卫明先生辞去本公司督察长一职。

2、本基金管理人于 2016 年 2 月 4 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，聘任杨皞阳先生担任本公司督察长。

3、本基金管理人于 2016 年 2 月 20 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，聘任毛从容女士担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2016 年 7 月 4 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，同意赵如冰先生辞去本公司董事长一职，聘任杨光裕先生担任本公司董事长。根据公司章程相关规定，“公司的董事长为公司的法定代表人”。经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人已于 2016 年 7 月 13 日变更为杨光裕先生，本基金管理人已于 2016 年 7 月 15 日发布了公告。

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。

5、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

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 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
|      |        |      |             |           |            |    |

|                  |   |                | 例      |            |        |     |
|------------------|---|----------------|--------|------------|--------|-----|
| 长城证券股份<br>有限公司   | 1 | 398,656,202.70 | 83.64% | 371,269.12 | 83.64% | 未变更 |
| 海通证券股份<br>有限公司   | 1 | 72,963,925.22  | 15.31% | 67,951.38  | 15.31% | 未变更 |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 1 | 5,017,050.00   | 1.05%  | 4,672.45   | 1.05%  | 未变更 |
| 国信证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 兴业证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中信证券股份<br>有限公司   | 2 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 申万宏源证券<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 光大证券股份<br>有限公司   | 2 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 华福证券有限<br>责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 广发证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 川财证券有限<br>责任公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 招商证券股份<br>有限公司   | 2 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 平安证券有限<br>责任公司   | 2 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 恒泰证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中国国际金融<br>股份有限公司 | 2 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中信建投证券<br>股份有限公司 | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中国中投证券<br>有限责任公司 | 1 | -              | -      | -          | -      | 未变更 |
| 中泰证券股份<br>有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | 新增  |

|                  |   |   |   |   |   |     |
|------------------|---|---|---|---|---|-----|
| 国金证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | 新增  |
| 国盛证券有限<br>责任公司   | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 上海华信证券<br>有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 方正证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 民生证券股份<br>有限公司   | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 东方证券股份<br>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<br>有限公司   | 10,121,406.67  | 5.66%        | 188,900,000.00   | 10.77%         | -    | -            |
| 海通证券股份<br>有限公司   | 137,708,684.75 | 76.96%       | 1,559,200,000.00 | 88.89%         | -    | -            |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 31,107,476.41  | 17.38%       | 6,000,000.00     | 0.34%          | -    | -            |
| 国信证券股份<br>有限公司   | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰证券股份<br>有限公司   | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东兴证券股份           | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

|                  |  |  |  |  |  |  |
|------------------|--|--|--|--|--|--|
| 有限公司             |  |  |  |  |  |  |
| 兴业证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中信证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 申万宏源证券<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 光大证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 华福证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 广发证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 川财证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 招商证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 平安证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 恒泰证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中国国际金融<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中信建投证券<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中国中投证券<br>有限责任公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中泰证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 国金证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 国盛证券有限<br>责任公司   |  |  |  |  |  |  |
| 上海华信证券<br>有限责任公司 |  |  |  |  |  |  |
| 方正证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 民生证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |
| 东方证券股份<br>有限公司   |  |  |  |  |  |  |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

景顺长城基金管理有限公司  
2016 年 8 月 27 日