

景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资
基金
2017 年半年度报告摘要

2017 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 景顺长城鑫月薪定期支付债券 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000465 |
| 交易代码 | 000465 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 3 月 20 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 305,041,654.32 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，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>本产品的主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。</p> <p>1、资产配置策略：本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、期限配置策略：为合理控制本基金自由开放期的流动性风险，并满足每次自由开放期的流动性需求，本基金在每个运作周期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金剩余运作周期进行适当的匹配。</p> <p>3、期限结构策略：收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。</p> <p>4、债券类属资产配置：基金管理人根据国债、金融</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>债、企业（公司）债、可分离交易可转债的纯债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>5、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> |
| 业绩比较基准 | 同期六个月定期存款利率（税后）+ 1.7%。 |
| 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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨晔阳 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95588 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-66105798 |

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

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 4,924,242.41 |
| 本期利润 | 4,996,336.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0162 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.66% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1673 |
| 期末基金资产净值 | 317,151,940.54 |
| 期末基金份额净值 | 1.040 |

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。

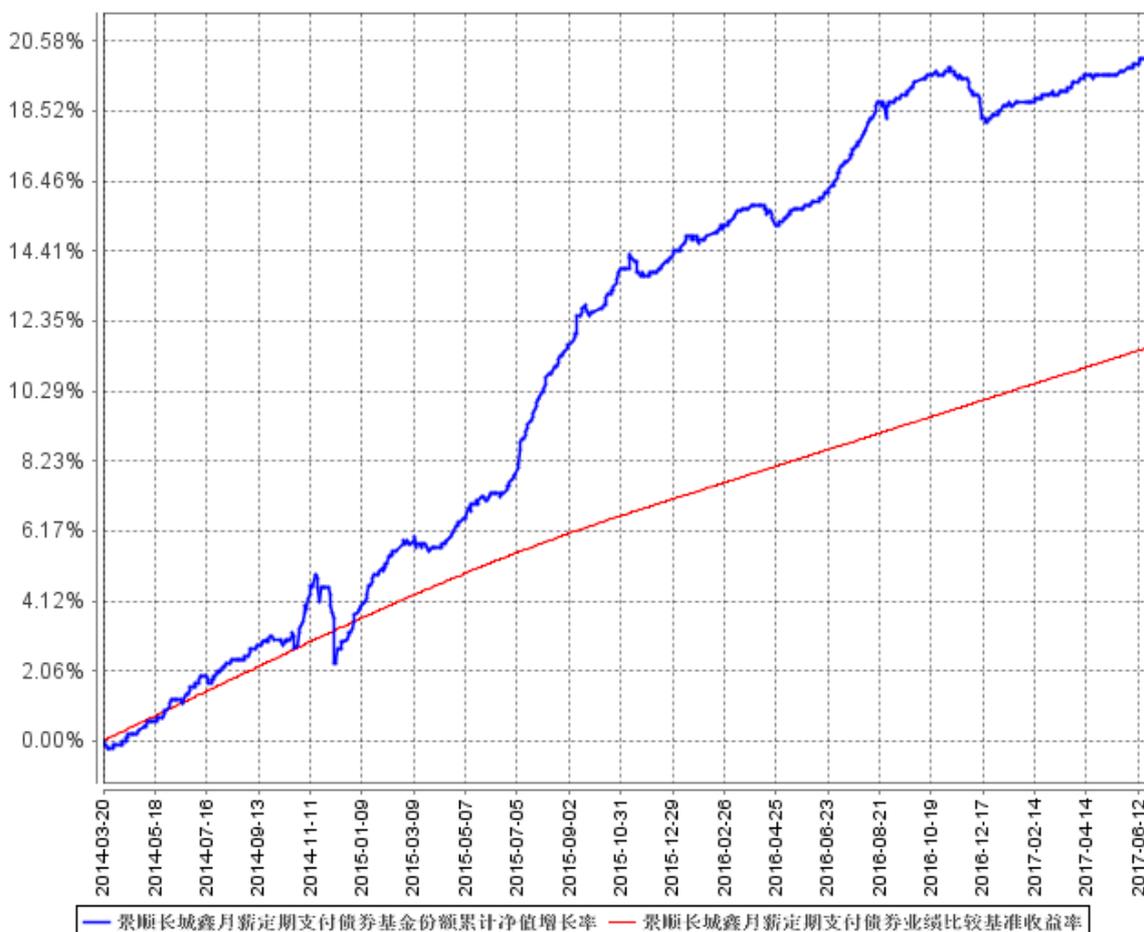
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

| 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 | 0.48% | 0.04% | 0.22% | 0.01% | 0.26% | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.87% | 0.04% | 0.67% | 0.01% | 0.20% | 0.03% |
| 过去六个月 | 1.66% | 0.04% | 1.35% | 0.01% | 0.31% | 0.03% |
| 过去一年 | 3.48% | 0.06% | 2.76% | 0.01% | 0.72% | 0.05% |
| 过去三年 | 18.49% | 0.09% | 10.22% | 0.01% | 8.27% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.38% | 0.09% | 11.62% | 0.01% | 8.76% | 0.08% |

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：本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2014 年 3 月 20 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

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。

截至2017年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理67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、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城景盈汇利债券型证券投资基金。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 | 本基金的基金经理 | 2014 年 6 月 10 日 | - | 10 年 | 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、《景顺长城鑫月薪定期支付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 5 次，为公司旗下三只指数基金因指数成份股调整而发生的反向交易以及量化基金、指数增强基金根据基金合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间临近交易日虽然存在同向交易和反向交易行为，但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年债券市场整体呈现先抑后扬走势，收益率区间震荡。经济基本面数据显示经济活力仍然强劲，GDP 同比增速达到 6.9%。受美联储加息及央行两次上调公开市场利率、MPA 考核要求升级传闻的主要影响，国内利率债继续上行，广义基金规模下滑导致信用债抛盘压力上升，信用利差有所回升。PPI 数据出现连续回落，宏观经济开始出现从高点缓慢回落迹象。但市场对基本面反应较为钝化，监管政策成为主要影响因素，银监会连续发文直指表外理财和同业监管，间或有银监会对各大银行的现场检查。直到 6 月债市才出现明显回暖。主因监管政策密集出台后进入协

调监管阶段，银监会放宽自查报告提交时限有助于缓和情绪，M2 数据创历史新低。美联储如期加息，央行不跟随美联储步伐，维稳市场流动性的态度也较为明显。上半年 10 年期国债、10 年期国开债、5 年期 AAA 中票、5 年期 AA 中票、1 年 AAA 短融分别上行 56P、52BP、62BP、80BP 和 48BP，信用利差小幅回升，仍存在走扩压力。

上半年制约债市调整的因素无根本改变。银行同业理财去杠杆仍在进行，货币政策基调仍维持中性。叠加美联储加息预期，组合在强监管背景下债市无趋势性下行机会的基本判断下，坚持短久期操作，在 5 月协调监管基调下开始逐步拉长久期。组合操作上以同业存单及 1-2 年 AA、AA+信用债为主，享受持有期收益。杠杆部分择机布局资金走紧收益率走高时的协存、长长期回购、存单等安全收益资产增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为 1.66%，业绩比较基准收益率为 1.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新一轮财政整顿以及加强金融监管成为常态，我们预计下半年经济可能面临回落压力，但韧性较强。下半年 PPI 涨幅料将会回落，对工业企业利润的增长形成一定的压制，考虑到工业行业产能出清，全球需求回暖，PPI 涨幅回落会比较缓慢。因此我们预计下半年工业企业利润增速会有所回落，但回落的幅度也相对有限。海外货币政策收紧趋势较明显，美国缩表欧洲宽松退出，这将一定程度上制约国内货币政策放松的空间。

本次债券调整因素来源于 2016 年下半年经济短周期回升，央行货币政策转向，金融监管加码。相比 2013 年钱荒，金融去杠杆政策将导致债券调整时间或更长。债市核心依然在货币政策和监管，短期协调监管和流动性方面出现边际变化，市场迎来喘息机会。先行数据显示基本面在 2 季度开始回落，叠加严格的金融监管政策，表外融资收缩将增加经济下行压力，但韧性较强，对债券市场基本面有所支撑。央行关键时点呵护流动性，坚持削峰填谷操作。当前债券绝对收益率水平尚可，利率债价值好于信用债，此轮收益率调整后，中国国债和美国国债利差已明显走扩，利率债配置价值显现，收益率曲线平坦化，债券市场有望出现交易机会。中短端的中高等级信用债具有较好的持有价值，信用债由于信用利差反应并不充分，低等级信用债仍面临信用利差走扩风险，维持择优选择中高等级配置的观点。

组合方面，将合理控制债券的久期和杠杆，适度提升信用等级水平，相比上半年，组合对下半年债券市场并不悲观，除继续持有中高等级信用债获取持有期票息收入外，组合将增加对利率债的波段操作。努力为投资人创造长期投资回报。

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验

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

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 52,039,342.52 | 47,481,253.10 |
| 结算备付金 | 536,762.04 | 726,155.32 |
| 存出保证金 | 8,900.09 | 11,195.68 |
| 交易性金融资产 | 296,659,431.62 | 122,436,519.34 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 296,659,431.62 | 122,436,519.34 |
| 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 | 70,292,625.44 | 266,500,644.75 |
| 应收证券清算款 | - | 130,037,586.49 |
| 应收利息 | 6,182,975.64 | 2,316,905.88 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | 17,395.63 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 425,720,037.35 | 569,527,656.19 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 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 | 108,039,483.42 | - |
| 应付证券清算款 | - | 39,969,216.26 |
| 应付赎回款 | - | 159,417,377.55 |
| 应付管理人报酬 | 155,953.07 | 265,481.86 |
| 应付托管费 | 51,984.35 | 88,493.95 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 17,385.67 | 8,906.63 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 15,917.97 | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 287,372.33 | 199,000.00 |
| 负债合计 | 108,568,096.81 | 199,948,476.25 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 263,383,577.17 | 311,809,688.23 |
| 未分配利润 | 53,768,363.37 | 57,769,491.71 |
| 所有者权益合计 | 317,151,940.54 | 369,579,179.94 |
| 负债和所有者权益总计 | 425,720,037.35 | 569,527,656.19 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.040 元，基金份额总额 305,041,654.32 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| 一、收入 | 7,613,471.82 | 25,859,061.65 |
| 1.利息收入 | 8,084,477.07 | 29,335,744.97 |
| 其中：存款利息收入 | 1,488,536.78 | 92,055.78 |
| 债券利息收入 | 5,130,162.80 | 28,872,252.30 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 1,465,777.49 | 371,436.89 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -568,130.82 | -449,949.91 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -568,130.82 | -449,949.91 |
| 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 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 72,094.20 | -3,050,567.64 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |

| | | |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 25,031.37 | 23,834.23 |
| 减：二、费用 | 2,617,135.21 | 9,083,375.45 |
| 1. 管理人报酬 | 949,066.08 | 3,107,748.04 |
| 2. 托管费 | 316,355.39 | 1,035,916.00 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 3,882.75 | 11,843.65 |
| 5. 利息支出 | 1,144,157.35 | 4,712,970.29 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,144,157.35 | 4,712,970.29 |
| 6. 其他费用 | 203,673.64 | 214,897.47 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 4,996,336.61 | 16,775,686.20 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 4,996,336.61 | 16,775,686.20 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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） | 311,809,688.23 | 57,769,491.71 | 369,579,179.94 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 4,996,336.61 | 4,996,336.61 |
| 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） | -48,426,111.06 | -8,997,464.95 | -57,423,576.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 87,696,774.10 | 16,431,416.70 | 104,128,190.80 |
| 2. 基金赎回款 | -136,122,885.16 | -25,428,881.65 | -161,551,766.81 |
| 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 | 263,383,577.17 | 53,768,363.37 | 317,151,940.54 |

| 项目 | 上年度可比期间 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 |
| | (基金净值) | | |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 967,142,040.56 | 139,271,675.54 | 1,106,413,716.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 16,775,686.20 | 16,775,686.20 |
| 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) | -509,311,941.93 | -80,851,280.84 | -590,163,222.77 |
| 其中：1.基金申购款 | 107,500,632.13 | 17,227,705.94 | 124,728,338.07 |
| 2.基金赎回款 | -616,812,574.06 | -98,078,986.78 | -714,891,560.84 |
| 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) | 457,830,098.63 | 75,196,080.90 | 533,026,179.53 |

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

景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]1473号《关于核准景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币227,404,003.42元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2014)第

150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 227,428,917.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,914.05 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、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、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等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固定收益类证券品种（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：同期六个月定期存款利率（税后）+1.7%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金开放期分为受限开放期和自由开放期，其它时间为封闭期；封闭期内基金份额持有人不得申请申购、赎回本基金。每个运作周期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一自由开放期结束之日次日起（包括该日）六个月的期间。此外基金管理人于每一运作周期内每个日历月末最后一个工作日进行份额支付。基金管理人将按确定的份额支付基数计算出投资人每日日历月末应当支付的资产金额，并反算出所对应的基金份额，进行份额支付。份额支付后，登记机构将相应调减投资人所持有的基金份额。在每个运作周期结束后进入自由开放期。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2017 年 8 月 24 日批准报出。

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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下

简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日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。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 于 2016 年 5 月 1 日前, 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。对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营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 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：下述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

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股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

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 2017年1月1日至2017年 6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 949,066.08 | 3,107,748.04 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 393,510.26 | 1,403,731.24 |

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 316,355.39 | 1,035,916.00 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

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

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方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

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。

6.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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 |
| | 中国工商银行 | 2,039,342.52 | 15,919.23 | 1,047,432.75 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间在承销期内均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（2017 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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

截至本期末 2017 年 6 月 30 日止，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 91,039,483.42 元，是以如下债券作为抵押：

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 |
|-----------|-----------------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| 011759013 | 17 万丰 奥特 SCP002 | 2017 年 7 月 3 日 | 100.28 | 100,000 | 10,028,000.00 |
| 011762006 | 17 天士 力 SCP001 | 2017 年 7 月 3 日 | 100.27 | 100,000 | 10,027,000.00 |
| 041659045 | 16 海淀 国资 CP001 | 2017 年 7 月 3 日 | 100.13 | 22,000 | 2,202,860.00 |
| 011698597 | 16 泸州 | 2017 年 | 100.33 | 300,000 | 30,099,000.00 |

| | | | | | |
|-----------|----------------------|-------------------|--------|---------|---------------|
| | 睿 SCP002 | 7 月 7 日 | | | |
| 011698656 | 16 佛公 用 SCP009 | 2017 年 7 月 7 日 | 100.29 | 100,000 | 10,029,000.00 |
| 041659045 | 16 海淀 国资 CP001 | 2017 年 7 月 7 日 | 100.13 | 48,000 | 4,806,240.00 |
| 041662038 | 16 金茂 CP001 | 2017 年 7 月 7 日 | 100.51 | 300,000 | 30,153,000.00 |
| 合计 | | | | 970,000 | 97,345,100.00 |

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末 2017 年 6 月 30 日止，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 17,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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属于第二层次的余额为 296,659,431.62 元，无属于第一层次和三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：无第一层次，第二层次 122,436,519.34 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观

察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 296,659,431.62 | 69.68 |
| | 其中：债券 | 296,659,431.62 | 69.68 |
| | 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 | 70,292,625.44 | 16.51 |
| | 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 | 52,576,104.56 | 12.35 |
| 7 | 其他各项资产 | 6,191,875.73 | 1.45 |
| 8 | 合计 | 425,720,037.35 | 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票投资。

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 56,616,431.62 | 17.85 |
| 5 | 企业短期融资券 | 220,626,000.00 | 69.56 |
| 6 | 中期票据 | 9,862,000.00 | 3.11 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 9,555,000.00 | 3.01 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 296,659,431.62 | 93.54 |

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 | 041662038 | 16 金茂 CP001 | 300,000 | 30,153,000.00 | 9.51 |
| 2 | 011698597 | 16 泸州窖 SCP002 | 300,000 | 30,099,000.00 | 9.49 |
| 3 | 011766003 | 17 北京国资 SCP001 | 300,000 | 30,096,000.00 | 9.49 |
| 4 | 011698931 | 16 华邦健康 SCP001 | 300,000 | 30,081,000.00 | 9.48 |
| 5 | 011751047 | 17 珠海华发 SCP003 | 200,000 | 20,052,000.00 | 6.32 |

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 | 8,900.09 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,182,975.64 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,191,875.73 |

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

§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

| 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 |
| 2,062 | 147,934.85 | 96,332,316.98 | 31.58% | 208,709,337.34 | 68.42% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014年3月20日）基金份额总额 | 227,428,917.47 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 361,104,071.05 |
| 本报告期基金总申购份额 | 101,591,424.74 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 157,653,841.47 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 305,041,654.32 |

注：本期申购份额包括自由开放期、受限开放期申购份额，本期赎回份额包括自由开放期、受限开放期赎回份额及定期支付份额。

§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

在本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投证 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|-------------|
| 券股份有限 公司 | | | | | | |
| 招商证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 民生证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期新增 1 个 |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正证 券有限责任 公司 | 2 | - | - | - | - | 本期新增 |

| | | | | | | |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | 10,924,421.74 | 82.59% | 1,412,400,000.00 | 73.41% | - | - |
| 招商证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|--------------|--------|----------------|--------|---|---|
| 公司 | | | | | | |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 2,302,288.08 | 17.41% | 511,718,000.00 | 26.59% | - | - |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|------------------------|------|---------------|--------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170101—20170630 | - | 97,560,000.00 | 1,227,683.02 | 96,332,316.98 | 31.58% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 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

2017 年 8 月 26 日