

景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资  
基金  
2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城景瑞收益定期开放债券
场内简称	无
基金主代码	001750
交易代码	001750
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,643,253.94 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>本基金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</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、期限配置策略</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债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</p> <p>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	中证综合债券指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	曾麓燕
	联系电话	0755-82370388	021-52629999-212040
	电子邮箱	investor@igwfm.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		4008888606	95561
传真		0755-22381339	021-62535823

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2017 年	2016 年	2015 年 8 月 26 日 (基金合同生效日)– 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,359,674.32	42,313,160.31	12,848,355.73
本期利润	41,872,505.45	-6,725,923.25	16,046,167.79
加权平均基金份额本期利润	0.0294	-0.0066	0.0282
本期基金份额净值增长率	2.16%	2.74%	2.80%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0188	0.0509	0.0226
期末基金资产净值	166,967,688.68	2,129,963,110.43	585,000,078.37
期末基金份额净值	1.033	1.051	1.028

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。

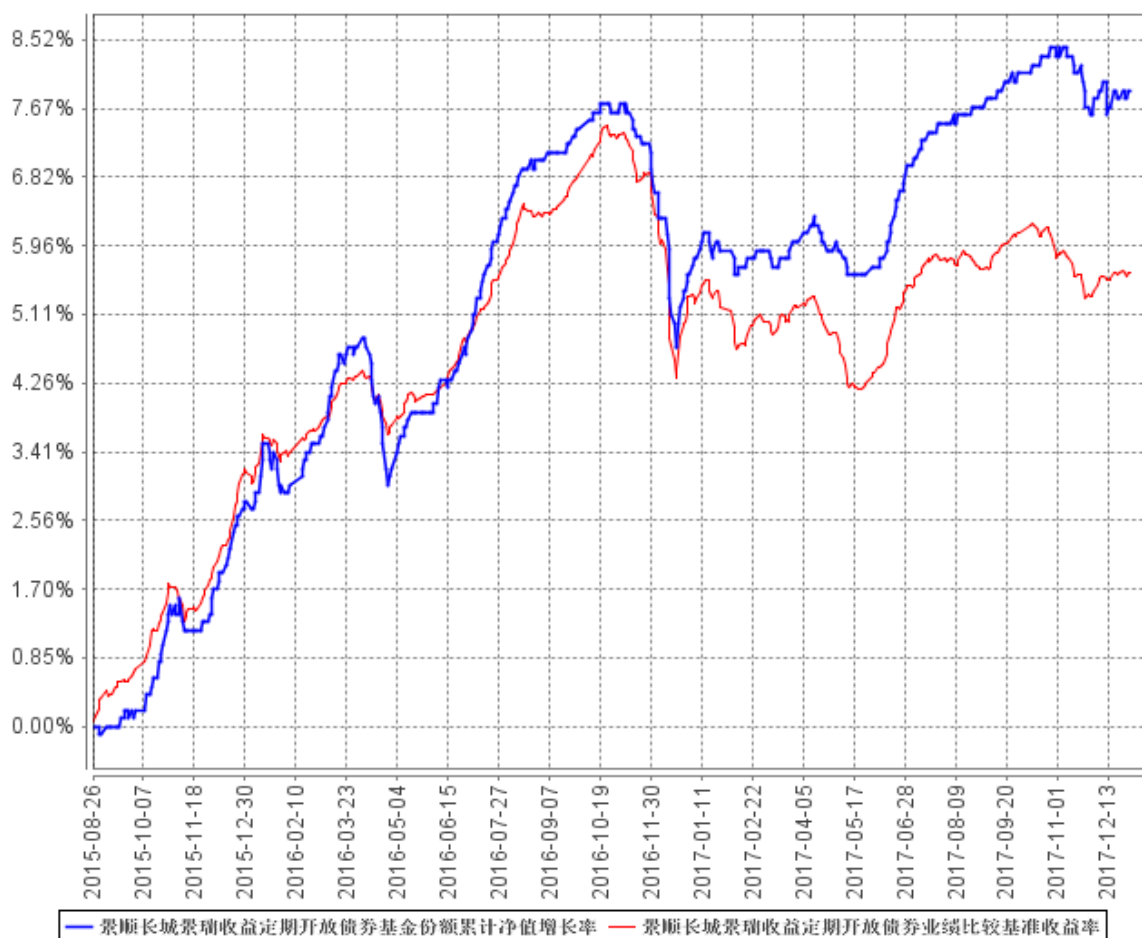
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

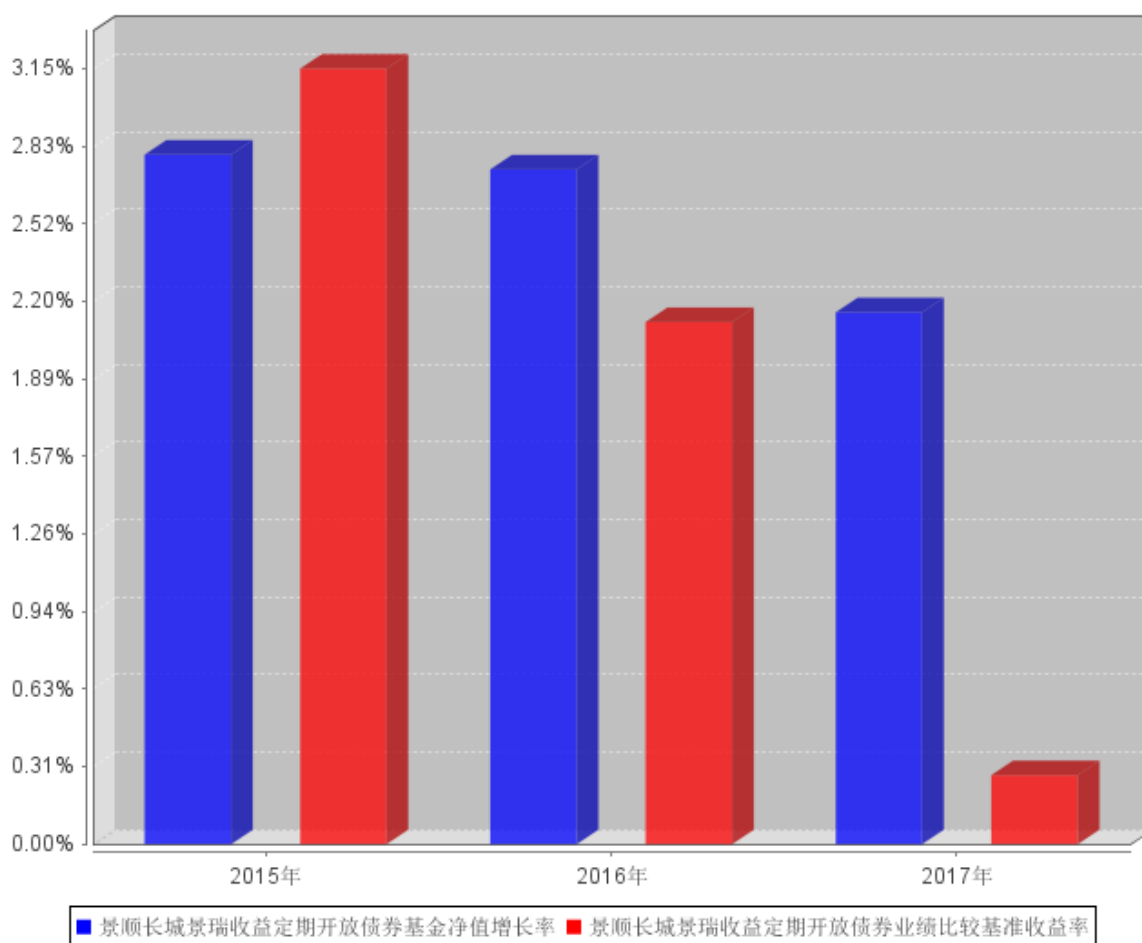
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.19%	0.09%	-0.47%	0.05%	0.28%	0.04%
过去六个月	0.88%	0.07%	0.16%	0.04%	0.72%	0.03%
过去一年	2.16%	0.07%	0.28%	0.05%	1.88%	0.02%
自基金合同 生效起至今	7.89%	0.08%	5.63%	0.07%	2.26%	0.01%

### 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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（自由开放期开始前三个月至自由开放期结束后三个月内不受此比例限制）。任一开放期内，本基金持有现金或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 2015 年 8 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2015 年净值收益率和业绩基准收益率的实际计算期间是从 2015 年 8 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	0.4000	68,067,603.82	13,006,253.03	81,073,856.85	
2016	0.0500	2,762,745.87	82,024.23	2,844,770.10	
2015	-	-	-	-	
合计	0.4500	70,830,349.69	13,088,277.26	83,918,626.95	

## §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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理72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（本基金的最后运作日为 2017 年 12 月 26 日，清算截止日为 2018 年 1 月 26 日）、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（本基金的最后运作日为 2017 年 11 月 13 日，清算截止日为 2017 年 12 月 8 日）、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金。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		
陈文鹏	本基金的基金经理、固定收益部投资总监	2015 年 8 月 26 日	-	9 年	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。

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、《景顺长城景瑞收益定期开放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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 37 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品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。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为，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

2017 年国内经济企稳回升，GDP 同比由 2016 年的 6.7% 小幅回升至 6.9%，供给侧改革取得阶段性效果，上游企业盈利明显好转，对经济增速下滑的拖累减轻，消费升级、新兴制造业和出口成为拉动经济增长的新动力，同时基建和地产投资增速对经济仍起到托底作用。通胀方面，2017 年 CPI 和 PPI 同比增速分别为 1.6% 和 6.3%，工业品价格仍延续 2016 年上涨态势，但增速有所放缓。货币政策和金融监管方面，货币政策相对 2016 年有所收紧，金融去杠杆和支持实体经济是主要目标，银行间资金面阶段性偏紧，资金利率在波动中逐步走高，金融监管下各类金融机构均面临不同程度的去杠杆压力。海外方面，全球处于复苏通胀，货币政策边际上收紧。

经济基本面好于预期，货币政策边际收紧和金融监管下债券供需失衡，全年债券收益率在波动中逐步上行，10 年期国债和 10 年期国开债收益率分别为 3.88% 和 4.82%，较去年末上行 87BP 和 114BP。3 年 AAA 中票和 5 年期 AA+ 企业债收益率分别为 5.29% 和 5.67%，较去年末分别上行 138BP 和 136BP，信用利差有所回升。受益于权益市场的上涨，2017 年前 3 季度中证转债指数上涨 6.96%，4 季度受权益市场调整和可转债供给放量影响，中证转债指数跌幅较大，全年中证转债指数下跌 0.16%。

组合操作上，组合以降低杠杆比例和组合久期为主要目标，卖出久期偏长的个券，并相应买入同业存单，尽可能降低因债券收益率上行带来的净值回撤。期间遇到大比例赎回，组合较好地应对因大比例赎回带来的冲击。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年度，本基金份额净值增长率为 2.16%，业绩比较基准收益率为 0.28%。

## 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 2018 年经济基本面，新旧经济动能仍能对经济增速起到支撑作用，净出口仍能对经济带来正贡献，但受资金约束、地产长效机制推动，经济数据未来仍面临一定幅度的回落压力，预计上半年经济数据压力不大，下半年需关注基建可能的下滑对经济的负面影响。在供给侧改革深化、需求略走弱的背景下 PPI 会缓慢回落，不会走到通缩的情况。CPI 可能因基数和油价的原因存在阶段性压力，但看不到失控的情况。为支持实体经济，货币政策仍存在定向宽松的可能，但金融去杠杆的主基调未变，金融体系仍面临严监管的格局，再加上全球货币紧缩趋势仍在，债券市场所面临的政策环境仍相对不利。

利率债在当前位置具有配置价值，顶部相对明确，但经济韧性强、海外货币政策收紧、国

内金融监管继续推进的背景下，利率债下行空间有限，若下半年经济存在阶段性下行压力，届时利率债则存在一定的交易机会。信用债绝对收益率已经较高，但中低等级信用债仍面临信用利差走扩风险，且中小企业信用风险明显上升，维持选择短久期、中高等级信用债配置的观点。可转债供给量仍较大，尽管存在估值压缩的压力，但转债个券的投资机会增多，值得关注。

操作计划上，考虑到债券收益率下行机会有限，组合仍主要以短久期的中高等级信用债和同业存单、同业存款为主要投资标的，合理运用杠杆比例，同时密切关注可转债的阶段性交易机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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送给基金托管人，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，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委员会的运作。研究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、行业发展及个券状况等各方面因素，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委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究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委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。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。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会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、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截止 2016 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 103,116,701.80 元，本基金的基金管理人已于 2017 年 1 月 12 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 0.4 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截止 2017 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 3,032,169.74 元，本基金的基金管理人已于 2018 年 1 月 19 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 0.02 元，详细信息请查阅相关分红公告。

#### **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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

本报告期内，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。



## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	1,061,337.46	2,271,457.51
结算备付金	1,228,836.67	1,808,448.79
存出保证金	15,082.36	31,812.12
交易性金融资产	234,319,418.40	2,273,023,921.76
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	234,319,418.40	2,273,023,921.76
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	-	-
应收证券清算款	2,000,000.00	2,723,064.14
应收利息	3,686,661.94	47,053,534.94
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	242,311,336.83	2,326,912,239.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>2016 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	73,009,720.48	195,474,861.90
应付证券清算款	2,002,268.32	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	85,038.01	1,084,307.23
应付托管费	14,173.01	180,717.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,454.08	31,191.41
应交税费	-	-

应付利息	102,994.25	69,050.44
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	119,000.00	109,000.00
负债合计	75,343,648.15	196,949,128.83
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	161,643,253.94	2,026,846,408.63
未分配利润	5,324,434.74	103,116,701.80
所有者权益合计	166,967,688.68	2,129,963,110.43
负债和所有者权益总计	242,311,336.83	2,326,912,239.26

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额 161,643,253.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	61,884,664.76	7,208,113.89
1. 利息收入	88,203,973.30	63,678,842.52
其中：存款利息收入	9,810,878.44	314,396.85
债券利息收入	73,590,600.06	59,018,545.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,802,494.80	4,345,900.07
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-65,066,093.31	-7,492,540.98
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-65,066,093.31	-7,492,540.98
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）	38,512,831.13	-49,039,083.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	233,953.64	60,895.91

<b>减：二、费用</b>	20,012,159.31	13,934,037.14
1. 管理人报酬	8,758,973.04	6,438,844.66
2. 托管费	1,459,828.80	1,073,140.72
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	30,482.49	34,227.54
5. 利息支出	9,276,594.18	5,953,303.74
其中：卖出回购金融资产支出	9,276,594.18	5,953,303.74
6. 其他费用	486,280.80	434,520.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	41,872,505.45	-6,725,923.25
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	41,872,505.45	-6,725,923.25

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	2,026,846,408.63	103,116,701.80	2,129,963,110.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,872,505.45	41,872,505.45
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）	-1,865,203,154.69	-58,590,915.66	-1,923,794,070.35
其中：1. 基金申购款	12,972,602.61	209,697.20	13,182,299.81
2. 基金赎回款	-1,878,175,757.30	-58,800,612.86	-1,936,976,370.16
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）	-	-81,073,856.85	-81,073,856.85
五、期末所有者权益（基金净值）	161,643,253.94	5,324,434.74	166,967,688.68

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	568,953,910.58	16,046,167.79	585,000,078.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,725,923.25	-6,725,923.25
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）	1,457,892,498.05	96,641,227.36	1,554,533,725.41
其中：1. 基金申购款	1,788,044,501.02	117,305,550.22	1,905,350,051.24
2. 基金赎回款	-330,152,002.97	-20,664,322.86	-350,816,325.83
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）	-	-2,844,770.10	-2,844,770.10
五、期末所有者权益（基金净值）	2,026,846,408.63	103,116,701.80	2,129,963,110.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
康乐	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城景瑞收益定期开放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[2015]第 1125 号《关于准予景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金,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 568,879,904.57 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1070 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景瑞收益定期开放债券

型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 568,953,910.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 74,006.01 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞收益定期开放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%，在每个自由开放期自由开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放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：中证综合债券指数收益率。

本基金以定期开放的方式运作。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)12 个月的期间。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，每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作，共包含为两个封闭期和一个受限开放期；本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期，在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费；封闭期内本基金不接受基金份额的申购和赎回，亦不上市交易。

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 2018 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 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[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。

### 7.4.7 关联方关系

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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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”）	基金管理人的股东
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,758,973.04	6,438,844.66
其中：支付销售机构的客户维护费	2,162,819.83	1,960,064.46

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 0.60% 的费率计提，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 0.60% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,459,828.80	1,073,140.72

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 0.10% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

### 7.4.8.5 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,061,337.46	209,408.74	2,271,457.51	198,873.42

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。



## 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 7.4.9.2 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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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 53,009,720.48 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
111714268	17 江苏银行 CD268	2018 年 1 月 4 日	95.10	200,000	19,020,000.00
111715437	17 民生银行 CD437	2018 年 1 月 4 日	98.70	200,000	19,740,000.00
111785925	17 杭州银行 CD196	2018 年 1 月 4 日	95.02	158,000	15,013,160.00
合计				558,000	53,773,160.00

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，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 20,000,000.00 元，于 2018 年 2 月 6 日前先后到期。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。

## 7.4.10 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 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属于第二层次的余额为 234,319,418.40 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 6,730,692.00 元，第二层次 2,266,293,229.76 元，无属于第三层次的余额)。

(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，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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 12 月 31 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，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。

根据财政部、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果无影响。

(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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	234,319,418.40	96.70
	其中：债券	234,319,418.40	96.70
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,290,174.13	0.95
8	其他各项资产	5,701,744.30	2.35
9	合计	242,311,336.83	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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。

#### 8.4.2 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。

#### 8.4.3 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。

**8.5 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	130,724,018.40	78.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,928,000.00	5.95
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	93,667,400.00	56.10
9	其他	-	-
10	合计	234,319,418.40	140.34

**8.6 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	111709531	17 浦发银行 CD531	200,000	19,744,000.00	11.83
2	111715437	17 民生银行 CD437	200,000	19,740,000.00	11.82
3	111714268	17 江苏银行 CD268	200,000	19,020,000.00	11.39
4	111713115	17 浙商银行 CD115	200,000	19,010,000.00	11.39
5	111785925	17 杭州银行 CD196	170,000	16,153,400.00	9.67

**8.7 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。

**8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

### 8.10.3 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。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	15,082.36
2	应收证券清算款	2,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,686,661.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,701,744.30

### 8.11.4 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。

### **8.11.5 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,910	84,629.98	9,342.96	0.01%	161,633,910.98	99.99%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	20.43	0.00%

### 9.3 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。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年8月26日）基金份额总额	568,953,910.58
本报告期期初基金份额总额	2,026,846,408.63
本报告期基金总申购份额	12,972,602.61
减:本报告期基金总赎回份额	1,878,175,757.30
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	161,643,253.94

注：总申购份额含红利再投。



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本基金管理人于 2017 年 12 月 29 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，同意许义明先生辞去本公司总经理一职，聘任康乐先生担任本公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 2 月 14 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，聘任赵代中先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 3 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 110,000.00 元。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
兴业证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1. 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。

2. 本基金本年度交易单元未变更。

### 11.7.2 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	成交金额	占当期权 证 成交总额

				的比例		的比例
兴业证券股 份有限公司	388,770,282.31	100.00%	13,859,341,000.00	100.00%	-	-

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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者超过 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--20170911	469,042,213.88	0.00	469,042,213.88	-	-
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。

### 12.2 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

2018 年 3 月 28 日