

景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 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。

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。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 11 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 11 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 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..... | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 17 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 19 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 20 |
| 4.9 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..... | 20 |
| §5 托管人报告 | 21 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 21 |
| 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..... | 21 |
| 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..... | 21 |
| §6 审计报告 | 22 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 22 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 22 |
| §7 年度财务报表 | 24 |
| 7.1 资产负债表..... | 24 |
| 7.2 利润表..... | 25 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 26 |
| 7.4 报表附注..... | 27 |
| §8 投资组合报告 | 51 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 51 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 51 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 52 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 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..... | 54 |

| | |
|---|-----------|
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 54 |
| 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 | 55 |
| 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 | 55 |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 55 |
| 8.11 投资组合报告附注 | 55 |
| § 9 基金份额持有人信息 | 57 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 57 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 57 |
| 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 | 57 |
| § 10 开放式基金份额变动 | 58 |
| § 11 重大事件揭示 | 59 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 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 | 59 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 59 |
| 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 | 60 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 60 |
| 11.8 其他重大事件 | 62 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| 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 | 72 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| § 13 备查文件目录 | 73 |
| 13.1 备查文件目录 | 73 |
| 13.2 存放地点 | 73 |
| 13.3 查阅方式 | 73 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 景顺长城景盈金利债券 | |
| 场内简称 | 无 | |
| 基金主代码 | 002842 | |
| 交易代码 | 002842 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 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 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 61,544,187.24 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 景顺长城景盈金利债券 A | 景顺长城景盈金利债券 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 002842 | 002843 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 46,996,839.60 份 | 14,547,347.64 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类资产获得稳健收益，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格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：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）资产支持证券投资策略：本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调</p> |

| | |
|--------|--|
| | 整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 (4) 中小企业私募债券投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。 |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率× 90%+ 沪深 300 指数收益率×10% |
| 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 | 贺倩 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95599 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100031 |
| 法定代表人 | | 杨光裕 | 周慕冰 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

§3 主要财务指标、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 9 月 20 日 (基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 | |
|---------------|---------------|---------------|--|---------------|
| | 景顺长城景盈金利债券 A | 景顺长城景盈金利债券 C | 景顺长城景盈金利债券 A | 景顺长城景盈金利债券 C |
| 本期已实现收益 | 4,571,131.20 | 955,500.11 | 796,679.27 | 502,243.70 |
| 本期利润 | 7,327,281.35 | 1,777,214.25 | -2,218,772.13 | -638,470.59 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0490 | 0.0444 | -0.0073 | -0.0038 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.85% | 4.41% | -0.73% | -0.38% |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.49% | 4.08% | -0.80% | -0.91% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 1,338,207.09 | 339,257.64 | -2,113,319.17 | -806,848.34 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0285 | 0.0233 | -0.0080 | -0.0090 |
| 期末基金资产净值 | 48,716,644.99 | 15,004,084.02 | 262,848,334.00 | 88,587,504.56 |
| 期末基金份额净值 | 1.0365 | 1.0313 | 0.9920 | 0.9909 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| 基金份额累计净值增长率 | 3.65% | 3.13% | -0.80% | -0.91% |

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四位，小数点后第五位舍去，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

景顺长城景盈金利债券 A

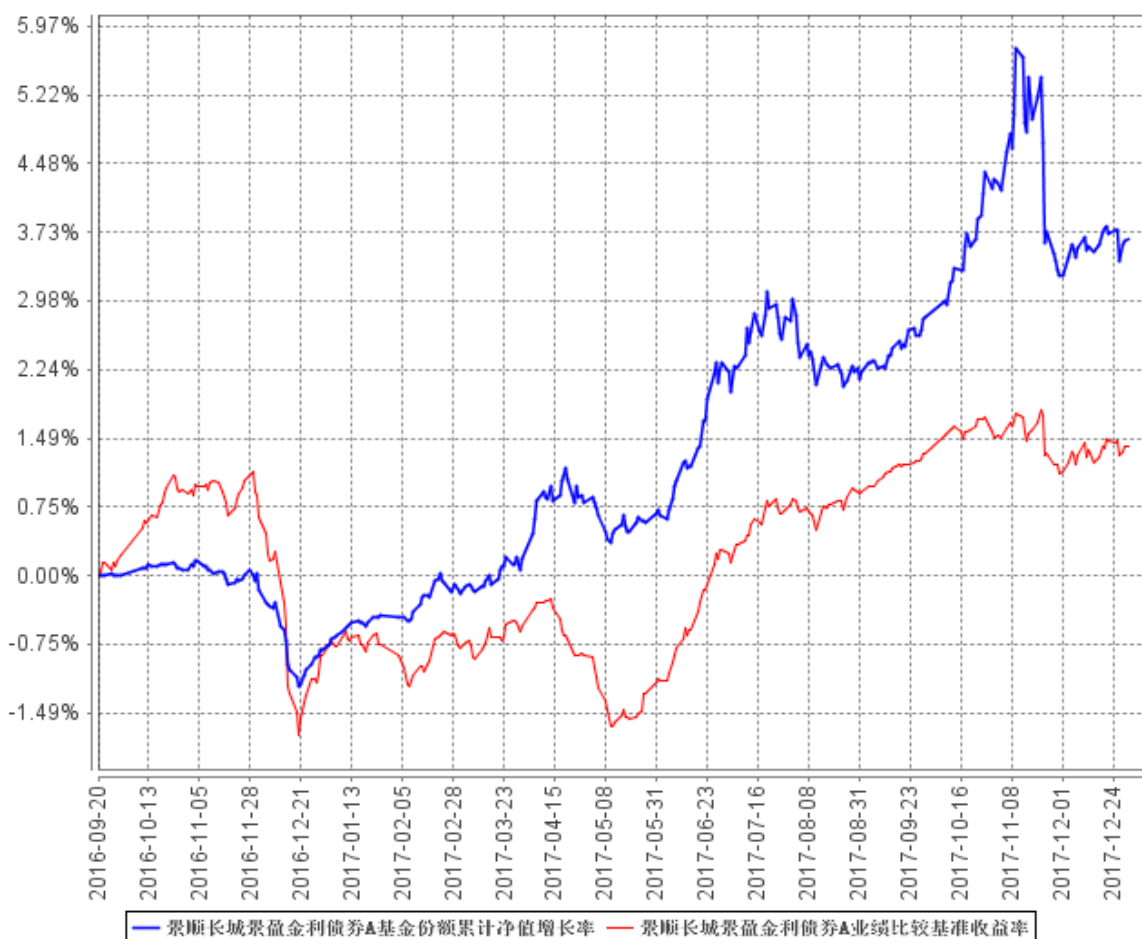
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 0.83% | 0.26% | 0.09% | 0.10% | 0.74% | 0.16% |
| 过去六个月 | 1.31% | 0.21% | 1.13% | 0.08% | 0.18% | 0.13% |
| 过去一年 | 4.49% | 0.16% | 2.30% | 0.08% | 2.19% | 0.08% |
| 自基金合同 | 3.65% | 0.15% | 1.41% | 0.10% | 2.24% | 0.05% |

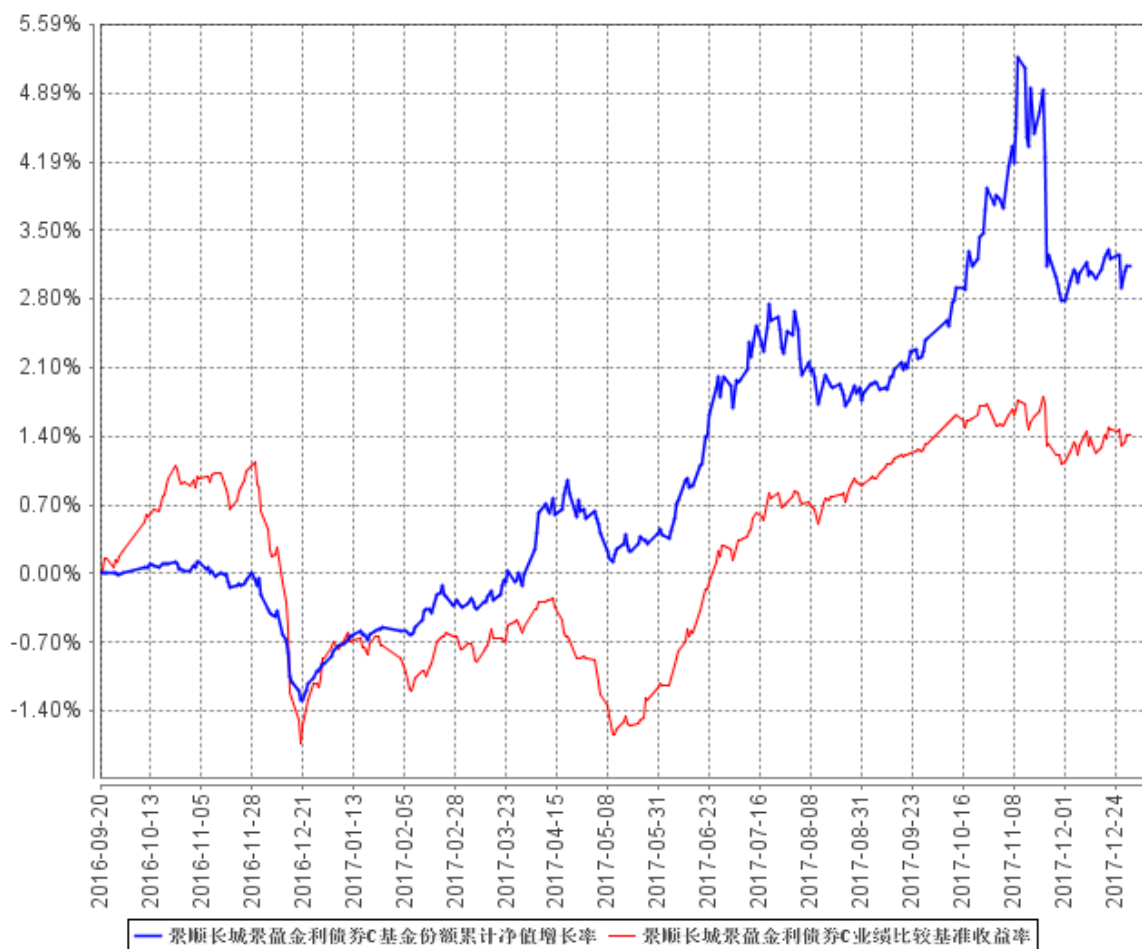
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

景顺长城景盈金利债券 C

| 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 | 0.72% | 0.26% | 0.09% | 0.10% | 0.63% | 0.16% |
| 过去六个月 | 1.11% | 0.20% | 1.13% | 0.08% | -0.02% | 0.12% |
| 过去一年 | 4.08% | 0.16% | 2.30% | 0.08% | 1.78% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.13% | 0.15% | 1.41% | 0.10% | 1.72% | 0.05% |

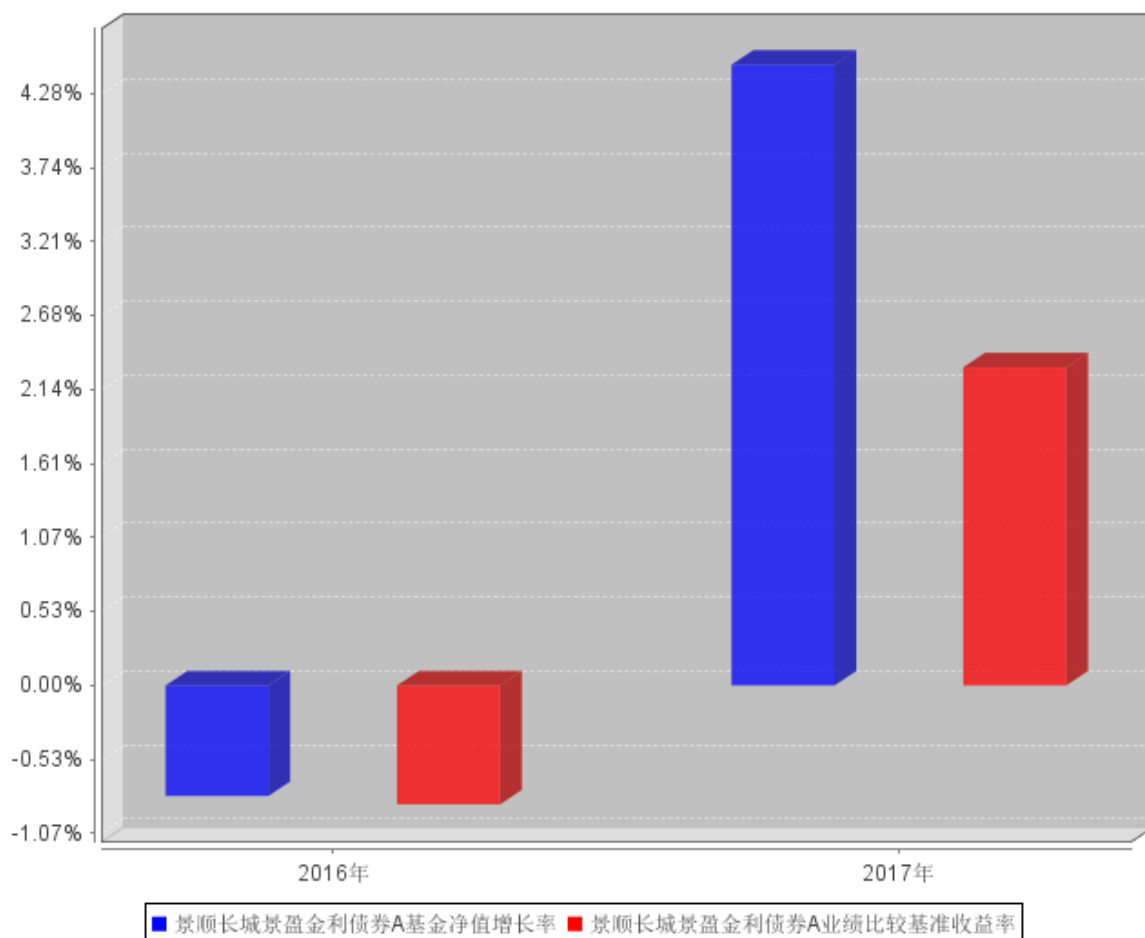
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

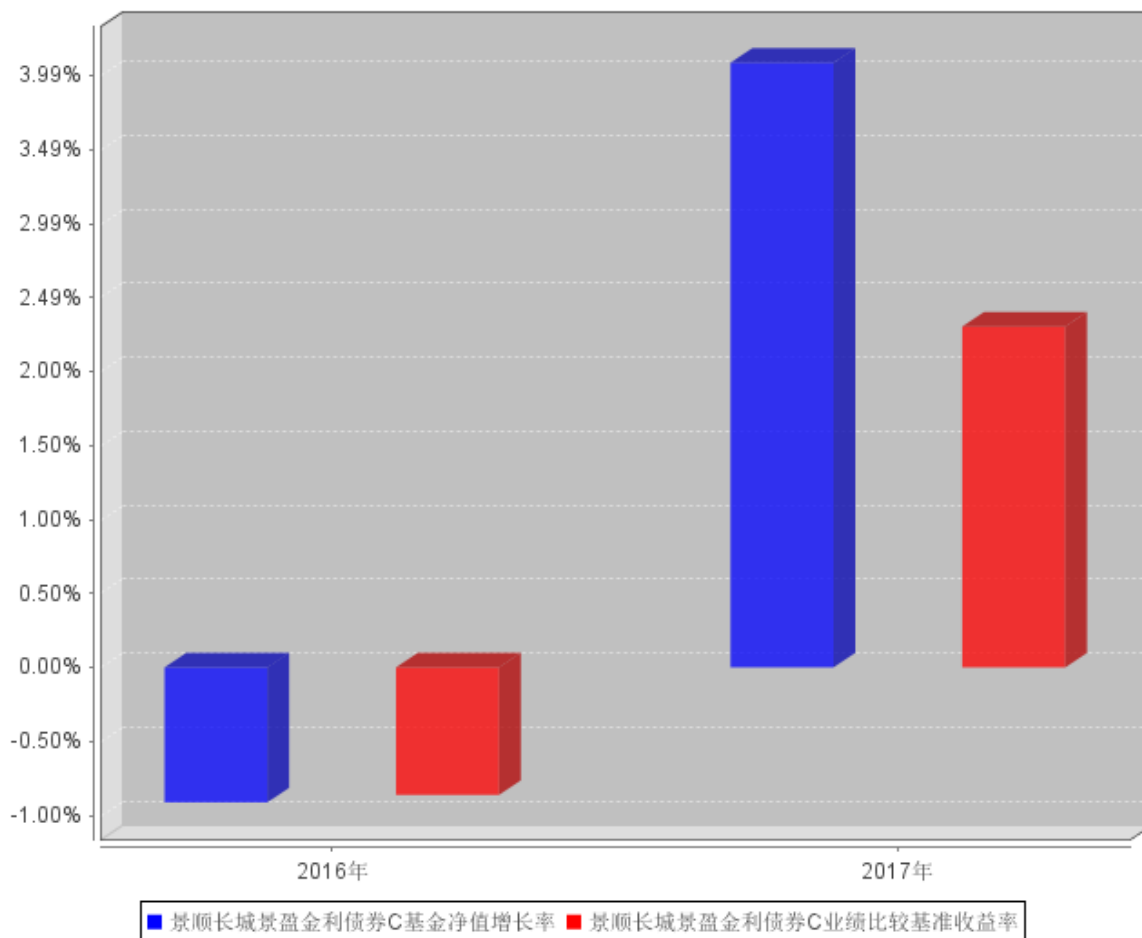




注：本基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市场价值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2016 年 9 月 20 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

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：2016年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是2016年9月20日（基金合同生效日）至2016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

本基金自基金合同生效日（2016年9月20日）起至本报告期末未进行利润分配。

§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 | | |
| 袁媛 | 本基金的基金经理 | 2016 年 9 月 20 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、《景顺长城景盈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 年债市走势曲折，驱动因素发生变化，金融监管和去杠杆是主线，需求不足是主要矛盾。

债市延续 2016 年末的下跌行情，收益率再创新高，期间出现过两波交易性行情。1 季度在金融监管（如同业存单纳入同业负债、资管新规内审稿发布）、央行两次上调 MLF 和回购招标利率、经济金融数据超预期等因素影响下，收益率延续 2016 年末的下跌趋势。2 季度的 4、5 月银监会频频发文，目标直指金融去杠杆。债市受到冲击，短端利率上行幅度更大，收益率曲线持续变平。6 月监管间歇、资金面变松、美债下行背景下，债市出现反弹，10-1Y 期国债一度倒挂。3 季度金融工作会议强调去杠杆防风险，经济先平后降，人民币升值，资金面紧平衡。债市横盘震荡为主。4 季度国庆节前央行定向降准政策力度远低于市场预期，叠加对基本面和金融监管的担忧、海外债市调整等因素，债市再度大幅调整，十年国债创 2014 年 10 月以来新高，交易盘止损后观望情绪浓重。截至 12 月 31 日，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。

2017 年权益市场呈现泾渭分明状态。同一时段、同一市场呈现两个截然不同的板块走势。上证 50 指数 25.08% 的升幅与创业板走势 -10.67% 的跌幅相差近 36%。权重蓝筹股与中小板个股表现呈现冰火两重天。价格的分化源于价值的分化。新股审核从严的常态化、机构投资者的参与、A 股纳入 MSCI 指数、深港通、沪港通的开通，将改变中国股市的投资者构成，也将改变估值及理念。从统计数据看，ST 个股、业绩下降及解禁是个股下跌的三大主因。而涨价提升的业绩、持续性成长及重大题材成个股上涨的三大动力。可转债市场因下半年扩容压力表现一般，中证转债指数全年震荡下跌约 0.16%。权益市场方面表现出结构性行情，全年沪深 300 大涨 21.78%，中小板指上涨 16.7%，创业板指则下跌 10.67%。

金融监管政策的不断推进成为全年债市调整的主要因素。货币政策基调维持中性、基本面持续韧性，债市收益率几乎呈现单边上行，期间出现的两次交易机会较难捕捉。尤其是资管新规影响下的供需失衡成为影响收益率变动的一个重要考量。组合全年坚持以短久期操作为主，主要持仓是资质较好的短融、2 年内城投债、短久期产业债及同业存单，享受持有期收益，并减持了一些基本面不强的信用个券。2 季度的利率债交易机会由于负债端不稳定少有参与，3 季度适度参与了利率债的交易性机会，但整体利率上行效果不佳并及时离场。杠杆部分择机布局资金走紧收益率走高时的协存、长期限回购、存单等安全收益资产增厚组合收益。

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，全年主要持仓食品饮料、家电、保险等相关板块，同时加强波段操作，阶段性加仓 5G、消费电子、新能源汽车等板块。并在年底前逐步锁定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年，景盈金利 A 份额净值增长率为 4.49%，业绩比较基准收益率为 2.30%。

2017 年，景盈金利 C 份额净值增长率为 4.08%，业绩比较基准收益率为 2.30%。

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 1 季度宏观经济，将继续保持平稳态势。从政策层表态看，对经济的认知也比较乐观。在总量相对平稳的情况下，可能更需要关注结构性的变化。新旧经济继续转换，过去的经济增长周期主要依赖基建和房地产投资驱动，2018 年消费继续复苏，租赁房、保障房等增量投资将对地产投资有较大的支撑作用。基建投资因为财政和准财政的力度放缓而出现回落，我们认为地产投资相对不差将抵补基建投资的可能放缓，与出口和消费相关制造业的结构升级仍值得关注。以过剩产能为代表的老经济继续去杠杆，以消费升级和制造业升级为代表的新经济迎来量价齐升的增长周期。2017 年全年看经济企稳回升主要得益于出口回暖、房地产销售和投资链条。2018 年房地产销售周期回落、地方融资收紧将导致投资大概率继续走弱，但外需向好有望延续，基数提升明年出口增速略降，居民收入提升带动消费稳定增长，整体看经济增长动能略回落。对于 PPI 我们认为在供给侧改革深化，需求略走弱的背景下会缓慢回落，但不会走到通缩情况。CPI 可能因基数和油价的原因阶段性有压力，但看不到失控的情况。汇率方面，人民币汇率呈现双向波动，币值呈现更加稳定，对资产价格阶段性负面影响降低。风险点上，需要关注国内房地产市场超预期下行；美国经济超预期回升带来美联储加快加息进程。

海外基本面看，12 月议息会议美联储宣布加息 25bp，2018 年隐含 3 次加息概率。美联储全面上调未来经济预期，美国税改正式落地。2017 年 4 季度美国 GDP 年化环比增速 2.6%，显示美国经济内需依旧强劲。欧元区 3 季度实际 GDP 创欧债危机以来新高。日本 3 季度 GDP 当季同比回升至近两年来高位。欧日货币政策收缩正在路上。IMF 上调今明两年全球增长预期至 3.9%。海外货币政策收紧趋势明显，将一定程度上制约国内货币政策放松空间。

资金面上，超储率偏低的背景下，未来资金面走势很大程度上仍由央行公开市场操作决定。在稳健中性的货币政策态度下，央行预计将继续削峰填谷保持流动性的不松不紧。央行宣布建立“临时准备金动用安排”，应对春节期间的流动性缺口。显示央行对市场的预调微调。流动性环境 1 季度还是比较紧，短端资金利率仍将维持高位。为支持实体经济以及理财回表需求下，信贷环境还是非常强劲。

政策面上，十九大后淡化经济增长的数量目标。防范系统性风险是重要政策着力点之一。中央经济工作会议传递出我国经济已由高速增长阶段转向高质量发展阶段，对经济增速下滑容忍度提高，在金融监管防风险的目标下货币政策将继续保持“稳健中性”基调。M2 明年定调 9%左右，

货币政策难以放松。而监管方面，2018 年金融监管持续，相关政策进入补短板阶段，1 季度继续出台相关政策可能性较大，不过在维护金融稳定的考虑下，未来监管政策的出台方式将兼顾金融市场反应。

展望后市，稳健中性的货币政策以及金融监管延续。市场对监管政策、货币政策的预期与基本面预期会持续纠结。在货币政策未转向及基本面确认回落之前收益率预计将维持高位震荡。利率债具备配置价值，但由于金融监管及去杠杆政策的持续推进，需求受到很大抑制。未来供需关系如何演变是影响利率债收益率水平的主要矛盾。基于对宏观和政策面的判断，1 季度债券市场的机会不大，仍处于利率的磨顶阶段，短久期拿票息控制信用风险仍是最佳的投资策略。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。

权益方面，在流动性偏紧的环境下仍需要寻找确定性的品种，仍看好家电白酒的业绩确定性，以及涨价逻辑下估值和成长匹配的行业龙头、供给侧推进下龙头集中优势个股。未来关注有业绩实现能力的个股投资机会，继续看好消费升级及大消费板块、产业升级板块、性价比有所提升的金融板块。由于缺乏新增资金，目前市场存量博弈特征明显，全球无风险收益率上升背景下，权益市场波动率加大，更加关注结构性机会。未来仍会择个股、波段灵活操作。

组合投资在短久期、低杠杆的基础上，逐步寻找投资机会，择机进行组合调整，控制债券回撤风险。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。等待债券市场调整后的配置机会。关注利率债的交易机会。权益方面，将根据市场变化保持合适的权益仓位进行波段操作。积极参与新发转债机会，兼顾权益市场的投资机会，努力为投资人创造长期投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

4.9 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2018)第 21581 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金全体基金份额持有人： |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城景盈金利债券型证券投资基金(以下简称“景顺长城景盈金利基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城景盈金利基金 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。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城景盈金利基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>景顺长城景盈金利基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城景盈金利基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城景盈金利基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城景盈金利基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城景盈金利基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城景盈金利基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 许康玮 朱宏宇 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 · 上海市 |
| 审计报告日期 | 2018 年 3 月 26 日 |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景盈金利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 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 520,170.39 | 2,026,258.44 |
| 结算备付金 | | 184,820.68 | 1,974,891.51 |
| 存出保证金 | | 30,339.07 | 18,518.96 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 68,622,068.56 | 285,332,898.60 |
| 其中：股票投资 | | 5,714,164.66 | 5,598,330.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 62,907,903.90 | 279,734,568.60 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | 54,000,292.50 |
| 应收证券清算款 | | 400,000.00 | 2,004,554.44 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 1,515,404.83 | 3,630,017.27 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 4,950.37 | 3,501,620.11 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 71,277,753.90 | 352,489,051.83 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 12 月 31 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 6,900,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 489,791.01 | 617,558.29 |
| 应付管理人报酬 | | 40,246.92 | 215,162.77 |
| 应付托管费 | | 11,499.12 | 61,475.09 |
| 应付销售服务费 | | 5,358.88 | 30,696.77 |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 34,503.77 | 62,320.35 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|----------------|
| 应付利息 | | 6,625.19 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 69,000.00 | 66,000.00 |
| 负债合计 | | 7,557,024.89 | 1,053,213.27 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 61,544,187.24 | 354,356,006.07 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 2,176,541.77 | -2,920,167.51 |
| 所有者权益合计 | | 63,720,729.01 | 351,435,838.56 |
| 负债和所有者权益总计 | | 71,277,753.90 | 352,489,051.83 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 61,544,187.24 份。其中 A 类基金份额净值 1.0365 元，基金份额总额 46,996,839.60 份；C 类基金份额净值 1.0313 元，基金份额总额 14,547,347.64 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城景盈金利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 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 20 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| 一、收入 | | 12,982,105.07 | -1,198,609.65 |
| 1.利息收入 | | 9,640,979.86 | 4,845,045.26 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 27,804.77 | 1,603,458.67 |
| 债券利息收入 | | 9,380,002.95 | 2,213,932.90 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 233,172.14 | 1,027,653.69 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -244,255.51 | -1,920,524.05 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 4,472,605.74 | -1,570,111.60 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -5,199,011.50 | -350,412.45 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | 482,150.25 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | 3,577,864.29 | -4,156,165.69 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 列) | | | |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 7,516.43 | 33,034.83 |
| 减：二、费用 | | 3,877,609.47 | 1,658,633.07 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,359,951.62 | 946,017.36 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 388,557.54 | 270,290.68 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 163,723.71 | 200,037.84 |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.18 | 242,355.94 | 90,641.76 |
| 5. 利息支出 | | 1,303,627.54 | 1,076.65 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,303,627.54 | 1,076.65 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.19 | 419,393.12 | 150,568.78 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 9,104,495.60 | -2,857,242.72 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 9,104,495.60 | -2,857,242.72 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景盈金利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） | 354,356,006.07 | -2,920,167.51 | 351,435,838.56 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 9,104,495.60 | 9,104,495.60 |
| 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） | -292,811,818.83 | -4,007,786.32 | -296,819,605.15 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,663,656.97 | 39,956.78 | 2,703,613.75 |
| 2. 基金赎回款 | -295,475,475.80 | -4,047,743.10 | -299,523,218.90 |
| 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 | 61,544,187.24 | 2,176,541.77 | 63,720,729.01 |

| 项目 | 上年度可比期间 | | |
|--|--|---------------|-----------------|
| | 2016 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 金净值) | | | |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 672,590,280.00 | - | 672,590,280.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -2,857,242.72 | -2,857,242.72 |
| 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) | -318,234,273.93 | -62,924.79 | -318,297,198.72 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 12,118,137.05 | -109,594.61 | 12,008,542.44 |
| 2. 基金赎回款 | -330,352,410.98 | 46,669.82 | -330,305,741.16 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 354,356,006.07 | -2,920,167.51 | 351,435,838.56 |

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城景盈金利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[2016]1065号《关于准予景顺长城景盈金利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《景顺长城景盈金利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,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672,501,910.27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(2016)第1234号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金基金合同》于2016年9月20日正式生

效，基金合同生效日的基金份额总额为 672,590,280.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 88,369.73 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费和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/申购时收取认购费或申购费的，称为 A 类基金份额；不收取认购费或申购费，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 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行的固定收益类品种，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 A 股股票(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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

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》、《景顺长城景盈金利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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2016 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试

行)的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的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),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

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[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)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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 520,170.39 | 2,026,258.44 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 520,170.39 | 2,026,258.44 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | | | |
|---------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 5,143,992.78 | 5,714,164.66 | 570,171.88 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 37,428,828.17 | 37,100,403.90 | -328,424.27 |
| | 银行间市场 | 26,627,549.01 | 25,807,500.00 | -820,049.01 |
| | 合计 | 64,056,377.18 | 62,907,903.90 | -1,148,473.28 |
| 资产支持证券 | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | |

| | | | |
|-------------------|---------------------|----------------|----------------|
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 69,200,369.96 | 68,622,068.56 | -578,301.40 |
| 项目 | 上年度末 2016年12月31日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 5,807,046.28 | 5,598,330.00 | -208,716.28 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 53,289,933.22 | 51,966,568.60 |
| | 银行间市场 | 230,392,084.79 | 227,768,000.00 |
| | 合计 | 283,682,018.01 | 279,734,568.60 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 289,489,064.29 | 285,332,898.60 | -4,156,165.69 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | |
|-----------|---------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间买入返售证券 | - | - |
| 交易所买入返售证券 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末 2016年12月31日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间买入返售证券 | 35,000,292.50 | - |
| 交易所买入返售证券 | 19,000,000.00 | - |
| 合计 | 54,000,292.50 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|----|--------------------|---------------------|
| | | |

| | | |
|------------|--------------|--------------|
| 应收活期存款利息 | 78.26 | 1,216.65 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | 83.20 | 888.70 |
| 应收债券利息 | 1,515,229.67 | 3,522,907.92 |
| 应收买入返售证券利息 | - | 104,995.30 |
| 应收申购款利息 | - | 0.40 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 13.70 | 8.30 |
| 合计 | 1,515,404.83 | 3,630,017.27 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 28,512.03 | 52,153.02 |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,991.74 | 10,167.33 |
| 合计 | 34,503.77 | 62,320.35 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年12月31日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提费用 | 69,000.00 | 66,000.00 |
| 合计 | 69,000.00 | 66,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 景顺长城景盈金利债券 A | | |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 264,961,653.17 | 264,961,653.17 |
| 本期申购 | 1,448,688.02 | 1,448,688.02 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -219,413,501.59 | -219,413,501.59 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 46,996,839.60 | 46,996,839.60 |

金额单位：人民币元

| 景顺长城景盈金利债券 C | | |
|---------------|-----------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 89,394,352.90 | 89,394,352.90 |
| 本期申购 | 1,214,968.95 | 1,214,968.95 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -76,061,974.21 | -76,061,974.21 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 14,547,347.64 | 14,547,347.64 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 景顺长城景盈金利债券 A | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 621,031.82 | -2,734,350.99 | -2,113,319.17 |
| 本期利润 | 4,571,131.20 | 2,756,150.15 | 7,327,281.35 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,853,955.93 | 359,799.14 | -3,494,156.79 |
| 其中：基金申购款 | 26,845.82 | 612.84 | 27,458.66 |
| 基金赎回款 | -3,880,801.75 | 359,186.30 | -3,521,615.45 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,338,207.09 | 381,598.30 | 1,719,805.39 |

单位：人民币元

| 景顺长城景盈金利债券 C | | | |
|----------------|-------------|-------------|--------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 115,095.78 | -921,944.12 | -806,848.34 |
| 本期利润 | 955,500.11 | 821,714.14 | 1,777,214.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -731,338.25 | 217,708.72 | -513,629.53 |
| 其中：基金申购款 | 13,058.81 | -560.69 | 12,498.12 |
| 基金赎回款 | -744,397.06 | 218,269.41 | -526,127.65 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 339,257.64 | 117,478.74 | 456,736.38 |

7.4.7.11 存款利息收入

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9月20日(基金合同生效日) 至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 活期存款利息收入 | 22,991.04 | 89,765.68 |
| 定期存款利息收入 | - | 1,501,274.44 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 4,382.70 | 12,385.26 |
| 其他 | 431.03 | 33.29 |
| 合计 | 27,804.77 | 1,603,458.67 |

7.4.7.12 股票投资收益

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9月20日(基金 合同生效日)至2016年12月 31日 |
|------------|---------------------------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 79,266,863.75 | 26,302,888.90 |
| 减：卖出股票成本总额 | 74,794,258.01 | 27,873,000.50 |
| 买卖股票差价收入 | 4,472,605.74 | -1,570,111.60 |

7.4.7.13 债券投资收益

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9月20日(基金合 同生效日)至2016年12月31 日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额 | 441,231,267.06 | 6,090,290.41 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额 | 439,223,223.17 | 6,391,510.53 |
| 减：应收利息总额 | 7,207,055.39 | 49,192.33 |
| 买卖债券差价收入 | -5,199,011.50 | -350,412.45 |

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效 |
|----|-------------------------|------------------------------|
|----|-------------------------|------------------------------|

| | 月 31 日 | 日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------|----------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 482,150.25 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 482,150.25 | - |

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 20 日(基金合同 生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------|---|---|
| 1. 交易性金融资产 | 3,577,864.29 | -4,156,165.69 |
| ——股票投资 | 778,888.16 | -208,716.28 |
| ——债券投资 | 2,798,976.13 | -3,947,449.41 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——贵金属投资 | - | - |
| ——其他 | - | - |
| 2. 衍生工具 | - | - |
| ——权证投资 | - | - |
| 3. 其他 | - | - |
| 合计 | 3,577,864.29 | -4,156,165.69 |

7.4.7.17 其他收入

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 9 月 20 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|---------|---|---|
| 基金赎回费收入 | 7,393.19 | 33,033.47 |
| 基金转换费收入 | 123.24 | 1.36 |
| 合计 | 7,516.43 | 33,034.83 |

- 注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中不低于 25% 的部分归入基金财产。
2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分中不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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 9 月 20 日(基金合同生 效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 236,743.44 | 87,654.26 |
| 银行间市场交易费用 | 5,612.50 | 2,987.50 |
| 合计 | 242,355.94 | 90,641.76 |

7.4.7.19 其他费用

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9月20日(基金合同 生效日)至2016年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--|
| 审计费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 75,000.00 |
| 债券托管账户维护费 | 37,100.00 | 6,000.00 |
| 银行划款手续费 | 22,093.12 | 9,068.78 |
| 其他 | 200.00 | 500.00 |
| 合计 | 419,393.12 | 150,568.78 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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 |
| 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”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 景顺资产管理有限公司 | 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 |
| 大连实德集团有限公司 | 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效日)至 2016年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|--|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 长城证券 | 74,429,165.06 | 48.53% | 42,851,450.81 | 71.45% |

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | | |
|-------|--|----------------|-----------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付 佣金总额的 比例 |
| 长城证券 | 69,315.70 | 48.53% | 18,326.70 | 64.28% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效日)至2016年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付 佣金总额的 比例 |
| 长城证券 | 39,908.49 | 71.45% | 39,908.49 | 76.52% |

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 月31日 | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效日) 至2016年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,359,951.62 | 946,017.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 643,599.50 | 446,716.59 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 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 0.70% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年12 | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效日) |
|----|-------------------------|--------------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------------|

| | 月 31 日 | 至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|------------|--------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 388,557.54 | 270,290.68 |

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|---|------------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城景盈金利 债券 A | 景顺长城景盈金利 债券 C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 1,230.31 | 1,230.31 |
| 中国农业银行 | - | 152,351.36 | 152,351.36 |
| 长城证券 | | | |
| 合计 | - | 153,581.67 | 153,581.67 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2016 年 9 月 20 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 景顺长城景盈金利 债券 A | 景顺长城景盈金利 债券 C | 合计 |
| 景顺长城基金管理有限公司 | - | 945.38 | 945.38 |
| 中国农业银行 | - | 194,321.85 | 194,321.85 |
| 长城证券 | | | |
| 合计 | - | 195,267.23 | 195,267.23 |

注：支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给景顺长城基金管理有限公司，再由景顺长城基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.4% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 上年度可比期间 2016年9月20日(基金合同生效日)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 |
| 中国农业银行 | 520,170.39 | 22,991.04 | 2,026,258.44 | 89,765.68 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因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。

7.4.12.3.2 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 6,900,000.00 元，于 2018 年 1 月 3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型的证券投资基金，属于较低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资及股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 64.92%(2016 年 12 月 31 日：75.34%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 6,900,000.00 元将在 1 个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------------|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|
| | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|---------------------|---------------|---------------|----------------|----------------|------|---------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 520,170.39 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | 520,170.39 |
| 结算备付金 | 184,820.68 | - | - | - | - | - | 184,820.68 |
| 存出保证金 | 30,339.07 | - | - | - | - | - | 30,339.07 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 33,723,375.00 | 29,184,528.90 | 0.00 | 5,714,164.66 | 68,622,068.56 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | 0.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 400,000.00 | 400,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,515,404.83 | 1,515,404.83 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 4,950.37 | 4,950.37 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 735,330.14 | 0.00 | 33,723,375.00 | 29,184,528.90 | 0.00 | 7,634,519.86 | 71,277,753.90 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 6,900,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | 6,900,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 489,791.01 | 489,791.01 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 40,246.92 | 40,246.92 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 11,499.12 | 11,499.12 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 5,358.88 | 5,358.88 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 34,503.77 | 34,503.77 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 6,625.19 | 6,625.19 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 69,000.00 | 69,000.00 |
| 负债总计 | 6,900,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 657,024.89 | 7,557,024.89 |
| 利率敏感度缺口 | -6,164,669.86 | 0.00 | 33,723,375.00 | 29,184,528.90 | 0.00 | - | - |
| 上年度末 2016年12月31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 2,026,258.44 | - | - | - | - | - | 2,026,258.44 |
| 结算备付金 | 1,974,891.51 | - | - | - | - | - | 1,974,891.51 |
| 存出保证金 | 18,518.96 | - | - | - | - | - | 18,518.96 |
| 交易性金融资产 | 20,002,000.00 | 42,081,400.00 | 115,498,500.00 | 102,152,668.60 | - | 5,598,330.00 | 285,332,898.60 |
| 买入返售金融资产 | 54,000,292.50 | - | - | - | - | - | 54,000,292.50 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,004,554.44 | 2,004,554.44 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,630,017.27 | 3,630,017.27 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 3,501,620.11 | 3,501,620.11 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 78,021,961.41 | 42,081,400.00 | 115,498,500.00 | 102,152,668.60 | - | 14,734,521.82 | 352,489,051.83 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 617,558.29 | 617,558.29 |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|---------------|----------------|----------------|---|--------------|--------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 215,162.77 | 215,162.77 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 61,475.09 | 61,475.09 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 30,696.77 | 30,696.77 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 62,320.35 | 62,320.35 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 66,000.00 | 66,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,053,213.27 | 1,053,213.27 |
| 利率敏感度缺口 | 78,021,961.41 | 42,081,400.00 | 115,498,500.00 | 102,152,668.60 | - | - | - |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2017年12月31日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 122,963.22 | 627,504.64 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -122,389.34 | -623,311.92 |

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中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比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种

定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 5,714,164.66 | 8.97 | 5,598,330.00 | 1.59 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 5,714,164.66 | 8.97 | 5,598,330.00 | 1.59 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|---------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2017 年 12 月 31 日） | 上年度末（2016 年 12 月 31 日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 528,280.99 | 967,444.15 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -528,280.99 | -967,444.15 |

7.4.14 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

于第一层次的余额为 5,797,404.66 元,属于第二层次的余额为 62,824,663.90 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:第一层次 6,281,498.60 元,第二层次 279,051,400.00 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。

(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 | 5,714,164.66 | 8.02 |
| | 其中：股票 | 5,714,164.66 | 8.02 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 62,907,903.90 | 88.26 |
| | 其中：债券 | 62,907,903.90 | 88.26 |
| | 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 | 704,991.07 | 0.99 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,950,694.27 | 2.74 |
| 9 | 合计 | 71,277,753.90 | 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

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 3,935,536.60 | 6.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 1,778,628.06 | 2.79 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,714,164.66 | 8.97 |

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601601 | 中国太保 | 22,293 | 923,376.06 | 1.45 |
| 2 | 000568 | 泸州老窖 | 10,200 | 673,200.00 | 1.06 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 8,110 | 647,826.80 | 1.02 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 9,900 | 548,757.00 | 0.86 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 6,800 | 477,360.00 | 0.75 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 10,474 | 457,713.80 | 0.72 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 5,400 | 377,892.00 | 0.59 |
| 8 | 600176 | 中国巨石 | 20,300 | 330,687.00 | 0.52 |
| 9 | 002035 | 华帝股份 | 10,800 | 325,512.00 | 0.51 |
| 10 | 000786 | 北新建材 | 14,200 | 319,500.00 | 0.50 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 13,500 | 316,440.00 | 0.50 |
| 12 | 002415 | 海康威视 | 8,100 | 315,900.00 | 0.50 |

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

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 | 002035 | 华帝股份 | 4,242,621.20 | 1.21 |
| 2 | 600458 | 时代新材 | 4,158,157.60 | 1.18 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 3,873,780.00 | 1.10 |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 3,377,600.00 | 0.96 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 3,122,580.00 | 0.89 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 6 | 000778 | 新兴铸管 | 3,120,282.00 | 0.89 |
| 7 | 600068 | 葛洲坝 | 3,072,311.00 | 0.87 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 3,058,602.00 | 0.87 |
| 9 | 600674 | 川投能源 | 3,040,604.85 | 0.87 |
| 10 | 600332 | 白云山 | 2,613,960.14 | 0.74 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 2,603,663.10 | 0.74 |
| 12 | 000568 | 泸州老窖 | 2,337,419.00 | 0.67 |
| 13 | 001979 | 招商蛇口 | 2,256,411.00 | 0.64 |
| 14 | 000811 | 冰轮环境 | 2,142,582.00 | 0.61 |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 2,054,600.90 | 0.58 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 2,042,891.00 | 0.58 |
| 17 | 002475 | 立讯精密 | 1,993,509.06 | 0.57 |
| 18 | 000069 | 华侨城 A | 1,883,072.00 | 0.54 |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 1,764,911.00 | 0.50 |
| 20 | 600166 | 福田汽车 | 1,744,290.00 | 0.50 |

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。

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

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 | 000651 | 格力电器 | 5,644,796.09 | 1.61 |
| 2 | 002035 | 华帝股份 | 4,277,845.40 | 1.22 |
| 3 | 000778 | 新兴铸管 | 4,104,429.80 | 1.17 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 3,496,671.48 | 0.99 |
| 5 | 600458 | 时代新材 | 3,496,608.20 | 0.99 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 3,485,584.56 | 0.99 |
| 7 | 600028 | 中国石化 | 3,301,400.00 | 0.94 |
| 8 | 600674 | 川投能源 | 3,242,389.00 | 0.92 |
| 9 | 601688 | 华泰证券 | 3,233,626.42 | 0.92 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 3,129,257.86 | 0.89 |
| 11 | 600068 | 葛洲坝 | 3,070,872.71 | 0.87 |
| 12 | 000568 | 泸州老窖 | 2,703,460.00 | 0.77 |
| 13 | 600332 | 白云山 | 2,491,486.49 | 0.71 |
| 14 | 000858 | 五粮液 | 2,185,988.50 | 0.62 |
| 15 | 000811 | 冰轮环境 | 2,150,036.40 | 0.61 |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 2,108,946.00 | 0.60 |
| 17 | 001979 | 招商蛇口 | 2,071,486.46 | 0.59 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 18 | 300450 | 先导智能 | 1,909,922.96 | 0.54 |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 1,822,844.52 | 0.52 |
| 20 | 000069 | 华侨城 A | 1,696,061.00 | 0.48 |

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。

8.4.3 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 | 74,131,204.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 79,266,863.75 |

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。

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 | 29,482,662.10 | 46.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 21,540,462.10 | 33.80 |
| 4 | 企业债券 | 23,835,001.80 | 37.41 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 83,240.00 | 0.13 |
| 8 | 同业存单 | 9,507,000.00 | 14.92 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 62,907,903.90 | 98.72 |

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 | 018005 | 国开 1701 | 120,010 | 11,867,788.90 | 18.62 |
| 2 | 108601 | 国开 1703 | 96,940 | 9,672,673.20 | 15.18 |
| 3 | 111799447 | 17 杭州银行 CD127 | 100,000 | 9,507,000.00 | 14.92 |
| 4 | 1380078 | 13 江门债 | 100,000 | 6,118,000.00 | 9.60 |
| 5 | 122399 | 15 中投 G1 | 60,000 | 5,952,000.00 | 9.34 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 | 30,339.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 400,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,515,404.83 |
| 5 | 应收申购款 | 4,950.37 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,950,694.27 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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

| 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 |
| 景顺长城景盈金利债券 A | 1,057 | 44,462.48 | - | - | 46,996,839.60 | 100.00% |
| 景顺长城景盈金利债券 C | 422 | 34,472.39 | - | - | 14,547,347.64 | 100.00% |
| 合计 | 1,479 | 41,612.03 | - | - | 61,544,187.24 | 100.00% |

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）。

9.2 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 | 景顺长城景盈金利债券 A | 100.88 | 0.00% |
| | 景顺长城景盈金利债券 C | 10.00 | 0.00% |
| | 合计 | 110.88 | 0.00% |

注：分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

| 项目 | 景顺长城景盈金利债券 A | 景顺长城景盈金利债券 C |
|--------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 20 日）基金份额总额 | 339,757,996.77 | 332,832,283.23 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 264,961,653.17 | 89,394,352.90 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,448,688.02 | 1,214,968.95 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 219,413,501.59 | 76,061,974.21 |
| 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 | 46,996,839.60 | 14,547,347.64 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§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：

中国农业银行股份有限公司于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

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）为第 2 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 60,000.00 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 | |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 78,947,543.20 | 51.47% | 73,521.33 | 51.47% | 未变更 |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | 74,429,165.06 | 48.53% | 69,315.70 | 48.53% | 未变更 |
| 东北证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 东兴证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 平安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 东方证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 华福证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 川财证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 恒泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 上海华信证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 国盛证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|--------|
| 天风证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 方正证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

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的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 海通证券股份有限公司 | 47,612,231.20 | 70.28% | 375,000,000.00 | 99.92% | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 20,131,487.98 | 29.72% | 300,000.00 | 0.08% | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

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

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------------------------|-----------------|
| 1 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 1 月 20 日 |
| 3 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 1 月 20 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 2 月 3 日 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-----------------|
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易“精明 i 定投”PE 区间的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 2 月 6 日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉兴银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 2 月 17 日 |
| 7 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 2 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金通过好买基金开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 10 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 22 日 |
| 10 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 22 日 |
| 11 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 24 日 |
| 12 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2016 年年度报告摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 13 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2016 年年度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 3 月 29 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 告 | | |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海云湾投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月17日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海云湾投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月17日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司基金转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月17日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月17日 |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财金融信息服务有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月21日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财金融信息服务有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月21日 |
| 21 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月24日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加武汉市伯嘉基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月26日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江南农商行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年4月27日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| | 基金转换业务的公告 | | |
| 24 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 4 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统建行直联渠道(含建行网银、建行快捷)基金交易费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 4 日 |
| 26 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 4 日 |
| 27 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳秋实惠智财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 11 日 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳秋实惠智财富投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 11 日 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在深圳市金斧子基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 5 月 31 日 |
| 30 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 6 月 2 日 |
| 31 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大河财富基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 6 月 2 日 |
| 32 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 6 月 9 日 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-----------------|
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 6 月 30 日 |
| 34 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加凤凰金信(银川)基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 1 日 |
| 35 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 1 日 |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 1 日 |
| 37 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 8 日 |
| 38 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳前海微众银行股份有限公司认购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 19 日 |
| 39 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 7 月 20 日 |
| 40 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 8 月 10 日 |
| 41 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海华夏财富投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 8 月 16 日 |
| 42 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华夏财富投资管理有限公司开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 8 月 16 日 |
| 43 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017 年 8 月 25 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | | |
| 44 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海大智慧财富管理有限公司开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年8月25日 |
| 45 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年半年度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年8月26日 |
| 46 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年8月26日 |
| 47 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发银行股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年8月29日 |
| 48 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江南农商行网上银行和手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年9月4日 |
| 49 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海汇付金融服务有限公司申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年9月8日 |
| 50 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中泰证券股份有限公司定期定额申购起点金额的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年9月13日 |
| 51 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加天津万家财富资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年9月15日 |
| 52 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天津万家财富资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年9月15日 |
| 53 | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国证券报, 上海证 | 2017年9月26日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-------------|
| | 关于旗下部分基金参加平安银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 券报, 证券时报, 基金管理人网站 | |
| 54 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加长江证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月9日 |
| 55 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京电盈基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月11日 |
| 56 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京电盈基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月11日 |
| 57 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在浦发银行开通基金“定期定额投资业务”的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月24日 |
| 58 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月25日 |
| 59 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月25日 |
| 60 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月27日 |
| 61 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年10月31日 |
| 62 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加通华财富(上海)基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月3日 |
| 63 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加喜鹊财富基金销售有限公司基金 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月3日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-------------|
| | 申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | | |
| 64 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增通华财富(上海)基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月3日 |
| 65 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月3日 |
| 66 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 2 号更新招募说明书 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月4日 |
| 67 | 景顺长城景盈金利债券型证券投资基金 2017 年第 2 号更新招募说明书摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月4日 |
| 68 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加济安财富(北京)基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月17日 |
| 69 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月17日 |
| 70 | 景顺长城基金管理有限公司关于子公司景顺长城资产管理(深圳)有限公司增加注册资本及修改《公司章程》的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年11月30日 |
| 71 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司开通基金转换业务并开展转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年12月6日 |
| 72 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金首次申购最低金额、定期定额投资最低金额和最低持有份额数 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2017年12月7日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|------------------|
| | 额限制的公告 | | |
| 73 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泰诚财富基金销售（大连）有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 20 日 |
| 74 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 21 日 |
| 75 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 21 日 |
| 76 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国国际金融股份有限公司申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 22 日 |
| 77 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 22 日 |
| 78 | 景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 23 日 |
| 79 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金转换业务并开展转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 26 日 |
| 80 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 26 日 |
| 81 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 29 日 |
| 82 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 29 日 |
| 83 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金申购、定期定额投资及基金组合产品申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 29 日 |

| | | | |
|----|------------------------------|--------------------------|------------------|
| 84 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 29 日 |
| 85 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下产品执行增值税政策的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2017 年 12 月 30 日 |

§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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景盈金利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景盈金利债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2018年3月28日