

# 景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 20 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 17 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
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 .....	18
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	18
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 .....	18
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 .....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	23
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	44

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	45
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 .....	45
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
8.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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情况 .....	47
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4 基金投资策略的改变 .....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
11.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	62
13.3 查阅方式 .....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金
基金简称	景顺长城鑫月薪定期支付债券
场内简称	无
基金主代码	000465
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 20 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	525,137,081.30 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>本产品的主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、类属配置策略、期限结构策略及证券选择策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现组合资产的增值。</p> <p>1、资产配置策略：本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、期限配置策略：为合理控制本基金自由开放期的流动性风险，并满足每次自由开放期的流动性需求，本基金在每个运作周期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金剩余运作周期进行适当的匹配。</p> <p>3、期限结构策略：收益率曲线形状变化的主要影响因素是宏观经济基本面以及货币政策，而投资者的期限偏好以及各期限的债券供给分布对收益率形状有一定影响。对收益率曲线的分析采取定性和定量相结合的方法。</p> <p>4、债券类属资产配置：基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、可分离交易可转债的纯债部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>5、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p>
业绩比较基准	同期六个月定期存款利率（税后）+ 1.7%

风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
--------	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95588
传真	0755-22381339	(010) 66105798
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	丁益	陈四清

### 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
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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	21,450,473.68	9,421,553.84	7,705,670.11
本期利润	13,860,660.38	19,318,787.96	7,363,973.42
加权平均基金份额本期利润	0.0423	0.0692	0.0273
本期加权平均净值	4.13%	6.84%	2.68%

利润率			
本期基金份额净值增长率	4.09%	4.88%	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	129,576,943.81	121,271,104.99	36,230,077.38
期末可供分配基金份额利润	0.2467	0.1860	0.1714
期末基金资产净值	528,040,088.73	667,656,814.00	212,852,601.85
期末基金份额净值	1.006	1.024	1.007
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	32.64%	27.44%	21.50%

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

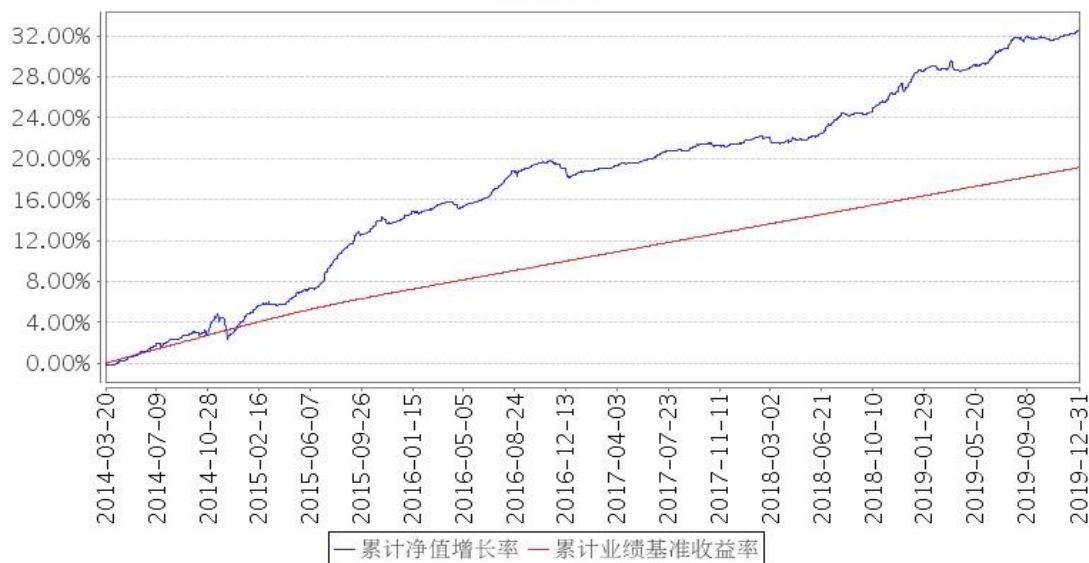
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.74%	0.04%	0.64%	0.01%	0.10%	0.03%

过去六个月	1.99%	0.06%	1.29%	0.01%	0.70%	0.05%
过去一年	4.09%	0.07%	2.58%	0.01%	1.51%	0.06%
过去三年	12.01%	0.06%	8.17%	0.01%	3.84%	0.05%
过去五年	27.91%	0.07%	15.09%	0.01%	12.82%	0.06%
自基金合同生效起至今	32.64%	0.08%	19.14%	0.01%	13.50%	0.07%

### 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

景顺长城鑫月薪定期支付债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

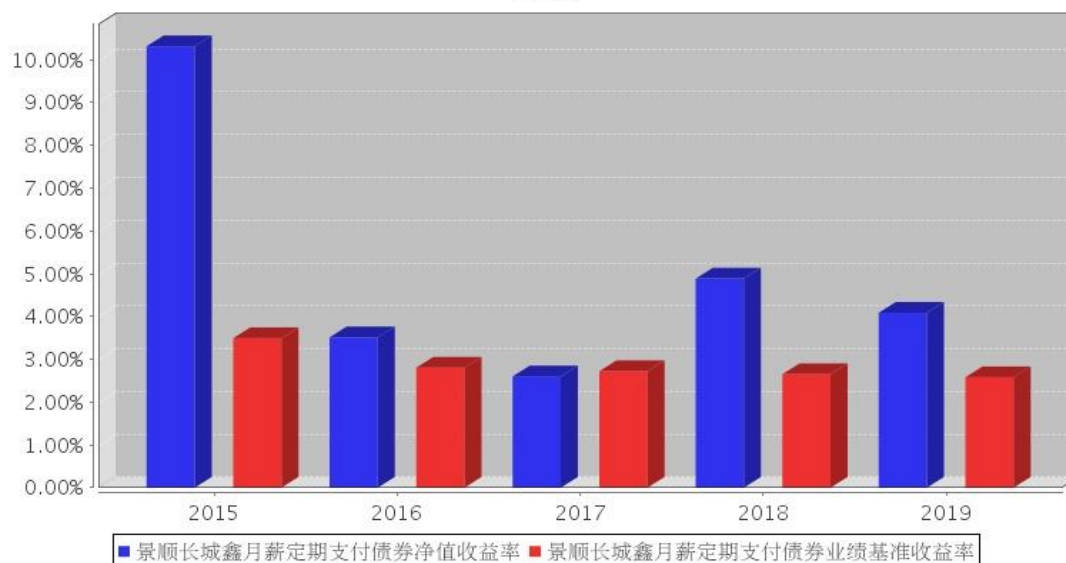


注:本基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于80%,在每个受限开放期的前10个工作日和后10个工作日、自由开放期的前2个月和后2个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制,但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2014年3月20日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。



### 3.2.3 过去五年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

景顺长城鑫月薪定期支付债券基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金在存续期内不进行利润分配。

## §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2019年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理83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(QDII)、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、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 TMT150 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、景顺长城政策性金融债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、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定

期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
袁媛	本基金的基金经理、固定收益部投资副总监	2014 年 6 月 10 日	-	12	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 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部投资副总监兼基金经理。

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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害

基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，风险管理及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

本报告期内, 本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 77 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。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为和银行间债券 5 日内反向交易, 但结合交易时机及市场交易价格波动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。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易, 经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为, 非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2019 年以来国内外经济金融环境复杂且多变。回顾 2019 年, 中国宏观经济继续处于长周期的筑底过程之中, 实际 GDP 增速由 2018 年的 6.7% 进一步回落至 6.1%。其中 2019 年 3 季度, 中国经济增速降至 6% 的 30 年新低。而与此同时, 经济转型持续推进, 投资对于 GDP 增速的贡献率持续下降, 消费的支撑作用愈发明显, 占 GDP 的比重和对经济增长的贡献都在一半以上。中国经济正处于“三期叠加”的背景下经济增速承压, 全球经济也面临下行压力, 中美贸易摩擦的不断升级几乎主导了 2019 年中国宏观经济运行的节奏, 而这一外部冲击对于中国经济的影响并不局限于

进出口，事实上已外溢到了制造业投资以及消费等方方面面，而随着四季度中美贸易摩擦出现阶段性缓和，整体经济逐渐出现了一定企稳迹象。

2019 年宏观经济运行数据呈现出季初较弱而季末偏强的季末效应。数据来看，投资方面，2019 年，中国投资增速约为 5.2%，在 09 年以后已经连续 10 年下滑。但投资整体较为平稳，得益于房地产投资全年保持高度韧性，增速长时间维持在 10%左右。消费方面，2019 年社会消费品零售总额增速约为 8%，这一增速创下 2000 年以来新低。其中，必选消费增速非常稳定，真正导致近两年消费下滑主因是可选消费增速大幅下滑，尤其是汽车消费连续两年出现负增长。进出口方面，2019 年我国出口出现小幅负增长。主要源于中美贸易摩擦，我国对美国出口大幅下降了 12%。剔除对美贸易后，出口增长 2%左右，反映全球经济仍保持 2-3%正增长，我国出口竞争力保持稳定。

通胀方面，2019 年 CPI 达到 2.9%，创下近 8 年新高。尤其是年末 12 月 CPI 达到 4.5%，已远超 3%的政策目标。过去 1 年通胀上升主要由食品价格所贡献。19 年 CPI 食品价格涨幅高达 9.3%，其中猪肉价格上涨 42.5%，对 CPI 上涨贡献达到 1%-1.5%。而剔除掉猪肉以后的其他消费物价涨幅平稳，非食品价格涨幅只有 1.4%。与非食品价格回升相呼应的，是 PPI 降幅的大幅缩窄。10 月 PPI 同比下降 1.6%，而 12 月 PPI 同比仅下降 0.5%。PPI 以及 CPI 非食品价格的回升，源于 4 季度以来经济短期改善。

在内外下行压力的威胁之下，逆周期调节政策意图推动宽货币向宽信用传导。在 19 年央行实施了 LPR 贷款利率改革，标志着我国的基准利率正式转向了公开市场操作利率。而在 19 年 11 月，央行下调逆回购、MLF 等操作利率各 5bp，也意味着货币政策取向偏松。但从最终结果来看，逆周期调节政策在 2019 年并未起到预期的成效，经济下滑幅度仍进一步加大。虽然去杠杆工作已取得阶段性成果而执行力度有所减弱，从去杠杆转向稳杠杆。但防范化解系统性风险仍对于房地产、地方政府融资等形成各类明显约束，而减税降费进一步削弱了通过财政支出推动基建投资的能力，专项债实际投向基建比例相对较低也导致基建投资始终未见明显起色。在货币政策方面，在二季度防范经济过热而收紧之后，在下半年再度边际转向友好，在“结构性”通胀的环境下，货币政策并未受到过多制约，灵活适度的货币政策仅对通胀预期的扩散保持关注，LPR 改革进一步疏通政策传导机制，以求实现稳增长、降成本的目标，政策呵护之下四季度以来货币金融数据在增量、结构等方面均持续向好。

从债券收益率表现看，2019 年债市呈现出“小牛”特征，成为史上最小波动年份。2003 年以来的十七年，和今年波幅较接近的是 2016 年（19BP），2012 年（15BP）和 2006 年（-9BP）。而上述三年均是转折年份，接下来的第二年 10 年期国债收益率变动幅度明显加大。目前 10 年期国债收益率绝对水平靠近历史 1/4 分位数，处于偏低水平。全年看 10 年期国债和国开债的收益率分别

下行 9BP 和 7BP 至 3.14% 和 3.58%。信用方面，信用利差明显缩窄，且等级越低缩窄越明显。以 5 年中债估值曲线来看，5 年 AAA、AA+、AA 和 AA- 品种信用利差分别下行 34BP、34BP、61BP 和 63BP。历史对比来看，目前 AA- 曲线以外的信用利差，均处于历史 1/4 分位数以下。特别是 AAA 曲线的信用利差，已经非常靠近历史最小值（2016 年）。高收益城投债有明显的超额收益。AA- 曲线来看，2019 年城投债品种收益率下行幅度远超中票。而 AA 及以上品种，城投债和中票收益率下行幅度较接近。3 年期 AA+ 中票、5 年期 AA+ 中票、1 年 AAA 短融分别下行 50BP、34BP 和 41BP 至 3.55%、4.01% 和 3.18%。

组合操作方面，组合主要以持有中短期中高等级信用债为主，鉴于货币政策宽松延续和资金面稳定且资金利率较低，积极运用杠杆策略。尤其在年末资金面走紧时点。全年在对经济数据进行预判和市场分析基础上，在收益率下行机会相对确定性时点对中长期利率债进行了两波灵活的波段操作。全年迎来两次开放期，近开放期时保持组合一定流动性应对赎回。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年度，本基金份额净值增长率为 4.09%，业绩比较基准收益率为 2.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年宏观经济运行，毫无疑问新冠肺炎疫情打断了去年四季度开始所逐步出现的企稳迹象，疫情对于消费、工业生产、投资等均造成了短期的负面影响，目前来看仍无法完全确定疫情拐点出现的时点，但预计疫情难以对中长期经济发展趋势形成实质性影响。2020 年作为“十三五”规划的收官之年，“翻番”要求仍是硬约束。预计疫情将使一季度 GDP 增速大幅回落，但在下半年，部分行业的补偿性增长叠加逆周期政策调节，经济增速有可能反弹至 6.0% 以上区间。

虽然四经普对于此前年份增速的修正降低了 2020 年的增长压力，但 5.6-5.8% 的增速下限仍决定了逆周期调节政策不可缺位，特别是在未来 1-2 个季度内经济增速因疫情承压，稳就业压力继续增大，将倒逼货币与财政政策提前发力，而目前无论是地方政府债额度顶格提前下发，还是开年以来“降息降准”，均验证了该判断。剔除疫情的短期影响，预计投资呈现更多逆周期特征，“因城施策”下房地产投资韧性预计将持续，基建投资在二季度起明显发力。工业生产短期面临“停工长”和“复工难”，预计一季度将明显承压，从目前走势估计，3 月前半月延续修复、后半月出现一定赶工，全年工业增加值仍能保持一定增速水平。多方发力以保证能够完成全面建成小康社会的 GDP 翻番目标。

财政政策方面，此前，准财政工具已经在创新支持疫情防控；往后看，财政政策大力提质增效。虽然全年赤字率大概率为 3%，但是有望通过扩大 PSL、压缩一般开支为小微企业减税、完善专项债使用、加大贴息力度等多种方式，稳定经济增长。制造业投资在贸易摩擦阶段性缓和背景

下有望得到边际修复。货币政策方面，稳健货币政策保持灵活适度，积极维护市场流动性合理充裕，宽货币有望继续逐步向宽信用传导，节后先后降低 OMO 利率及 MLF 利率，并提供再贷款支持，体现了货币政策的“前倾”，预计全年仍有降准空间，LPR 利率将下降 30-45 个基点。利率层面，存款基准利率有望下调，进一步帮助降低实体融资成本。

通胀方面，CPI 中枢小幅上行，PPI 仍在正值区间。预计年内猪价高点后移，非食品整体保持低迷。由于疫情对物流等因素的限制，食品供给相对短缺，导致食品价格短期出现上行压力。疫情结束后食品价格将逐步回归正常季节性波动。经济下行压力下，其对资本价格影响相对有限，且今年政府或将通胀目标定在 3.5% 左右，实际 CPI 上涨仍在可控范围内。预计工业品价格短期承压，全年均值仍在正值区间，疫情对工业品价格仅存在短期影响，基本体现在一季度。

债券方面，预计固定收益类资产的中长期回报将继续下降，但考虑到名义增速受到价格因素支撑将保持基本稳定，2020 年无风险利率可能维持震荡，遇通胀高点、专项债集中发行等时点冲击存在波段交易机会。新冠疫情的发生及走势或给出了今年最大的交易机会。货币政策仍会引导融资成本下行，机会更多存在于预期差。操作上如遇数据变差收益率急下可兑现收益，遇事件冲击大幅调整可加仓波段交易。信用债方面，目前绝对收益已下行到历史低位，AAA 各期限品种距离近 10 年低点约 30BP，级别利差中仅 5 年 AA 品种与同期限 AAA 和 AA+ 品种仍处于历史中分位。但考虑到信用风险仍高发，难以做过多资质下沉，下沉首选城投债。伺机置换持仓中收益率已较低品种，寻找骑乘效应。

组合操作计划上，债券市场有基本面支撑，重点在节奏的把握，组合计划以中短久期信用债套息为主，中长端利率债择机波段操作。较宽松的货币环境使得杠杆效应仍可行，可通过中高等级品种阶段性提高杠杆，积极寻找性价比较高的 AA+ 信用债券。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。

#### 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、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债金融估值中心有限公司、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

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

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

本报告期内，景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金

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

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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 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(2020)第 21499 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	景顺长城鑫月薪定期支付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鑫月薪定期支付债券型证券投资基金(以下简称“景顺长城鑫月薪基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 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鑫月薪基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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鑫月薪基金，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>景顺长城鑫月薪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、</p>

	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估景顺长城鑫月薪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鑫月薪基金、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鑫月薪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，就可能对景顺长城鑫月薪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鑫月薪基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，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	单峰   陈薇瑶
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2020 年 04 月 17 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	783,097.18	908,028.88
结算备付金		-	2,494,710.10
存出保证金		2,497.17	7,395.49
交易性金融资产	7.4.7.2	708,085,249.00	873,041,360.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		708,085,249.00	873,041,360.70
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	39,900,259.85	-
应收证券清算款		-	4,462,912.70
应收利息	7.4.7.5	10,275,701.11	15,902,156.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		759,046,804.31	896,816,564.68
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		230,454,883.29	223,647,659.00
应付证券清算款		175.06	4,525,186.96
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		268,457.14	341,469.58
应付托管费		89,485.71	113,823.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	26,482.26	19,517.17
应交税费		63,054.60	63,638.76
应付利息		35,177.52	94,456.02

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	69,000.00	354,000.00
负债合计		231,006,715.58	229,159,750.68
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	398,463,144.92	523,659,722.31
未分配利润	7.4.7.10	129,576,943.81	143,997,091.69
所有者权益合计		528,040,088.73	667,656,814.00
负债和所有者权益总计		759,046,804.31	896,816,564.68

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.006 元，基金份额总额 525,137,081.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		19,250,471.12	25,110,170.77
1. 利息收入		15,635,648.45	15,045,387.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	51,698.28	124,500.47
债券利息收入		15,265,797.07	14,542,105.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		318,153.10	378,782.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,168,076.19	137,163.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,168,076.19	137,163.34
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	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-7,589,813.30	9,897,234.12
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	36,559.78	30,385.59

减：二、费用		5,389,810.74	5,791,382.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,022,974.48	1,717,881.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	674,324.71	572,627.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,723.40	17,153.74
5. 利息支出		2,381,389.74	3,045,352.69
其中：卖出回购金融资产支出		2,381,389.74	3,045,352.69
6. 税金及附加		40,712.88	38,127.03
7. 其他费用	7.4.7.19	247,685.53	400,240.17
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,860,660.38	19,318,787.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,860,660.38	19,318,787.96

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	523,659,722.31	143,997,091.69	667,656,814.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,860,660.38	13,860,660.38
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)	-125,196,577.39	-28,280,808.26	-153,477,385.65
其中：1. 基金申购款	353,365,931.44	111,471,449.69	464,837,381.13
2. 基金赎回款	-478,562,508.83	-139,752,257.95	-618,314,766.78
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)	398,463,144.92	129,576,943.81	528,040,088.73
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	175,131,846.55	37,720,755.30	212,852,601.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,318,787.96	19,318,787.96
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)	348,527,875.76	86,957,548.43	435,485,424.19
其中：1. 基金申购款	482,658,225.63	117,314,546.46	599,972,772.09
2. 基金赎回款	-134,130,349.87	-30,356,998.03	-164,487,347.90
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(基金净值)	523,659,722.31	143,997,091.69	667,656,814.00

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

景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 1473 号《关于核准景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金募集的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券



投资基金法》和《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金，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 227,404,003.42 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(2014)第 150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 227,428,917.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 24,914.05 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金的业绩比较基准为：同期六个月定期存款利率(税后)+1.70%。

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)六个月的期间。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申购、赎回申请。此外基金管理人于每一运作周期内每个日历月末最后一个工作日进行份额支付(基金合同生效不满一个月的，当月不进行份额支付)。基金管理人将按确定的份额支付基数计算出投资人每日日历月末应当支付的资产金额，并反算出所对应的基金份额，进行份额支付。份额支付后，登记机构将相应调减投资人所持有的基金份额。在每个运作周期结束后进入自由开放期。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 4 月 17 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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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。

### 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债券投资和资产支持证券投资为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期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

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。在折算基准日日终，本基金的基金份额净值将调整为 1.000 元。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。

#### 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

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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资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，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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和托管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

本基金存续期内不进行收益分配。

#### 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债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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债金融估值中心有限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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、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》、财税[2017]2

号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	783,097.18	908,028.88
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月至 1 年	-	-
存款期限 1 年以上	-	-
其他存款	-	-
合计	783,097.18	908,028.88

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	53,789,856.48	53,912,409.00	122,552.52
	银行间市场	653,172,838.12	654,172,840.00	1,000,001.88
	合计	706,962,694.60	708,085,249.00	1,122,554.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		706,962,694.60	708,085,249.00	1,122,554.40
项目	上年度末 2018年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	200,894,970.07	201,660,360.70	765,390.63
	银行间市场	663,434,022.93	671,381,000.00	7,946,977.07
	合计	864,328,993.00	873,041,360.70	8,712,367.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		864,328,993.00	873,041,360.70	8,712,367.70

#### 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 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	39,900,259.85	-
合计	39,900,259.85	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	294.53	1,214.24
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	-	1,122.60
应收债券利息	10,220,143.55	15,899,816.67
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	55,261.83	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1.20	3.30
合计	10,275,701.11	15,902,156.81

## 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	26,482.26	19,517.17
合计	26,482.26	19,517.17

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	69,000.00	354,000.00
合计	69,000.00	354,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	651,858,413.65	523,659,722.31
本期申购	24,360,078.00	19,585,243.73
本期赎回（以“-”号填列）	-546,596,652.93	-439,051,242.45



2019年10月10日 基金拆分/ 份额折算前	129,621,838.72	104,193,723.59
基金拆分/份额折算调整	7,714,187.23	-
本期申购	439,862,125.11	333,780,687.71
本期赎回（以“-”号填列）	-52,061,069.76	-39,511,266.38
本期末	525,137,081.30	398,463,144.92

注:1. 根据《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》及《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定,本基金仅能在受限开放期和自由开放期办理申购或赎回业务;2019年7月15日为受限开放期,2019年3月22日至2019年4月12日、2019年10月14日至2019年10月25日为自由开放期,本报告期内其他时间封闭运作。

2. 根据《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金招募说明书》和《关于景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司确定2019年10月10日为本基金的基金份额折算日。折算前基金份额净值为1.060元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为1.05951302,折算后基金份额净值为1.000元。景顺长城基金管理有限公司已根据上述折算比例,对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算,并于2019年10月11日进行了变更登记。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位:人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	121,271,104.99	22,725,986.70	143,997,091.69
本期利润	21,450,473.68	-7,589,813.30	13,860,660.38
本期基金份额交易产生的变动数	-12,786,129.75	-15,494,678.51	-28,280,808.26
其中:基金申购款	111,855,153.81	-383,704.12	111,471,449.69
基金赎回款	-124,641,283.56	-15,110,974.39	-139,752,257.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,935,448.92	-358,505.11	129,576,943.81

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	28,173.01	28,227.16
定期存款利息收入	-	88,888.86
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	23,391.98	7,321.69
其他	133.29	62.76
合计	51,698.28	124,500.47

**7.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,225,342,132.20	623,283,584.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,189,100,085.45	610,047,280.38
减：应收利息总额	25,073,970.56	13,099,140.79
买卖债券差价收入	11,168,076.19	137,163.34

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,589,813.30	9,897,234.12
股票投资	-	-
债券投资	-7,589,813.30	9,897,234.12
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-7,589,813.30	9,897,234.12

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日

基金赎回费收入	36,559.78	30,385.59
合计	36,559.78	30,385.59

注：在自由开放期内赎回基金，本基金不收取赎回费，在受限开放期赎回本基金，本基金收取赎回费，赎回费率为1%，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	1,944.90	1,713.84
银行间市场交易费用	20,778.50	15,439.90
合计	22,723.40	17,153.74

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	60,000.00	65,000.00
信息披露费	120,000.00	280,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行划款手续费	30,485.53	18,040.17
合计	247,685.53	400,240.17

### 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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。

## 7.4.10 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

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。

#### 7.4.10.1.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

### 7.4.10.2 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 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,022,974.48	1,717,881.90
其中：支付销售机构的客户维护费	1,199,918.17	1,044,427.67

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 × 0.60% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	674,324.71	572,627.28

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	69,777,778.94	13.29	-	-

#### 7.4.10.6 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
中国工商银行	783,097.18	28,173.01	908,028.88	28,227.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末(2019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 2019 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 199, 254, 883. 29 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
101901298	19 国电 MTN003	2020 年 1 月 2 日	100. 39	105, 000	10, 540, 950. 00
180211	18 国开 11	2020 年 1 月 2 日	102. 26	126, 000	12, 884, 760. 00
011902818	19 广州地 铁 SCP004	2020 年 1 月 3 日	99. 50	100, 000	9, 950, 000. 00
041900324	19 中石油 CP001	2020 年 1 月 3 日	99. 98	500, 000	49, 990, 000. 00
041900368	19 九江城 投 CP001	2020 年 1 月 3 日	100. 23	115, 000	11, 526, 450. 00
101556022	15 豫高管 MTN001	2020 年 1 月 3 日	101. 18	100, 000	10, 118, 000. 00
101669005	16 海淀国 资 MTN001	2020 年 1 月 3 日	100. 75	100, 000	10, 075, 000. 00
101800492	18 广核电 力 MTN002	2020 年 1 月 3 日	102. 48	100, 000	10, 248, 000. 00
101800772	18 亦庄控 股 MTN001	2020 年 1 月 3 日	102. 38	200, 000	20, 476, 000. 00
101900002	19 建发地 产 MTN001	2020 年 1 月 3 日	102. 17	200, 000	20, 434, 000. 00
101900113	19 中油股 MTN001	2020 年 1 月 3 日	101. 01	300, 000	30, 303, 000. 00
101900487	19 国电 MTN002	2020 年 1 月 3 日	101. 42	12, 000	1, 217, 040. 00
101900686	19 中电投 MTN007	2020 年 1 月 3 日	101. 54	200, 000	20, 308, 000. 00
101901004	19 亦庄控 股 MTN001	2020 年 1 月 3 日	100. 61	100, 000	10, 061, 000. 00
101901321	19 汇金 MTN015	2020 年 1 月 3 日	99. 78	200, 000	19, 956, 000. 00
合计				2, 458, 000	248, 088, 200. 00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2019 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 31, 200, 000. 00 元, 截至 2020 年 1 月 3 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

##### 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 129.63%（上年末：92.34%）。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 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组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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该比例限制）。

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对其管理的所有开放式基金于开放期内，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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	783,097.18	-	-	-	-	-	783,097.18
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	2,497.17	-	-	-	-	-	2,497.17
交易性金融资产	10,145,000.00	1,809.00	238,207,600.00	449,832,840.00	9,898,000.00	-	708,085,249.00
买入返售金融资产	39,900,259.85	-	-	-	-	-	39,900,259.85
应收利息	-	-	-	-	-	10,275,701.11	10,275,701.11
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-0.00	-0.00
资产总计	50,830,854.20	1,809.00	238,207,600.00	449,832,840.00	9,898,000.00	10,275,701.11	759,046,804.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	268,457.14	268,457.14
应付托管费	-	-	-	-	-	89,485.71	89,485.71
应付证券清算款	-	-	-	-	-	175.06	175.06
卖出回购金融资产款	230,454,883.29	-	-	-	-	-	230,454,883.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	26,482.26	26,482.26

应付利息	-	-	-	-	-	35,177.52	35,177.52
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	63,054.60	63,054.60
其他负债	-	-	-	-	-	69,000.00	69,000.00
负债总计	230,454,883.29	-	-	-	-	551,832.29	231,006,715.58
利率敏感度缺口	-179,624,029.09	1,809.00	238,207,600.00	449,832,840.00	9,898,000.00	-	-
上年度末 2018 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	908,028.88	-	-	-	-	-	908,028.88
结算备付金	2,494,710.10	-	-	-	-	-	2,494,710.10
存出保证金	7,395.49	-	-	-	-	-	7,395.49
交易性金融资产	10,222,925.00	60,256,000.00	70,194,888.00	578,598,547.70	153,769,000.00	-	873,041,360.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,462,912.70	4,462,912.70
应收利息	-	-	-	-	-	15,902,156.81	15,902,156.81
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,633,059.47	60,256,000.00	70,194,888.00	578,598,547.70	153,769,000.00	20,365,069.51	896,816,564.68
负债							
卖出回购金融资产款	223,647,659.00	-	-	-	-	-	223,647,659.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	341,469.58	341,469.58
应付托管费	-	-	-	-	-	113,823.19	113,823.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	19,517.17	19,517.17
应付利息	-	-	-	-	-	94,456.02	94,456.02
应交税费	-	-	-	-	-	63,638.76	63,638.76
其他负债	-	-	-	-	-	354,000.00	354,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,525,186.96	4,525,186.96
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	223,647,659.00	-	-	-	-	5,512,091.68	229,159,750.68
利率敏感度缺口	-210,014,599.53	60,256,000.00	70,194,888.00	578,598,547.70	153,769,000.00	-	-

## 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	
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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）

分析	市场利率上升 25 个基点	-2, 782, 173. 31	-6, 362, 365. 23
	市场利率下降 25 个基点	2, 804, 884. 13	6, 455, 884. 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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 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 2019 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 708, 085, 249. 00 元，无属于第一或第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：第二层次 873, 041, 360. 70 元，无第一或第三层次）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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(2018 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	708,085,249.00	93.29
	其中：债券	708,085,249.00	93.29
	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	39,900,259.85	5.26
	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	783,097.18	0.10
8	其他各项资产	10,278,198.28	1.35
9	合计	759,046,804.31	100.00

### 8.2 报告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所有股票投资明细

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	33,663,840.00	6.38
	其中：政策性金融债	23,600,840.00	4.47
4	企业债券	77,899,409.00	14.75
5	企业短期融资券	119,973,000.00	22.72
6	中期票据	476,549,000.00	90.25
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	708,085,249.00	134.10

### 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	041900324	19 中石油 CP001	500,000	49,990,000.00	9.47
2	101801363	18 朝阳国资 MTN002	400,000	40,460,000.00	7.66
3	101800823	18 广州地铁 MTN004	300,000	30,420,000.00	5.76
4	101772007	17 鲁高速 MTN001	300,000	30,390,000.00	5.76
5	101900113	19 中油股 MTN001	300,000	30,303,000.00	5.74

**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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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	2,497.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,275,701.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,278,198.28

**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。

**8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§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 (%)
24,216	21,685.54	103,568,726.75	19.72	421,568,354.55	80.28

**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	2,989.72	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 (2014 年 3 月 20 日) 基金份额总额	227,428,917.47
本报告期期初基金份额总额	651,858,413.65
本报告期基金总申购份额	464,222,203.11
减：本报告期基金总赎回份额	598,657,722.69
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少 以“-”填列)	7,714,187.23
本报告期期末基金份额总额	525,137,081.30

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

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 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，聘任李黎女士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。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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）为第 6 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	
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	本期新增
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
平安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信方正证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

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
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	109,417,072.78	41.81%	47,384,000.00	2.39%	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券 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	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞信方正 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
招商证券股份有限公司						
中国国际金融股份有限公司						
中国银河证券股份有限公司						
中信建投证券股份有限公司	152,289,563.45	58.19%	1,936,400,000.00	97.61%		
中信证券股份有限公司						

### 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	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-02
2	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-21
3	景顺长城基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-01-30
4	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-01
5	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-01
6	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-02-23
7	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-01
8	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 3 月 22 日至 2019 年 4 月 12 日第九个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-18
9	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券	中国证券报、基金管理	2019-03-18

	投资基金关于确定第十个运作周期份额支付基准及第十次受限开放期净赎回最大比例的公告	人网站、证监会基金电子披露网站	
10	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 3 月 22 日至 2019 年 4 月 12 日第九个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-19
11	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于确定第十个运作周期份额支付基准及第十次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-19
12	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-20
13	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 3 月 22 日至 2019 年 4 月 12 日第九个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-20
14	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于确定第十个运作周期份额支付基准及第十次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-20
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-22
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-22
17	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-26
18	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2018 年年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-03-26
19	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-01
20	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-01
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、基金管理	2019-04-01

	部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	人网站、证监会基金电子披露网站	
22	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-03
23	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-04
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-04
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-04
26	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-08
27	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-11
28	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-16
29	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-20
30	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-30
31	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-04-30
32	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-06
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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-09
34	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-13
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、基金管理	2019-05-16

	部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	人网站、证监会基金电子披露网站	
36	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-05-20
37	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-03
38	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-04
39	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-15
40	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-25
41	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-06-26
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券等多家销售机构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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-01
43	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-01
44	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-05
45	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-09
46	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金第十次受限开放期业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-10
47	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金第十次受限开放期业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-11
48	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金第十次受限开放期业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-12
49	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券	中国证券报、基金管理	2019-07-17



	投资基金 2019 年第 2 季度报告	人网站、证监会基金电子披露网站	
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司认/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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-07-18
51	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-01
52	景顺长城基金管理有限公司澄清公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-06
53	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-12
54	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-16
55	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-17
56	景顺长城基金管理有限公司关于提醒直销网上交易系统个人投资者及时上传身份证件影印件并完善、更新身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-19
57	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年半年度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-23
58	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-23
59	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海陆享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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-28
60	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-28
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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-08-30
62	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2019-08-31

		子披露网站	
63	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-03
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加江苏汇林保大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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-05
65	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-05
66	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加联储证券有限责任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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-12
67	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务和基金转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-12
68	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国农业银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-09-20
69	关于景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额折算方案的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-08
70	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-08
71	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 10 月 14 日至 2019 年 10 月 25 日第十个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-09
72	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于确定第十一个运作周期份额支付基准及第十一次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-09
73	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 10 月 14 日至 2019 年 10 月 25 日第十个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-10
74	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于确定第十一个运作周期	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电	2019-10-10

	份额支付基准及第十一次受限开放期净赎回最大比例的公告	子披露网站	
75	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于 2019 年 10 月 14 日至 2019 年 10 月 25 日第十个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-11
76	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金关于确定第十一个运作周期份额支付基准及第十一次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-11
77	关于景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额折算结果的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-12
78	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-22
79	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-22
80	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-10-31
81	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-01
82	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
83	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
84	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
85	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金托管协议	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
86	关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-05
87	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳富济基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-28

	率优惠活动的公告		
88	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额支付公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-11-30
89	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-03
90	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
91	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-05
92	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-12
93	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-13
94	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、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2019-12-24

## §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	20190328-20191016	33,113,151.55	1,910,140.72	1,232,344.46	33,790,947.81	6.43
	2	20191017-20191021	-	69,999,000.00	221,221.06	69,777,778.94	13.29
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**

根据中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 80 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议中与“信息披露”相关的条款进行了修订。修订后的基金合同、托管协议已于 2019 年 11 月 5 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2019 年 11 月 5 日发布的《关于景顺长城基金管理有限公司旗下 80 只基金修改基金合同、托管协议并更新招募说明书的提示性公告》。

**§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鑫月薪定期支付债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城鑫月薪定期支付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

2020 年 4 月 20 日