

# 景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 25 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	35
7.7 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.....	36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	38
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>44</b>
12.1 备查文件目录 .....	44
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	景顺长城四季金利纯债债券	
场内简称	无	
基金主代码	000181	
交易代码	000181	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 7 月 30 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,557,978.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	景顺长城四季金利纯债债券 A 类	景顺长城四季金利纯债债券 C 类
下属分级基金的交易代码:	000181	000182
报告期末下属分级基金的份额总额	50,574,265.30 份	27,983,712.78 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金运用自上而下的宏观分析和自下而上的市场分析相结合的方法实现大类资产配置，把握不同的经济发展阶段各类资产的投资机会，根据宏观经济、基准利率水平等因素，预测债券类、货币类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、债券类属资产配置</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分离交易可转债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>3、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p>
业绩比较基准	中证综合债券指数。
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	杨崑阳	李芳菲
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	lifangfei@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九层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		赵如冰	蒋超良

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	景顺长城四季金利纯债债券 A 类	景顺长城四季金利纯债债券 C 类
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,964,647.43	1,050,003.89
本期利润	5,502,617.50	1,458,389.81
加权平均基金份额本期利润	0.0522	0.0518
本期加权平均净值利润率	5.12%	5.08%
本期基金份额净值增长率	5.72%	5.52%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2014 年 6 月 30 日 )	
期末可供分配利润	1,864,681.08	971,780.41
期末可供分配基金份额利润	0.0369	0.0347
期末基金资产净值	53,104,076.13	29,322,995.60
期末基金份额净值	1.050	1.048
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2014 年 6 月 30 日 )	
基金份额累计净值增长率	7.30%	6.89%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

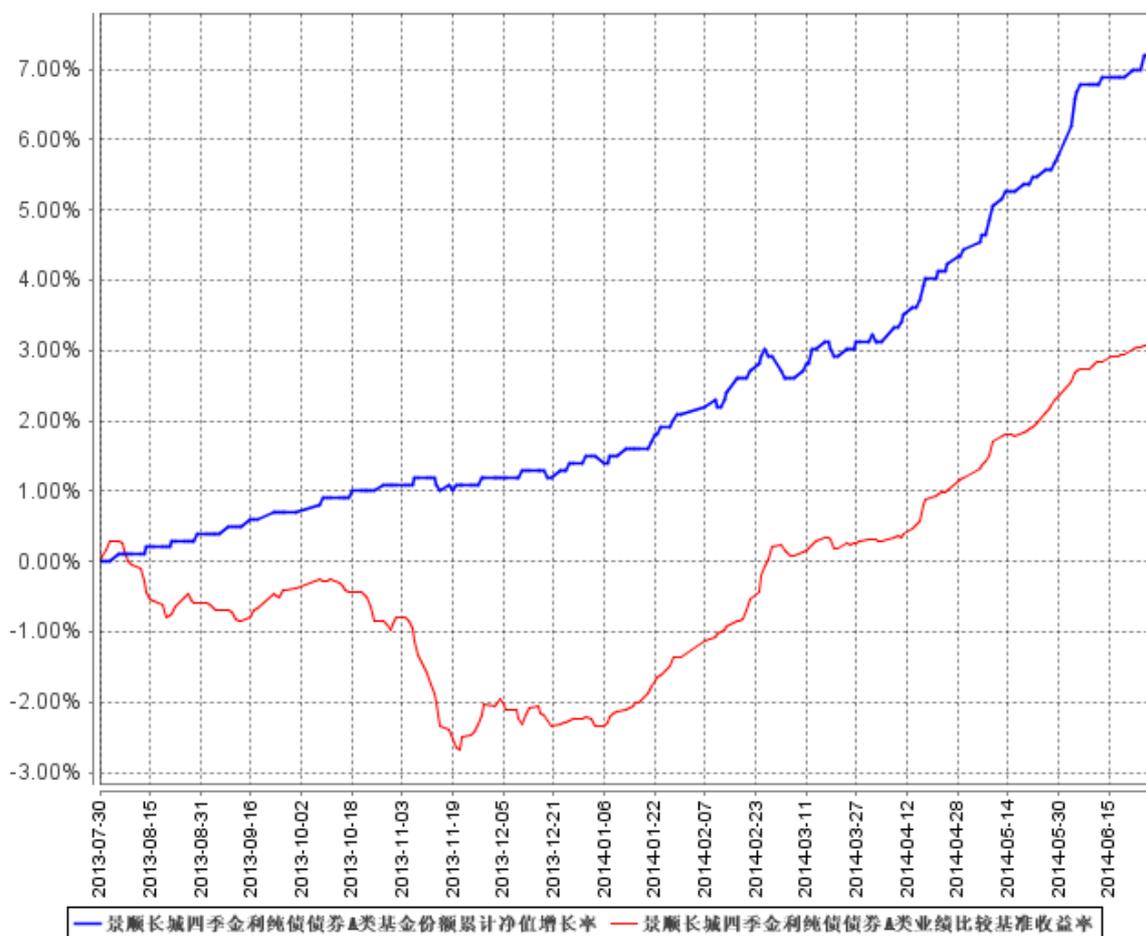
景顺长城四季金利纯债债券 A 类

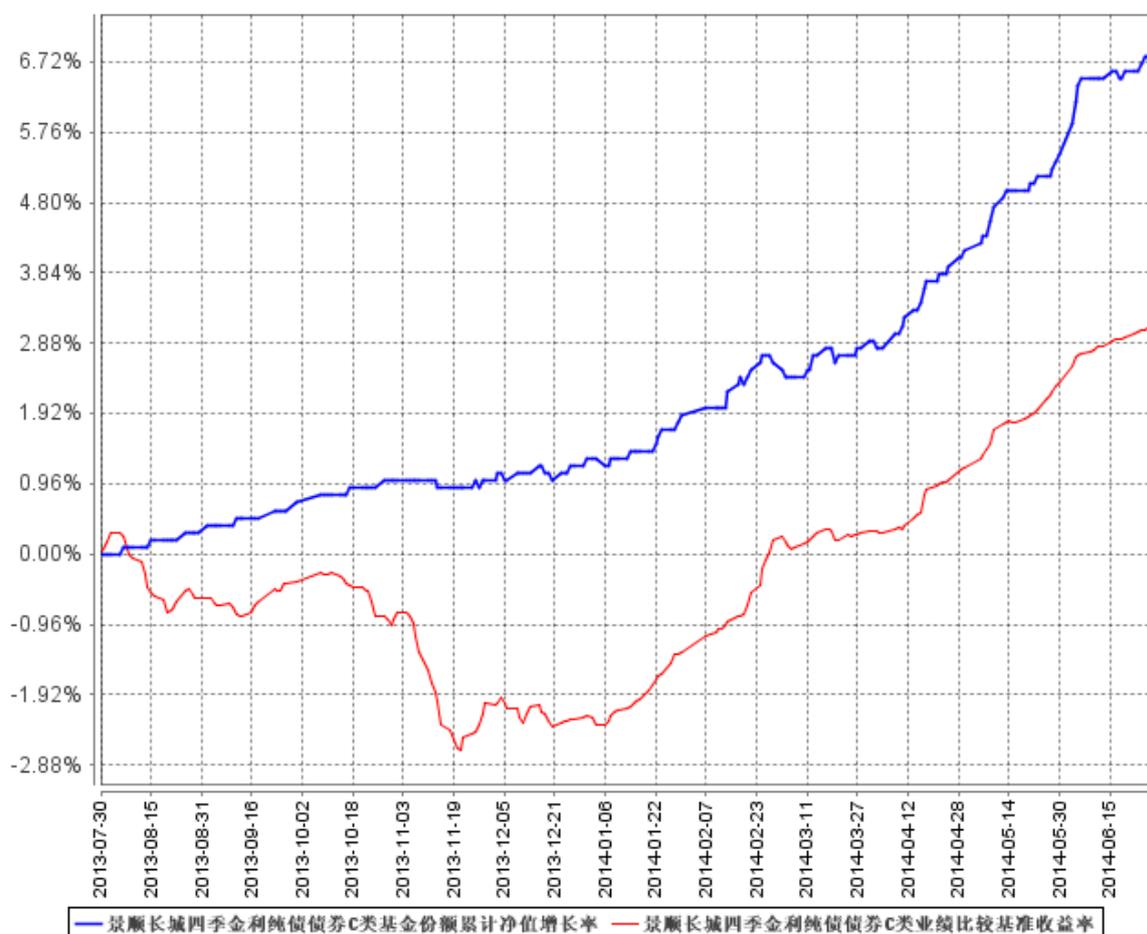
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.45%	0.12%	0.74%	0.05%	0.71%	0.07%
过去三个月	4.06%	0.09%	2.78%	0.05%	1.28%	0.04%
过去六个月	5.72%	0.08%	5.44%	0.06%	0.28%	0.02%
自基金合同生效起至今	7.30%	0.07%	3.11%	0.08%	4.19%	-0.01%

景顺长城四季金利纯债债券 C 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.35%	0.11%	0.74%	0.05%	0.61%	0.06%
过去三个月	3.86%	0.09%	2.78%	0.05%	1.08%	0.04%
过去六个月	5.52%	0.08%	5.44%	0.06%	0.08%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.89%	0.07%	3.11%	0.08%	3.78%	-0.01%

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





注：本基金的资产配置比例为：投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，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%。本基金的建仓期自 2013 年 7 月 30 日合同生效日起 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。基金合同生效日（2013 年 7 月 30 日）起至本报告期末不满一年。

## § 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，由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2014 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 33 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、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、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利纯债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、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、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。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股票证券投资基金、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		
RU PING (汝平)	本基金基金经理，景顺长城优信增利债券型基金、稳定收益债券型基金、景兴信用纯债债券型基金、景颐双利债券型基金、景益货币市场基金和鑫月薪定期支付债券型基金基金经理，固定收益部兼国际投资部投资总监	2013 年 7 月 30 日	-	18	信息网络（金融类）硕士，物理博士。曾担任摩根士丹利投资管理公司投资分析师、执行董事与固定收益投资部投资经理，摩根士丹利华鑫基金公司固定收益投资部副总监、总监兼基金经理等职务。2012 年 10 月加入本公司，担任固定收益部投资总监兼国际投资部投资总监；自 2013 年 7 月起担任基金经理。

袁媛	本基金基金经理，景顺长城景益货币市场基金基金经理，景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理	2014年4月4日	-	7	经济学学士、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、安信证券投资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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年，债券市场在基本面有利于债市、资金面稳中偏松（再贷款和定向降准）等因素影响下，整体回暖并出现持续回升，各类券种收益率全线下行。中债总净价指数上涨 3.99%，

中债国债总净价指数上涨 3.99%，中债金融债券总净价指数上涨 4.14%，中债企业债净价指数上涨 3.97%，中债可转债指数上涨 4.37%。表现最差的为短融，中债短融总净价指数上涨 0.82%。

基本上，由于 2013 年下半年央行货币政策偏紧，基础货币增速一直维持在较低水平，偏紧的货币供给使得通胀压力持续缓解。CPI 从去年 10 月的 3.2% 一路下降到今年 4 月的 1.8%。CPI 的下行为整个利率体系下行创造了较大空间。叠加基本面其他数据不佳，房地产投资和销售增速明显放缓，经济依然缺乏内生增长动力，GDP 增速存在较大下行压力，奠定了 2014 年上半年的债券牛市基础。加上年初以来对同业非标业务的监管使得同业扩张的速度也呈放缓趋势，银行可支配资金比较充裕。央行实施的定向宽松的货币政策（包括定向降准、定向再贷款等）进一步点燃了市场做多热情。债券市场收益率从 2014 年 1 月初最高点开始一路下行，国债收益率 1 年期下行近 110 BP，10 年期下行近 65 BP。国开债下行幅度更大，1 年期下行近 130 BP，10 年期从 5.92% 下行到 4.86% 水平。低资金成本、基本面支撑与配置力量支持下带动上半年债券收益率大幅下行。

资金面上，银行间市场流动性呈现宽松状态，6 月底“钱荒”不再上演。从 1 月到现在，资金利率中枢持续下移。从统计数据看，2 季度隔夜回购利率均值为 2.54%，较去年 4 季度均值 3.79% 的水平下行 125BP。7 天回购利率均值为 3.36%，较去年 4 季度均值 4.74% 的水平下行 138BP。在资金面平稳的背景下，机构加杠杆操作加大国开和信用债收益率下行空间。目前的经济情况呈现出产业经济走弱，政府投资主导的特点。债券市场的结构也出现分化。信用债中城投债表现优于产业债。

本基金在上半年资金面稳中趋松、经济基本面仍显趋弱的判断下，整体配置思路仍是在确保信用风险和流动风险可控的前提下，组合操作适当拉长久期并保持杠杆在一定的水平，主要建仓资质较好的城投债，根据基本面变化，适度参与利率债的交易性机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年上半年，四季金利 A 份额净值增长率为 5.72%，高于业绩比较基准收益率 0.28%。

2014 年上半年，四季金利 C 份额净值增长率为 5.52%，高于业绩比较基准收益率 0.08%。

#### 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 3 季度宏观经济，在微刺激政策的推动及累加效应下，预计经济增速等指标有望继续好转，但经济内生增长动能依然不足，房地产行业风险依然很大，经济弱复苏的持续时间很大程度上取决于经济刺激的力度。基建投资加速和外需改善是需求面回暖最主要的拉动因素。考虑到去年 3 季度的环比增速较高，稳增长政策仍需持续发力才能维持相对平稳的经济增速。上半年 CPI 同比均值在 2.3%，随着稳增长措施的推出以及猪肉价格的反弹，预计下半年的通胀将抬升，呈前

低后高走势，但整体仍为温和可控。

货币政策和财政政策将依然配合经济刺激政策，预计仍将保持中性偏松。在基本面偏弱的情况下，资金面预计一直维持适度宽松，随着财政支出的逐渐投放以及公开市场操作和再贷款的陆续展开，银行体系的流动性将有所缓解。但受新股申购影响，交易所的资金面波动可能加大。

信用风险方面，传统行业仍面临产能过剩问题，以煤炭行业为代表的周期性行业信用风险依然较大；房地产投资和增速下滑，相关的上下游行业的现金流压力上升；尽管短期融资平台债务风险不大，但 14 年土地财政压力剧增，不排除个别经济欠发达地区的融资平台存在本息偿还的兑付风险。

展望 3 季度债券市场，微刺激政策推动下，3 季度经济增速可能企稳，利率债收益率下行空间有限，交易性机会不如上半年。3 季度资金面仍可能保持相对宽松，久期和杠杆比例维持不变，信用债仍具有较高的持有票息收益和一定的收益率下行空间，但对低评级信用债保持谨慎态度。

本基金策略上着重把握信用债的持有期收益，同时保持适度的组合久期。本基金将坚持平衡收益与风险的原则，密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，谨慎控制组合的信用风险、利率风险，我们将控制组合的久期和杠杆，以应对组合规模波动。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理

人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

## 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

## 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

## 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了两次利润分配：

(1) 截至 2013 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 2,159,298.47 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 1,079,649.24 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 622,742.39 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 311,371.20 元，本基金的基金管理人已于 2014 年 1 月 9 日完成权益登记，本基金 A、C 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.1 元，详细信息请查阅相关分红公告。

(2) 截至 2014 年 3 月 31 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 2,328,949.72 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 1,164,474.86 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 424,972.33 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 212,486.17 元，本基金的基金管理人已于 2014 年 4 月 9 日完成权益登记，本基金 A 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.12 元，本基金 C 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.10 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 1,864,681.08 元，根据基金合同约定

定本次应分配金额为 932,340.54 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 971,780.41 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 485,890.21 元，本基金的基金管理人已于 2014 年 7 月 8 日完成权益登记，本基金 A、C 类份额每 10 份基金份额均派发红利 0.20 元，详细信息请查阅相关分红公告。

## § 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	8,328,900.65	63,100,489.07
结算备付金		847,916.53	10,312,394.64
存出保证金		5,434.40	2,368.08
交易性金融资产	6.4.7.2	109,731,776.30	197,422,476.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		109,731,776.30	197,422,476.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,000,000.00	-
应收证券清算款		3,999,991.80	-
应收利息	6.4.7.5	2,117,451.45	5,178,945.17
应收股利		-	-
应收申购款		5,362,737.02	11,317.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		136,394,208.15	276,027,990.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		41,999,731.80	64,967,772.02
应付证券清算款		8,012,759.66	10,510,887.48
应付赎回款		3,779,920.11	3,764,448.38
应付管理人报酬		50,114.17	124,185.41
应付托管费		16,704.75	41,395.12
应付销售服务费		8,907.19	24,635.62
应付交易费用	6.4.7.7	9,914.82	4,767.06
应交税费		-	-
应付利息		6,640.70	5,020.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,443.22	166,379.53
负债合计		53,967,136.42	79,609,491.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	78,557,978.08	193,636,457.96
未分配利润	6.4.7.10	3,869,093.65	2,782,040.86
所有者权益合计		82,427,071.73	196,418,498.82
负债和所有者权益总计		136,394,208.15	276,027,990.22

注：（1）报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额 78,557,978.08 份，其中景顺长城四季金利纯债债券基金 A 级份额净值 1.050 元，份额总额 50,574,265.30 份；景顺长城四季金利纯债债券

券基金 C 级份额净值 1.048 元，份额总额 27,983,712.78 份。

(2) 本基金基金合同生效日为 2013 年 7 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		8,844,357.67
1.利息收入		5,740,443.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	500,590.46
债券利息收入		5,216,581.96
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		23,270.85
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,148,676.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	1,148,676.96
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,946,355.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,881.45
<b>减：二、费用</b>		1,883,350.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	407,644.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	135,881.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	57,396.92
4. 交易费用	6.4.7.19	5,692.28
5. 利息支出		1,067,070.72
其中：卖出回购金融资产支出		1,067,070.72
6. 其他费用	6.4.7.20	209,664.74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,961,007.31
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,961,007.31

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金



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，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。（以下简称“中国农业银行”）

根据《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。在基金管理人认为合适的情况下，基金管理人可以根据相关法律法规的规定，提供本基金不同基金份额类别之间的转换服务。基金份额类别间转换的数量限制、转换费率等事项由基金管理人依法决定并另行公告。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券、可分离交易可转债的纯债部分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证券品种，但需符合中国证监会的相关规定。本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证综合债券指数。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值

变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	8,328,900.65
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,328,900.65

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30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	75,164,856.39	75,406,576.30
	银行间市场	33,862,290.40	34,325,200.00
	合计	109,027,146.79	109,731,776.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	109,027,146.79	109,731,776.30	704,629.51

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	6,000,000.00	-
合计	6,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	667.66
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	343.44
应收债券利息	2,110,617.77
应收买入返售证券利息	5,400.00
应收申购款利息	420.33
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.25
合计	2,117,451.45

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	9,914.82
合计	9,914.82

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	28.48
预提费用	82,414.74
合计	82,443.22

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城四季金利纯债债券 A 类		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,344,947.43	145,344,947.43
本期申购	8,345,818.29	8,345,818.29
本期赎回(以“-”号填列)	-103,116,500.42	-103,116,500.42
- 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	50,574,265.30	50,574,265.30

金额单位：人民币元

景顺长城四季金利纯债债券 C 类		
项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,291,510.53	48,291,510.53
本期申购	29,780,455.88	29,780,455.88
本期赎回(以“-”号填列)	-50,088,253.63	-50,088,253.63
- 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	27,983,712.78	27,983,712.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城四季金利纯债债券 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,512,422.16	-353,123.69	2,159,298.47
本期利润	3,964,647.43	1,537,970.07	5,502,617.50
本期基金份额交易产生的变动数	-1,919,194.77	-519,716.63	-2,438,911.40
其中：基金申购款	163,845.98	38,925.64	202,771.62
基金赎回款	-2,083,040.75	-558,642.27	-2,641,683.02
本期已分配利润	-2,693,193.74	-	-2,693,193.74
本期末	1,864,681.08	665,129.75	2,529,810.83

单位：人民币元

景顺长城四季金利纯债债券 C 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	739,927.20	-117,184.81	622,742.39
本期利润	1,050,003.89	408,385.92	1,458,389.81
本期基金份额交易产生的变动数	-159,929.10	76,301.30	-83,627.80
其中：基金申购款	737,166.16	274,585.55	1,011,751.71
基金赎回款	-897,095.26	-198,284.25	-1,095,379.51
本期已分配利润	-658,221.58	-	-658,221.58
本期末	971,780.41	367,502.41	1,339,282.82

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,420.23
定期存款利息收入	465,249.75
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	21,258.02
其他	662.46
合计	500,590.46

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金于本期无股票投资收益。

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	302,544,727.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	293,782,015.32
减：应收利息总额	7,614,035.08
债券投资收益	1,148,676.96

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本期贵金属投资收益发生额为零。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本期无衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

本基金于本期无股利收益。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	1,946,355.99
——股票投资	-
——债券投资	1,946,355.99
——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	1,946,355.99

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	7,926.54
基金转换费收入	954.91

合计	8,881.45
----	----------

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	252.33
银行间市场交易费用	5,439.95
合计	5,692.28

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	17,853.84
银行划款手续费	18,150.00
其他	100.00
合计	209,664.74

#### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

1) 本基金的基金管理人于 2014 年 7 月 4 日宣告 2014 年度第 3 次分红，向截至 2014 年 7 月 8 日止在本基金注册登记人景顺长城基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类份额按每 10 份基金份额派发红利 0.200 元，C 类份额按每 10 份基金份额派发红利 0.200 元。其中现金形式发放总额人民币 2,057,825.87 元，再投资形式发放总额人民币 21,479.67 元，实际分配收益为人民币 2,079,305.54 元。

2) 除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金并无其它需作披露的资产负债表日后

事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券有限责任公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	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 成交总额的 比例
长城证券	15,429,384.88	12.78%	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长城证券	1,224,455,000.00	44.26%	-	-

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本期无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	407,644.26
其中：支付销售机构的客户维护费	178,889.12

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,881.44

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

**6.4.10.2.3 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
	2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	景顺长城四季金利纯 债债券 A 类	景顺长城四季金 利纯债债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	4,031.86	4,031.86
中国农业银行	-	52,182.04	52,182.04
长城证券	-	-	-
合计	-	56,213.90	56,213.90

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期与关联方未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金的其他关联方本期末和上年度末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	8,328,900.65	13,420.23

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

景顺长城四季金利纯债债券 A 类

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2014 年 4 月 9 日	2014 年 4 月 9 日	0.120	1,274,658.34	6,462.04	1,281,120.38	
2	2014 年 1 月 9 日	2014 年 1 月 9 日	0.100	1,406,935.89	5,137.47	1,412,073.36	
合计	-	-	0.220	2,681,594.23	11,599.51	2,693,193.74	

## 景顺长城四季金利纯债债券 C 类

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2014 年 4 月 9 日	2014 年 4 月 9 日	0.100	219,222.72	835.44	220,058.16	
2	2014 年 1 月 9 日	2014 年 1 月 9 日	0.100	437,548.24	615.18	438,163.42	
合计	-	-	0.200	656,770.96	1,450.62	658,221.58	

注：资产负债表日之后，年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项（附注：6.4.8.2）。

## 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
124831	14 崇建 设	2014 年 6 月 18 日	2014 年 7 月 30 日	新发 债券	99.92	99.92	60,000	5,994,950.14	5,994,950.14	-

## 6.4.12.2 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。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 19,999,740.00 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
140207	14 国开 07	2014 年 7 月 1 日	100.36	100,000	10,036,000.00
011462001	14 葛洲坝 SCP001	2014 年 7 月 2 日	100.70	100,000	10,070,000.00

合计				200,000	20,106,000.00
----	--	--	--	---------	---------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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 21,999,991.80 元，于 2014 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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。

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，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。

##### 6.4.13.2 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，债券发行人信用评级降低等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
A-1	-	110,064,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	20,106,000.00	9,931,000.00
合计	20,106,000.00	119,995,000.00

注：未评级债券为政策性金融债、短期融资券。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
AAA	-	381,440.00
AAA 以下	84,625,776.30	62,046,036.00
未评级	5,000,000.00	15,000,000.00
合计	89,625,776.30	77,427,476.00

注：未评级债券为中小企业私募债。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易。除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，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。

**6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，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。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。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公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

2014年6月30日							
资产							
银行存款	8,328,900.65	-	-	-	-	-	8,328,900.65
结算备付金	847,916.53	-	-	-	-	-	847,916.53
存出保证金	5,434.40	-	-	-	-	-	5,434.40
交易性金融资产	-	-20,909,020.50	68,045,140.95	20,777,614.85	-	-	109,731,776.30
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,999,991.80	3,999,991.80
应收利息	-	-	-	-	-	2,117,451.45	2,117,451.45
应收申购款	-	-	-	-	-	5,362,737.02	5,362,737.02
资产总计	15,182,251.58	-20,909,020.50	68,045,140.95	20,777,614.85	11,480,180.27	-	36,394,208.15
负债							
卖出回购金融资产款	41,999,731.80	-	-	-	-	-	41,999,731.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,012,759.66	8,012,759.66
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,779,920.11	3,779,920.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,114.17	50,114.17
应付托管费	-	-	-	-	-	16,704.75	16,704.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,907.19	8,907.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,914.82	9,914.82
应付利息	-	-	-	-	-	6,640.70	6,640.70
其他负债	-	-	-	-	-	82,443.22	82,443.22
负债总计	41,999,731.80	-	-	-	-	11,967,404.62	53,967,136.42
利率敏感度缺口	-26,817,480.22	-20,909,020.50	68,045,140.95	20,777,614.85	-	-	-
上年度末 2013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	13,100,489.07	50,000,000.00	-	-	-	-	63,100,489.07
结算备付金	10,312,394.64	-	-	-	-	-	10,312,394.64
存出保证金	2,368.08	-	-	-	-	-	2,368.08
交易性金融资产	40,289,000.00	21,544,970.00	59,667,000.00	74,598,120.00	1,323,386.00	-	197,422,476.00
应收利息	-	-	-	-	-	5,178,945.17	5,178,945.17
应收申购款	-	-	-	-	-	11,317.26	11,317.26
资产总计	63,704,251.79	71,544,970.00	59,667,000.00	74,598,120.00	1,323,386.00	5,190,262.43	276,027,990.22
负债							
卖出回购金融资产款	64,967,772.02	-	-	-	-	-	64,967,772.02
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,510,887.48	10,510,887.48
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,764,448.38	3,764,448.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,185.41	124,185.41
应付托管费	-	-	-	-	-	41,395.12	41,395.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24,635.62	24,635.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,767.06	4,767.06
应付利息	-	-	-	-	-	5,020.78	5,020.78

其他负债	-	-	-	-	-	166,379.53	166,379.53
负债总计	64,967,772.02	-	-	-	-	-14,641,719.38	79,609,491.40
利率敏感度缺口	-1,263,520.23	71,544,970.00	59,667,000.00	74,598,120.00	1,323,386.00	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。		
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（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-809,729.34	-681,194.44
市场利率下降25个基点	818,942.51	687,747.18	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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。

#### 6.4.13.4.3 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，所面临的最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。

本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中对信用债券的投资比例不低于基金债券类资产的80%。信用债券包括：短期融资券、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用的固定收益类金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。其中，持有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%。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013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	-	-	-	-

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	109,731,776.30	133.13	197,422,476.00	100.51
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	109,731,776.30	133.13	197,422,476.00	100.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有股票投资（2013 年 12 月 31 日：无），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（2013 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2014 年 8 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	109,731,776.30	80.45
	其中：债券	109,731,776.30	80.45
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	6,000,000.00	4.40
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,176,817.18	6.73
7	其他各项资产	11,485,614.67	8.42
8	合计	136,394,208.15	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金投资范围不包括股票投资。

## 7.3 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

本基金投资范围不包括股票投资。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金投资范围不包括股票投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金投资范围不包括股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金投资范围不包括股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,036,000.00	12.18
	其中：政策性金融债	10,036,000.00	12.18
4	企业债券	84,625,776.30	102.67
5	企业短期融资券	10,070,000.00	12.22
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	5,000,000.00	6.07
9	合计	109,731,776.30	133.13

注：其他项中为本基金持有的私募债，明细如下：

代码	名称	数量	票面利率 (%)	期限 (年)
125169	13 淮软 01	50,000	10	3 年，附债券存续期内的第 2 年末发行人上调票面利率选择权和投资者回售选择权

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	124621	14 宣国资	100,000	10,300,000.00	12.50
2	1480050	14 莱芜开投债	100,000	10,254,000.00	12.44
3	011462001	14 葛洲坝 SCP001	100,000	10,070,000.00	12.22
4	140207	14 国开 07	100,000	10,036,000.00	12.18
5	124692	14 嘉公路	100,000	9,995,528.77	12.13

## 7.7 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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.11.2

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	5,434.40
2	应收证券清算款	3,999,991.80
3	应收股利	-
4	应收利息	2,117,451.45
5	应收申购款	5,362,737.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,485,614.67

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金投资范围不包括股票投资。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
景顺长城四季金 利纯债债券 A 类	1,073	47,133.52	2,796,620.46	5.53%	47,777,644.84	94.47%
景顺长城四季金 利纯债债券 C 类	479	58,421.11	11,461,318.04	40.96%	16,522,394.74	59.04%
合计	1,552	50,617.25	14,257,938.50	18.15%	64,300,039.58	81.85%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	景顺长城四季金利 纯债债券 A 类	景顺长城四季金利 纯债债券 C 类
基金合同生效日（2013 年 7 月 30 日）基金份额总额	542,575,663.62	522,710,780.89
本报告期期初基金份额总额	145,344,947.43	48,291,510.53
本报告期基金总申购份额	8,345,818.29	29,780,455.88
减：本报告期基金总赎回份额	103,116,500.42	50,088,253.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,574,265.30	27,983,712.78

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

1、本基金管理人于 2014 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，聘任王鹏辉先生担任本公司副总经理，并向中国证券投资基金业协会备案。

2、本基金管理人于 2014 年 3 月 28 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，同意邓体顺先生辞去本公司副总经理一职。

3、本基金管理人于 2014 年 7 月 9 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，聘任周伟达先生担任本公司副总经理，并向中国证券投资基金业协会备案。

以上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。

4、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
财富里昂证券有限责任公司	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
中国银河证券	1	-	-	-	-	未变更

股份有限公司						
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
申银万国证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变更
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	-	-	-	-	新增
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份 有限公司	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
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变更
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
海通证券股份 有限公司	105,297,446.83	87.22%	1,542,200,000.00	55.74%	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	15,429,384.88	12.78%	1,224,455,000.00	44.26%	-	-

## 10.8 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	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 1 月 7 日
2	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2013 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	2014 年 1 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 1 月 29 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 2 月 14 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券为销售机构并开通基金转换及基金“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	2014 年 2 月 25 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券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	2014 年 2 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券手机客户端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	2014 年 3 月 14 日
8	景顺长城四季金利纯债债券型 2014 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	2014 年 3 月 15 日
9	景顺长城四季金利纯债债券型 2014 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	2014 年 3 月 15 日
10	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	2014 年 3 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 4 月 4 日

12	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金分红公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 4 月 4 日
13	景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金 2014 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	2014 年 4 月 22 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加嘉实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	2014 年 5 月 12 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增嘉实财富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	2014 年 5 月 12 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增新兰德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	2014 年 5 月 23 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加新兰德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	2014 年 5 月 23 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金在晟视天下开通基金定期定额投资业务及定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 5 月 27 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增一路财富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	2014 年 6 月 17 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加一路财富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	2014 年 6 月 17 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加恒天明泽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	2014 年 6 月 25 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增恒天明泽为销售机构并开通基金“定	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 6 月 25 日

	期定额投资业务”和基金转换业务的公告		
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富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	2014 年 6 月 27 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增钱景财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城四季金利纯债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。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 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

2014 年 8 月 25 日