

# 景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 3 月 20 日（基金合同生效日）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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
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.....	12
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>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	37
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
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 .....	45
12.3 查阅方式 .....	45

## § 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
交易代码	000465
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 20 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	209, 152, 418. 79 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期限进行适当的匹配。</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</p>

	上获取稳定的收益。
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	赵如冰	姜建清

## 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、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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 3 月 20 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,830,356.02
本期利润	3,533,376.97

加权平均基金份额本期利润	0.0157
本期加权平均净值利润率	1.56%
本期基金份额净值增长率	1.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
期末可供分配利润	2,644,939.04
期末可供分配基金份额利润	0.0126
期末基金资产净值	212,461,934.52
期末基金份额净值	1.016
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	1.60%

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。

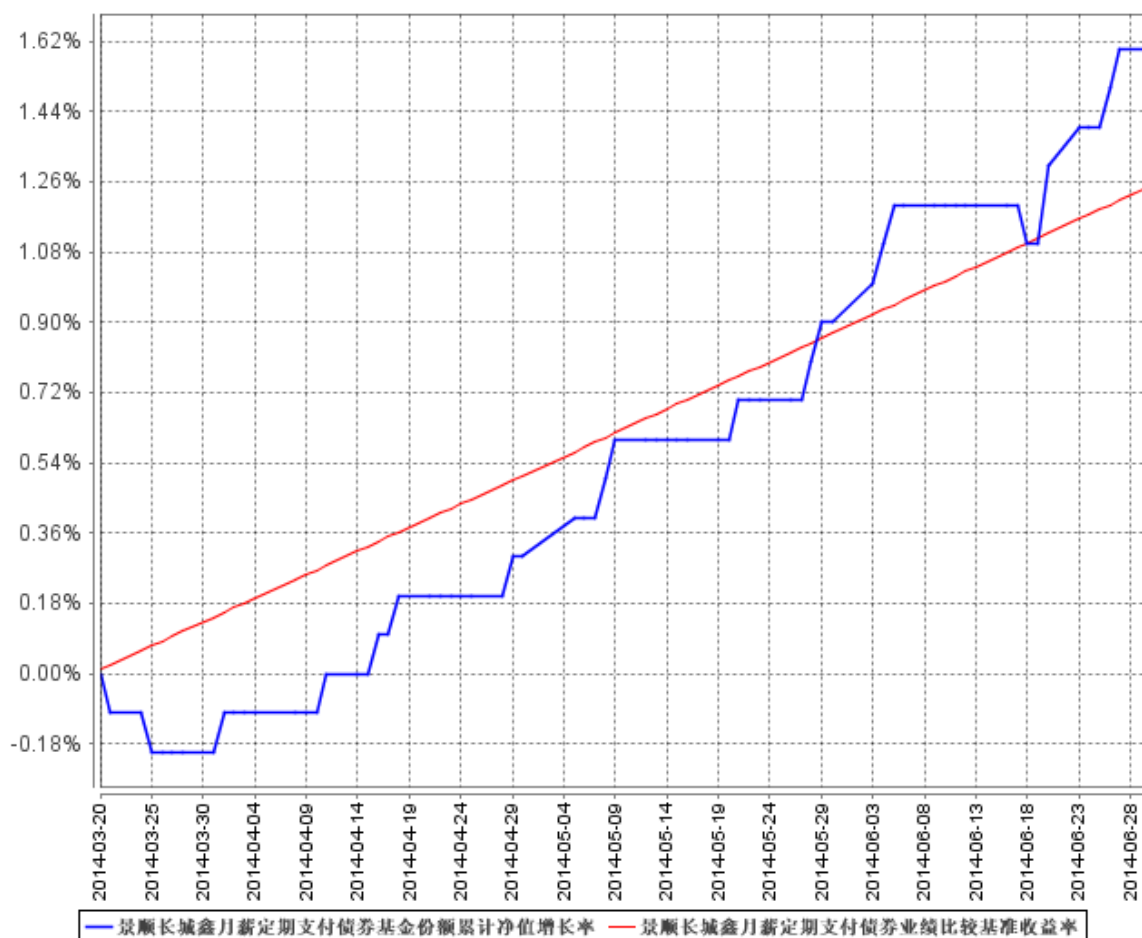
5、本基金基金合同生效日为2014年3月20日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.69%	0.07%	0.37%	0.01%	0.32%	0.06%
过去三个月	1.80%	0.05%	1.10%	0.01%	0.70%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.05%	1.25%	0.01%	0.35%	0.04%

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



注：本基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2014 年 3 月 20 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、四季金利纯债债券型基金、景兴信用纯债债券型基金、	2014 年 3 月 20 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

	景颐双利债券型基金和景益货币市场基金基金经理，固定收益部兼国际投资部投资总监				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。
毛从容	本基金基金经理，景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡基金、景顺长城货币市场基金），景顺长城景益货币市场基金、景顺长城景颐双利债券型基金基金经理，固定收益部投资副总监	2014年3月20日	-	14	经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金融研究所，着重于宏观和债券市场的研究，并担任金融研究所债券业务小组组长。2003年3月加入本公司，担任研究员等职务；自2005年6月起担任基金经理。
袁媛	本基金基金经理，景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金基金经理，景顺长城景益货币市场基金基金经理	2014年6月10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、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013年7月加入本公司，担任固定收益部资深研究员；自2014年4月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、毛从容女士于2014年1月15日离任景系列下设之景顺长城动力平衡证券投资基金基金经理。

#### 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、《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本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%，中标可转债指数上涨 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 1 季度末成立，根据产品特性，在银行间账户未开立之前，主要建仓剩余期限在 1-1.5

年左右的流动性偏好的交易所债券，待开户完成后，用 1 年期短融进行了部分置换，在资金面较为宽松背景下，保持适度的杠杆水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

基金合同生效日（2014 年 3 月 20 日）至本报告期末，本基金份额净值增长率为 1.60%，高于业绩比较基准收益率 0.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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，交易性机会不如有上半年。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，注重组合开放期的流动性。本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，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配置，注重该组合开放时的流动性要求，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

#### 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、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

本基金基金合同约定，本基金存续期内不进行收益分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金 2014 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,021,391.33
结算备付金		1,583,771.45
存出保证金		11,724.98
交易性金融资产	6.4.7.2	333,599,932.14

其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		333,599,932.14
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	-
应收证券清算款		4,983,642.66
应收利息	6.4.7.5	5,033,553.90
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		346,234,016.46
<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>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		129,499,714.80
应付证券清算款		4,003,090.98
应付赎回款		-
应付管理人报酬		110,703.43
应付托管费		36,901.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	6,794.37
应交税费		-
应付利息		6,596.16
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	108,281.06
负债合计		133,772,081.94
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	209,152,418.79
未分配利润	6.4.7.10	3,309,515.73
所有者权益合计		212,461,934.52
负债和所有者权益总计		346,234,016.46

注：1. 报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.016 元，基金份额总额 209,152,418.79 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014 年 3 月 20 日(基金合同生 效日)至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		4,652,434.38
1.利息收入		3,088,843.34
其中：存款利息收入	6.4.7.11	429,422.63
债券利息收入		2,585,477.08
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		73,943.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		819,172.10
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	819,172.10
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	703,020.95
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	41,397.99
<b>减：二、费用</b>		1,119,057.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	380,134.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,711.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,884.87
5. 利息支出		495,694.71
其中：卖出回购金融资产支出		495,694.71
6. 其他费用	6.4.7.20	111,632.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,533,376.97
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,533,376.97

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元



项目	本期 2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	227,428,917.47	-	227,428,917.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,533,376.97	3,533,376.97
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)	-18,276,498.68	-223,861.24	-18,500,359.92
其中: 1.基金申购款	29,438.38	382.70	29,821.08
2.基金赎回款	-18,305,937.06	-224,243.94	-18,530,181.00
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)	209,152,418.79	3,309,515.73	212,461,934.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

          许义明  吴建军  邵媛媛            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1473号《关于核准景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币227,404,003.42元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2014)第150号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同》于2014年3月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为227,428,917.47份基金份额,其中认购资金利息折合24,914.05份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金

基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股。可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：同期六个月定期存款利率（税后）+1.7%。

本基金以定期开放的方式运作。本基金开放期分为受限开放期和自由开放期，其它时间为封闭期；封闭期内本基金不接受申购、赎回申请。每个运作周期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一自由开放期结束之日次日起（包括该日）六个月的期间。此外基金管理人于每一运作周期内每个日历月末最后一个工作日进行份额支付（基金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 2014 年 8 月 22 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《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”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日止期间的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 3 月 20

日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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

###### (2) 金融负债的分类

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

##### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。对于每第二、第四、第六……(以此类推)第  $2N$  ( $N$  属于自然数) 个运作周期的倒数第二个工作日进行的定期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，折算基准日日终，本基金的基金份额净值调整为 1.000 元。于受限开放期和自由开放期，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。由

于份额支付引起的实收基金变动于份额支付确认日计算认列。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金存续期内不进行收益分配。

#### 6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

无。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

的个人所得税。

## 6.4.7 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	1,021,391.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,021,391.33

### 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	112,248,595.16	112,410,932.14
	银行间市场	220,648,316.03	221,189,000.00
	合计	332,896,911.19	333,599,932.14
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	332,896,911.19	333,599,932.14	703,020.95

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末衍生金融资产/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

本基金本期末买入返售金融资产项目余额为零。

#### 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	1,118.33
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	641.43
应收债券利息	5,031,789.37
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.77
合计	5,033,553.90

**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	6,794.37
合计	6,794.37

**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	-
预提费用	108,281.06
合计	108,281.06

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	227,428,917.47	227,428,917.47
本期申购	29,438.38	29,438.38
本期赎回(以“-”号填列)	-18,305,937.06	-18,305,937.06
- 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	209,152,418.79	209,152,418.79

注：1. 本基金自 2014 年 2 月 26 日至 2014 年 3 月 18 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金(含利息折份额)227,428,917.47 元。根据《景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 24,914.05 元，连同有效认购资金一同折算基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 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》和《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；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。本期本基金于 2014 年 6 月 20 日为受限开放期，其他时间封闭运作。

#### 6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,830,356.02	703,020.95	3,533,376.97
本期基金份额交易产生的变动数	-185,416.98	-38,444.26	-223,861.24
其中：基金申购款	318.81	63.89	382.70
基金赎回款	-185,735.79	-38,508.15	-224,243.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,644,939.04	664,576.69	3,309,515.73

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,797.68
定期存款利息收入	399,986.11

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,593.75
其他	45.09
合计	429,422.63

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本期股票投资收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月20日(基金合同生效日)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	138,434,878.78
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	134,714,562.06
减：应收利息总额	2,901,144.62
债券投资收益	819,172.10

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期贵金属收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益发生额为零。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本期股利收益项目发生额为零。

#### 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3月20日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
1. 交易性金融资产	703,020.95
——股票投资	-
——债券投资	703,020.95
——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	703,020.95

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月20日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
基金赎回费收入	41,397.99
合计	41,397.99

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月20日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
交易所市场交易费用	1,534.87
银行间市场交易费用	3,350.00
合计	4,884.87

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月20日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
审计费用	21,533.18
信息披露费	80,747.88
债券托管账户维护费	6,000.00
银行划款手续费	3,350.96
合计	111,632.02

### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
长城证券有限责任公司(“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。

### 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

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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3月20日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	380,134.38
其中：支付销售机构的客户维护费	93,668.75

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.6% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月20日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,711.43

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本期未与关联方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**

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末未投资本基金。

**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3月20日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,021,391.33	22,797.68

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

**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**

本基金在存续期内不进行利润分配。

**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**

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**6.4.12.2 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**

截至本期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额 79,999,760.00 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
041458042	14 北方水泥 CP001	2014 年 7 月 1 日	100.31	300,000	30,093,000.00
041455023	14 北方水泥 CP002	2014 年 7 月 1 日	100.24	200,000	20,048,000.00
041452020	14 南方水泥 CP002	2014 年 7 月 1 日	100.46	300,000	30,138,000.00
合计				800,000	80,279,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末 2014 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,499,954.80 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

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

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

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

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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
A-1	221,189,000.00
A-1 以下	-
未评级	-
合计	221,189,000.00

#### 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
AAA	-
AAA 以下	112,410,932.14
未评级	-
合计	112,410,932.14

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性

风险一方面来自于基金份额持有人可于受限开放期和自由开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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，因此除附注 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

于 2014 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 129,499,714.80 元将在一个月内到期且计息外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金和存出保证金等利率敏感资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### **6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元



本期末 2014 年 6 月 30 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	1,021,391.33	-	-	-	-	-	1,021,391.33
结算备付金	1,583,771.45	-	-	-	-	-	1,583,771.45
存出保证金	11,724.98	-	-	-	-	-	11,724.98
交易性金融资产	-	10,104,000.00	235,827,060.58	87,668,871.56	-	-	333,599,932.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,983,642.66	4,983,642.66
应收利息	-	-	-	-	-	5,033,553.90	5,033,553.90
资产总计	2,616,887.76	10,104,000.00	235,827,060.58	87,668,871.56	-	10,017,196.56	346,234,016.46
负债							
卖出回购金融资产款	129,499,714.80	-	-	-	-	-	129,499,714.80
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,003,090.98	4,003,090.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,703.43	110,703.43
应付托管费	-	-	-	-	-	36,901.14	36,901.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,794.37	6,794.37
应付利息	-	-	-	-	-	6,596.16	6,596.16
其他负债	-	-	-	-	-	108,281.06	108,281.06
负债总计	129,499,714.80	-	-	-	-	4,272,367.14	133,772,081.94
利率敏感度缺口	-126,882,827.04	10,104,000.00	235,827,060.58	87,668,871.56	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014年6月30日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	958,129.62
	2. 市场利率上升 25 个基点	-952,304.64

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 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市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，债券资产占基金资产的比例不低于 80%，在每个受限开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日、自由开放期的前 2 个月和后 2 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### **6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资。

#### **6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2014 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### **6.4.14 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) 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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 59,135,604.88 元，属于第二层级的余额为 274,464,327.26 元，无属于第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于交易不活跃期间将相关债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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。

## § 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	333,599,932.14	96.35
	其中：债券	333,599,932.14	96.35
	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	-	-
	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	2,605,162.78	0.75
7	其他各项资产	10,028,921.54	2.90
8	合计	346,234,016.46	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	112,410,932.14	52.91
5	企业短期融资券	221,189,000.00	104.11
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	333,599,932.14	157.02

### 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	126019	09 长虹债	413,010	39,413,544.30	18.55
2	041452007	14 联合水泥 CP001	300,000	30,186,000.00	14.21
3	041455008	14 金隅 CP002	300,000	30,177,000.00	14.20
4	041452020	14 南方水泥 CP002	300,000	30,138,000.00	14.19
5	041458042	14 北方水泥 CP001	300,000	30,093,000.00	14.16

**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**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**7.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,724.98
2	应收证券清算款	4,983,642.66
3	应收股利	-
4	应收利息	5,033,553.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,028,921.54
---	----	---------------

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
963	217,188.39	89,214,887.53	42.66%	119,937,531.26	57.34%

### 8.2 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	29,567.43	0.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年3月20日）基金份额总额	227,428,917.47
本报告期期初基金份额总额	227,428,917.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	29,438.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	18,305,937.06

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	209,152,418.79

注：1. 赎回包括受限开放期赎回和定期份额支付。

2. 本基金合同生效日为 2014 年 3 月 20 日。

## § 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、因中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）工作需要，周月秋同志不再担任中国工商银行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使中国工商银行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-



中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-

注：1. 本基金与景顺长城新兴成长股票型证券投资基金共用交易单元。

2. 基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；

d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	192,821,571.50	72.06%	1,262,000,000.00	91.19%	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	39,836,397.26	14.89%	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
安信证券股份 有限公司						
中国银河证券 股份有限公司						
兴业证券股份 有限公司						
华创证券有限 责任公司						
中信证券股份 有限公司						
第一创业证券 股份有限公司						
申银万国证券 股份有限公司						
国金证券股份 有限公司						
中国国际金融 有限公司						
长城证券有限 责任公司	34,942,355.75	13.06%	121,966,000.00	8.81%		

## 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	景顺长城鑫月薪定期支付债券型 证券投资基金基金合同	上海证券报, 基金管 理人网站	2014年2月21日
2	景顺长城鑫月薪定期支付债券型 证券投资基金托管协议	上海证券报, 基金管 理人网站	2014年2月21日
3	景顺长城鑫月薪定期支付债券型 证券投资基金基金合同摘要	上海证券报, 基金管 理人网站	2014年2月21日
4	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	上海证券报, 基金管 理人网站	2014年2月21日
5	景顺长城鑫月薪定期支付债券型 证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报, 基金管 理人网站	2014年2月21日
6	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一个运	中国证券报, 上海证 券报, 证券时报, 基	2014年2月25日

	作周期份额支付基准及调整持有人交易资料寄送服务的公告	金管理人网站	
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增晟视天下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 3 月 17 日
8	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金合同生效公告	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 21 日
9	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
10	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, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 5 月 5 日
11	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
12	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
13	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, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2014 年 6 月 3 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城鑫月薪定期支付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 6 月 10 日
15	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金受限开放期业务的	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2014 年 6 月 16 日

	公告	金管理人网站	
16	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
17	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金受限开放期业务的公告	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
18	景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金受限开放期业务的公告	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18日
19	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25日
20	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鑫月薪定期支付债券型证券投资基金设立的文件;

- 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。

## 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