景顺长城稳定收益债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:中国银行股份有限公司
送出日期:2014年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城稳定收益债券	
基金主代码	261001	
交易代码	261001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年3月25日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	44,438,805.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类
下属分级基金的交易代码:	261001	261101
报告期末下属分级基金的份额总额	20,497,311.32份	23,941,494.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	资产配置策略:本基金依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策,以及债券市场和股票市场风险收益特征,分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平,预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平,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。 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。
业绩比较基准	中证综合债指数。
风险收益特征	本基金是债券型基金,属于风险程度较低的投资品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	唐州徽
	联系电话	0755-82370388	95566
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年		2012年		2011年3月25日(基金合同生效日)-2011年12月31日	
	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类
本期已实现收益	1,718,385.57	2,698,925.29	7,682,980.13	5,436,171.60	-2,982,481.99	-3,212,152.12
本期利润	39,429.99	840,521.10	12,136,479.33	11,803,170.00	-7,496,247.90	-8,031,651.80
加权平均基金份额本期利润	0.0016	0.0221	0.0753	0.0976	-0.0228	-0.0230
本期基金份额净值增长率	-1.67%	-2.17%	6.47%	6.19%	-2.70%	-3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0093	-0.0015	0.0342	0.0276	-0.0271	-0.0301
期末基金资产净值	20,688,701.89	23,904,491.95	50,939,681.34	85,419,729.03	228,261,056.16	201,237,639.93
期末基金份额净值	1.009	0.998	1.036	1.030	0.973	0.970

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

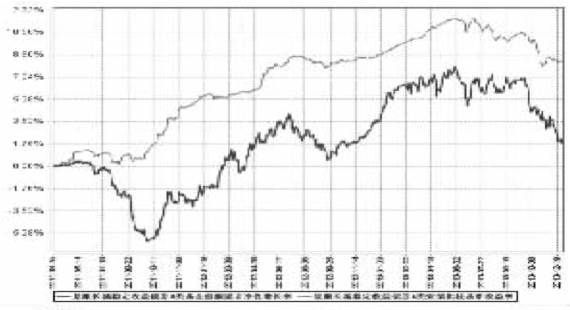
景顺长城稳定收益债券A类

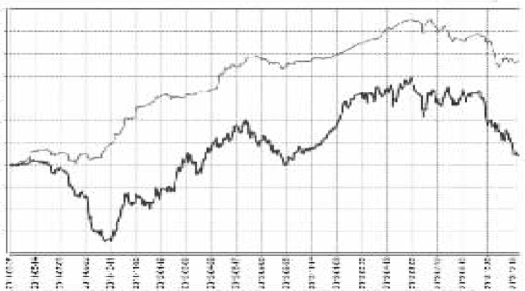
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.63%	0.26%	-1.83%	0.10%	-2.80%	0.16%
过去六个月	-3.35%	0.24%	-2.60%	0.09%	-0.75%	0.15%
过去一年	-1.67%	0.25%	-0.43%	0.08%	-1.24%	0.17%
自基金合同生效起至今	1.87%	0.23%	8.34%	0.08%	-6.47%	0.15%

景顺长城稳定收益债券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
过去三个月	-4.77%	0.25%	-1.83%	0.10%	-2.94%	0.15%
过去六个月	-3.57%	0.24%	-2.60%	0.09%	-0.97%	0.15%
过去一年	-2.17%	0.25%	-0.43%	0.08%	-1.74%	0.17%
自基金合同生效起至今	0.76%	0.23%	8.34%	0.08%	-7.58%	0.15%

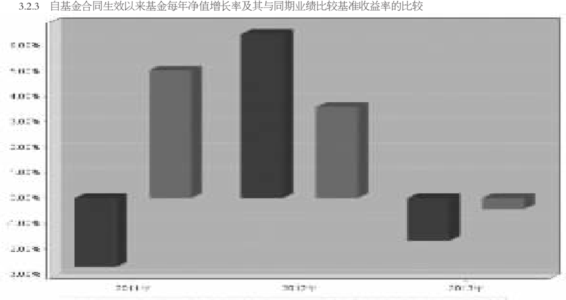
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

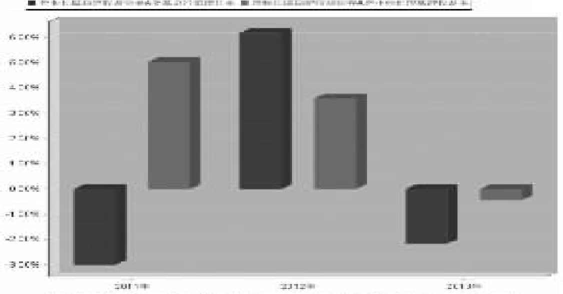




注:本基金的资产配置比例为:本基金投资于债券类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。按照本基金基金合同的规定,本基金的建仓期为自2011年3月25日合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

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





注:2011年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是2011年3月25日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

景顺长城稳定收益债券A类					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.100	314,515.51	82,015.01	396,530.52	
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
合计	0.100	314,515.51	82,015.01	396,530.52	

单位:人民币元

景顺长城稳定收益债券C类					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	0.100	671,419.12	29,372.27	700,791.39	
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
合计	0.100	671,419.12	29,372.27	700,791.39	

§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2013年12月31日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理29只开放式基金,包括管理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(ETF)、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(ETF)、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(ETF)。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		
余春宁	本基金基金经理,景顺长城优信增利债券型证券投资基金基金经理,景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金基金经理	2011年3月25日	-	13	经济学博士。曾任职于中国人民银行深圳特区分行、国家外汇管理局深圳分局深圳外汇经纪中心,也曾担任大鹏证券资金结算部资金经理、招商基金固定收益投资部分析师和基金经理等职务。2010年9月加入本公司,自2011年3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遵规守信情况的说明

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、《景顺长城稳定收益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。本报告期内,本基金持有的19000张国投转债未在最后转股日转股,造成该转债被强制赎回。本公司已于国投转债赎回日当日(2013年7月8日)以自有资金弥补了全部损失,未对基金持有人的利益造成任何损害。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现异常交易情况。

4.3.3 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

2013年全年经济基本面整体仍是弱复苏格局,2013年全年增长7.7%,相比2012年继续回落。在经济数据出现轻微回落的情况下,资金面成为债券市场的主要扰动因素。从统计数据看,4季度7天回购利率均值为4.74%,较3季度均值4.02%的水平上行72BP,并超越"钱荒"发生时的2季度均值4.53%。市场对央行货币政策中性偏紧态度形成一致预期,导致货币市场利率中枢不断抬升,从而对债券形成了较大的负面冲击。全年来看,银行间债券市场价格呈现两段走势:第一阶段是1-5月份的中债收益率曲线缓慢下行,10年期国债收益率整体下行约13BP至3.44%;第二阶段为6-12月份,在准备金备付、国内外流动性收缩、财政缴款延后以及季末因素等多重原因影响下,流动性持续紧张,SHIBOR隔夜利率和SHIBOR7天利率最高分别达到13.44%和11%,中债收益率曲线平坦化上移,二级市场交投大幅萎缩,10年期国债收益率上行约111BP至4.55%。

2013年中债总净价指数下跌4.64%,创2002年以来年度最大跌幅。利率债表现最差,中债国债总净价指数下跌6.48%,中债企业债净价指数下跌2.30%,中标可转债下跌0.86%,短融表现相对最好,中债短融总净价指数仅下跌0.41%。

本基金受累于债券市场整体下跌,净值出现了一定的下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年度,稳定收益A份额净值增长率为-1.67%,低于业绩比较基准收益率1.24%。

2013年度,稳定收益C份额净值增长率为-2.17%,低于业绩比较基准收益率1.74%。

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2014年第1季度的债券市场,我们认为,2014年基本面主线判断为增长相对平稳、通胀温和可控。在地方政府考核新规淡化GDP、增强债务管理,以及货币政策防止金融机构加杠杆和"社会融资规模合理增长"的政策导向下,2014年社会融资规模增速可能进一步回落,经济下行风险增加。货币政策在未看到通胀拐点确认和金融机构杠杆率有所改善的背景下仍会中性偏紧。

利率飙升将推升信用风险,无风险资产的价值在提升。目前利率债绝对估值处于高位,趋势性下行机会需经济基本面下行的支撑。信用债方面,上市公司盈利并未明显改善,审计署地方政府债务审计结果好于市场预期,但近期偿债压力仍偏高。央行货币政策是债市走向关键要素。

总体而言,债券收益率处于历史相对高位,资金面仍维持紧平衡,经济能否持续增长存在不确定性,在货币政策未发生变化前,以短久期的持有配置为主。我们将密切跟踪相关数据并及时对本基金的组合进行灵活调整。

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部、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险控制岗等相关人员。

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,将估值结果以书面形式或双方认可的其他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,由投资部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。风险控制人员根据投资部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部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

本基金管理人尚未与定价服务机构签署任何协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至2012年12月31日,本基金A类份额期末可供分配利润为1,682,022.26元,根据基金合同约定本次应分配金额为168,202.23元;本基金C类份额期末可供分配利润为2,289,854.84元,根据基金合同约定本次应分配金额为228,985.48元,本基金的基金管理人已于2013年1月18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。

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对本基金A类份额暂不实施利润分配;报告期内本基金C类份额未满足收益分配条件,故不进行利润分配。

§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,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在景顺长城稳定收益债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

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

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:景顺长城稳定收益债券型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款		102,965.76	441,454.93
结算备付金		1,928,492.43	1,907,019.54
存出保证金		1,661.51	6,138.95
交易性金融资产		53,502,268.80	172,080,920.40
其中:股票投资		1,364,350.00	1,930,500.00
基金投资		-	-
债券投资		52,137,918.80	160,150,420.40
资产支持证券投资		-	10,000,000.00
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	1,133,597.78
应收利息		1,334,706.92	3,121,371.97
应收股利		-	-
应收申购款		4,015,138.13	325,522.46
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		60,885,233.55	179,016,026.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		15,999,872.50	41,799,730.30
应付证券清算款		6,453.16	-
应付赎回款		44,452.24	501,872.94
应付管理人报酬		25,063.67	71,185.21
应付托管费		7,161.06	20,338.65
应付销售服务费		6,993.16	22,676.51
应付交易费用		1,256.85	8,163.46
应交税费		37,289.68	32,550.88
应付利息		4,473.66	20,116.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		159,023.73	179,980.91
负债合计		16,292,039.71	42,656,615.66
所有者权益:			
实收基金		44,438,805.37	132,097,707.42
未分配利润		154,388.47	4,261,702.95
所有者权益合计		44,593,193.84	136,359,410.37
负债和所有者权益总计		60,885,233.55	179,016,026.03

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额总额44,438,805.37份。其中A类基金份额净值1.009元,基金份额总额20,497,311.32份;C类基金份额净值0.998元,基金份额总额23,941,494.05份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城稳定收益债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		3,242,954.61	30,720,214.25
1.利息收入		3,608,195.37	14,028,981.18
其中:存款利息收入		63,581.44	182,875.29
债券利息收入		3,465,052.29	13,739,411.32
资产支持证券利息收入		79,561.64	33,753.43
买入返售金融资产收入		-	72,941.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,579,283.07	5,677,419.99
其中:股票投资收益		201,217.74	4,692,140.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,303,975.40	768,617.14
资产支持证券投资收益		64,684.93	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,405.00	216,662.43
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-3,537,359.77	10,820,497.60
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		592,835.94	193,315.48
减:二、费用		2,363,003.52	6,780,564.92
1. 管理人报酬		463,874.88	2,017,810.13
2. 托管费		132,535.69	576,517.19
3. 销售服务费		161,752.05	496,808.27
4. 交易费用		6,081.05	119,157.14
5. 利息支出		1,193,737.93	3,151,613.54
其中:卖出回购金融资产支出		1,193,737.93	3,151,613.54
6. 其他费用		405,021.92	418,658.65
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		879,951.09	23,939,649.33
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		879,951.09	23,939,649.33

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城稳定收益债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	132,097,707.42	4,261,702.95	136,359,410.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	879,951.09	879,951.09
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)	-87,658,902.05	-3,889,943.66	-91,548,845.71
其中:1.基金申购款	46,012,672.05	2,095,755.90	48,108,427.95
2.基金赎回款	-133,671,574.10	-5,985,699.56	-139,657,273.66
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)	-	-1,097,321.91	-1,097,321.91
五、期末所有者权益(基金净值)	44,438,805.37	154,388.47	44,593,193.84
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	442,089,416.78	-12,590,720.69	429,498,696.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,939,649.33	23,939,649.33
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)	-309,991,709.36	-7,087,225.69	-317,078,935.05
其中:1.基金申购款	409,340,764.64	-1,638,882.21	407,701,882.43
2.基金赎回款	-719,332,474.00	-5,448,343.48	-724,780,817.48
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)	132,097,707.42	4,261,702.95	136,359,410.37

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城稳定收益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[2011]第126号《关于核准景顺长城稳定收益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《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,574,028,394.28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(2011)第096号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》于2011年3月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,574,216,961.79份基金份额,其中认购资金利息折合188,567.51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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《景顺长城稳定收益债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城稳定收益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。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城稳定收益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和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、A股股票(包括中小板、创业板及其它经中国证监会核准上市的股票)以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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%,投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,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%。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数。

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3月25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》、《景顺长城稳定收益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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本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。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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,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。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	463,874.88	2,017,810.13
其中:支付销售机构的客户维护费	164,305.00	513,197.69

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0.7%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X0.7%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	132,535.69	576,517.19

注:支付基金托管人中国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X0.2%/当年天数。

7.4.8.2.3 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 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	24,244.61	24,244.61
中国银行	-	130,025.94	130,025.94
长城证券	-	210.69	210.69
合计	-	154,481.24	154,481.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	32,260.52	32,260.52
中国银行	-	418,694.89	418,694.89
长城证券	-	226.01	226.01
合计	-	451,181.42	451,181.42

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

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.4%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	11,620,000.00	977.43
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	20,666,098.24	-	-	71,860,000.00	72,695.86

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行	102,965.76	19,314.39	441,454.93	76,925.64

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本期末2013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4,999,872.50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
120316	12进出16	2014年1月2日	96.67	50,000	4,833,500.00
合计				50,000	4,833,500.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末2013年12月31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11,000,000.00元,于2014年1月2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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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2013年12月31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29,572,268.80元,属于第二层级的余额为23,930,000.00元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级80,580,920.40元,第二层级91,500,000.00,无第三层级)。

(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) 截至2013年12月31日,本基金的资产净值为人民币44,593,193.84元,已连续超过20个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元。本基金的基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《证券投资基金运作管理办法》第四十四条的规定,向中国证监会说明原因和报送解决方案。本基金的基金管理人将积极采取开展持续营销、加大宣传力度、提高投研能力等措施,尽快扭转这一状况。

(3) 除上述(1)和(2)所述事项外,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	1,364,350.00	2.24
	其中:股票	1,364,350.00	2.24
2	固定收益投资	52,137,918.80	85.63
	其中:债券	52,137,918.80	85.63
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	2,031,458.19	3.34
6	其他各项资产	5,351,506.56	8.79
7	合计	60,885,233.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,364,350.00	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,364,350.00	3.06

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002250	联化科技	65,000	1,364,350.00	3.06

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600521	华海药业	24,500.00	0.02

注:买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002250	联化科技	811,672.10	0.60
2	600521	华海药业	33,020.00	0.02

注:卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	24,500.00
卖出股票收入(成交)总额	844,692.10

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均按买卖股票成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,300,690.00	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,667,000.00	21.68
	其中:政策性金融债	9,667,000.00	21.68
4	企业债券	24,069,403.40	53.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	16,100,825.40	36.11
8	其他	-	-
9	合计	52,137,918.80	116.92

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	1280004	12乌经开债	100,000	10,271,000.00	23.03
2	120316	12进出16	100,000	9,667,000.00	21.68
3	122157	12广控01	57,080	5,392,918.40	12.09
4	110015	石化转债	45,000	4,291,200.00	9.62
5	110020	南山转债	45,300	4,128,189.00	9.26

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1

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

8.10.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.10.3 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	1,661.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,334,706.92
5	应收申购款	4,015,138.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,351,506.56

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	4,291,200.00	9.62
2	110020	南山转债	4,128,189.00	9.26
3	110016	川投转债	3,744,199.20	8.40
4	110022	同仁转债	2,498,800.00	5.60

8.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
景顺长城稳定收益债券A类	805	25,462.50	9,957,855.82	48.58%	10,539,455.50	51.42%
景顺长城稳定收益债券C类	845	28,333.13	6,008,056.03	25.09%	17,933,438.02	74.91%
合计	1,650	26,932.61	15,965,911.85	35.93%	28,472,893.52	64.07%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城稳定收益债券A类	5,645.68	0.03%
	景顺长城稳定收益债券C类	-	-
	合计	5,645.68	0.01%

注:1、分级基金管理人的从业人员持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、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。

3、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	景顺长城稳定收益债券A类	景顺长城稳定收益债券C类
基金合同生效日(2011年3月25日)基金份额总额	613,614,442.62	960,602,519.17
本报告期期初基金份额总额	49,148,753.99	82,948,953.43
本报告期基金总申购份额	31,546,442.91	14,466,229.14
减:本报告期基金总赎回份额	60,197,885.58	73,473,688.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,497,311.32	23,941,494.05

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。

§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

1、本基金管理人于2013年5月7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Xie Sheng(谢生)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。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。

2、2013年3月17日本基金托管人中国银行股份有限公司公告,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。2013年6月1日中国银行股份有限公司公告,自2013年5月31日起,田国立先生就任中国银行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内,本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续3年为本基金提供审计服务,本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币50,000.00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	
中国银河证券股份有限公司	2	811,672.10	96.09%	739.02	96.09%	-
申银万国证券股份有限公司	1	33,020.00	3.91%	30.06	3.91%	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下:

1)选择标准

a、资金实力雄厚,信誉良好;

b、财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

c、经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;

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

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

2)选择程序

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

2、本基金本期交易单元未变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	15,877,845.61	6.43%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	220,734,853.34	89.44%	5,547,300,000.00	100.00%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	10,178,000.00	4.12%	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

景顺长城基金管理有限公司
2014年3月26日