

# 景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2018 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 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。

自 2018 年 6 月 20 日起原景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金转型为景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金。原景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 19 日止，景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金本报告期自 2018 年 6 月 20 日起至 2018 年 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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	11
3.3 其他指标.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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.....	20
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b> .....	<b>21</b>
6.1 资产负债表.....	21
6.2 利润表.....	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
6.4 报表附注.....	24
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b> .....	<b>43</b>
6.1 资产负债表.....	43
6.2 利润表.....	44
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	45
6.4 报表附注.....	46
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b> .....	<b>63</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	63
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	63
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.....	63

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.11 投资组合报告附注.....	65
<b>§7 投资组合报告（转型前）.....</b>	<b>66</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	66
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	66
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.....	66
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	68
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.....	68
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.....	68
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.....	68
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.11 投资组合报告附注.....	69
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>	<b>70</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>72</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>73</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>74</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	76
10.8 其他重大事件（转型后）.....	76
10.8 其他重大事件（转型前）.....	77
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>82</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>84</b>

12.1 备查文件目录.....	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金
基金简称	景顺长城景瑞双利债券
场内简称	无
基金主代码	003315
交易代码	003315
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	16,597,929.41 份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金
基金简称	景顺长城景瑞双利定期开放债券
场内简称	无
基金主代码	003315
交易代码	003315
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,888,221.58 份
基金合同存续期	2017 年 1 月 25 日至 2018 年 6 月 19 日

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险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	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、固定收益类资产投资策略、权益资产投资策略，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。 1、资产配置策略

	<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、权益类等大类资产的预期收益率水平，结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析，进行大类资产配置。</p> <p>2、固定收益类资产投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>3、权益资产投资策略</p> <p>本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的的。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率× 90%+ 沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	<p>本基金主要通过投资于固定收益品种，同时适当投资于具备良好盈利能力的上市公司所发行的股票，在严格控制风险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。</p>
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、固定收益类资产投资策略、权益资产投资策略，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</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、权益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</p> <p>为合理控制本基金自由开放期的流动性风险，并满足每次自由开放期的流动性需求，本基金在每个运作周期将适当的采取期限配置策略，即将基金资产所投资标的的平均剩余存续期限与基金剩余运作周期进行适当的匹配。</p> <p>3、固定收益类资产投资策略</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债、分</p>

	<p>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>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、权益资产投资策略</p> <p>本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，本基金将从定性及定量两个方面加以考察分析投资标的的。</p>
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	曾麓燕
	联系电话	0755-82370388	021-52629999-212040
	电子邮箱	investor@igwfm.com	015292@cib.com.cn
客户服务电话		4008888606	95561
传真		0755-22381339	021-62535823
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	福州市湖东路154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	上海江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		518048	200041
法定代表人		杨光裕	高建平

### 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、基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
本期已实现收益	4,594.84
本期利润	32,844.84
加权平均基金份额本期利润	0.0019
本期加权平均净值利润率	0.18%
本期基金份额净值增长率	0.19%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018 年 6 月 30 日
期末可供分配利润	807,912.81
期末可供分配基金份额利润	0.0487
期末基金资产净值	17,550,389.88
期末基金份额净值	1.0573
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018 年 6 月 30 日
基金份额累计净值增长率	0.19%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

5、本基金转型后基金合同生效日为 2018 年 6 月 20 日。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
本期已实现收益	4,723,407.05
本期利润	2,049,977.38
加权平均基金份额本期利润	0.0359
本期加权平均净值利润率	3.43%
本期基金份额净值增长率	1.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018 年 6 月 19 日
期末可供分配利润	865,753.82
期末可供分配基金份额利润	0.0484
期末基金资产净值	18,879,118.09

期末基金份额净值	1.0553
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年6月19日
基金份额累计净值增长率	5.53%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

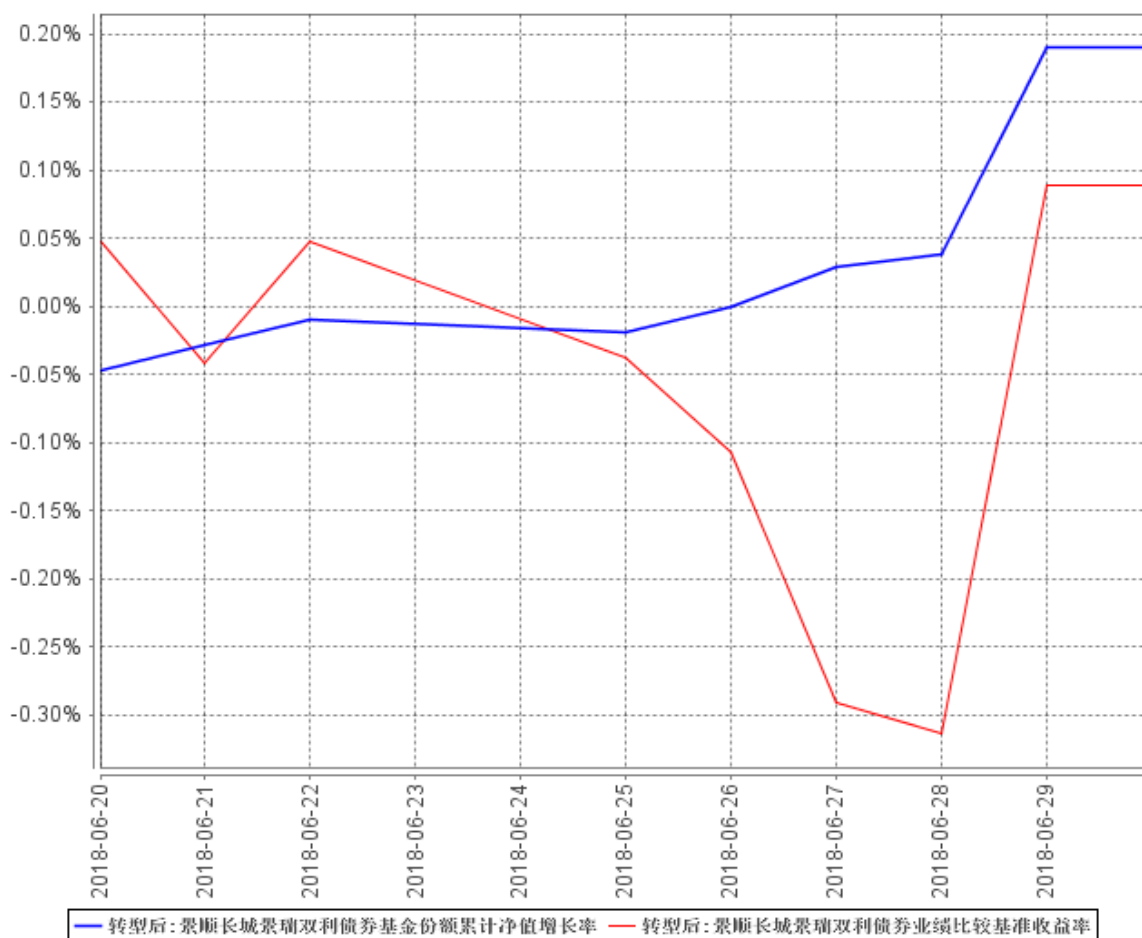
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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
自基金合同生效起至今	0.19%	0.05%	0.09%	0.17%	0.10%	-0.12%

### 3.2.2 自基金转型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：因景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金（以下简称“景瑞双利定期开放债券基金”）触发基金合同约定的转型条款，该基金自 2018 年 6 月 20 日转型为景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金（以下简称“景瑞双利债券基金”）。

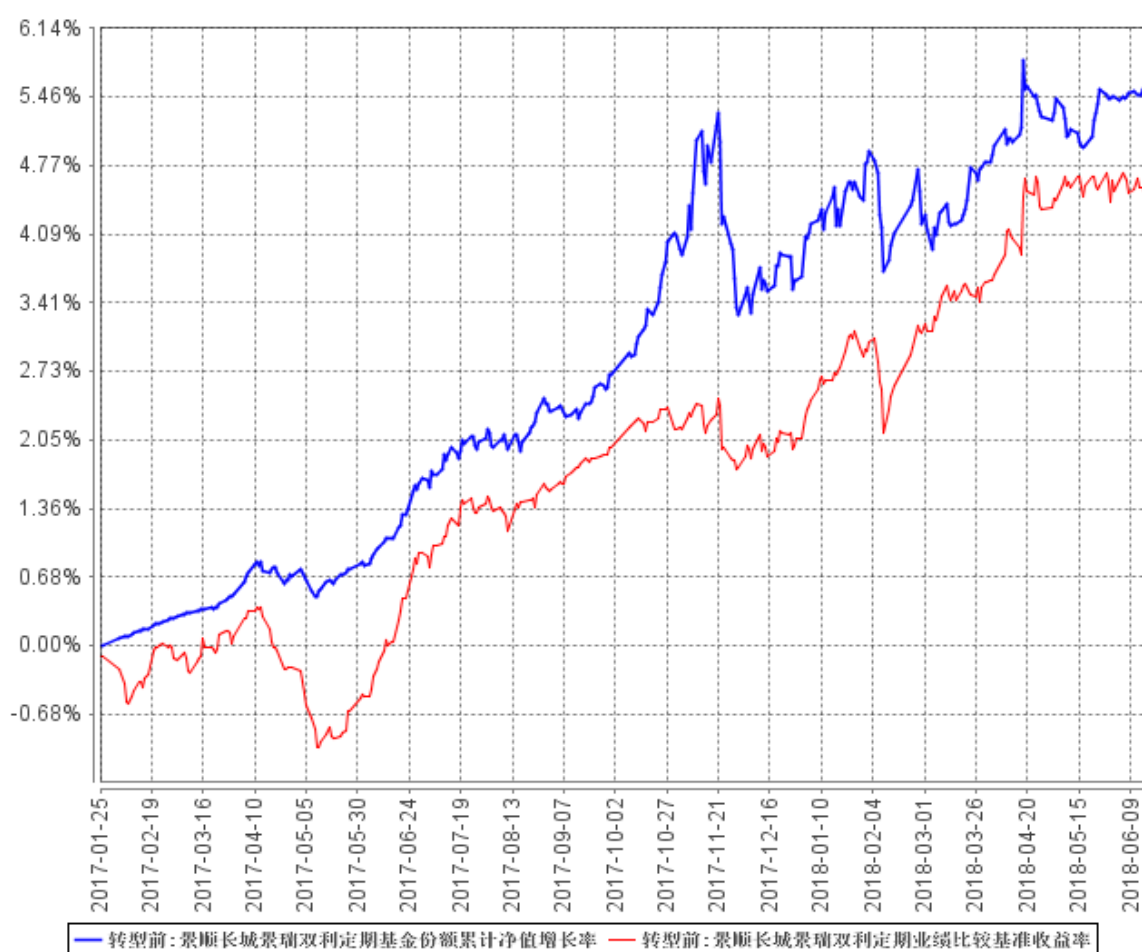
转型后的景瑞双利债券基金资产配置比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。转型后，截至本报告期末，景瑞双利债券基金仍处于建仓期。景瑞双利债券基金合同生效日（2018 年 6 月 20 日）起至本报告期末不满一年。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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	0.08%	0.03%	-0.32%	0.10%	0.40%	-0.07%
过去三个月	0.69%	0.12%	0.66%	0.13%	0.03%	-0.01%
过去六个月	1.80%	0.15%	2.19%	0.12%	-0.39%	0.03%
过去一年	3.80%	0.15%	3.34%	0.10%	0.46%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.53%	0.13%	4.29%	0.10%	1.24%	0.03%

### 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：本基金投资组合的比例范围为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%（自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制），股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受前述 5% 的限制。本基金的建仓期为自 2017 年 1 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至2018年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理70只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛

双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
成念良	本基金的基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	9 年	管理学硕士。曾担任大公国际资信评级有限公司评级部高级信用分析师，平安大华基金投研部信用研究员、专户业务部投资经理。2015 年 9 月加入本公司，自 2015 年 12 月起担任固定收益部基金经理。

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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
成念良	本基金的基金经理	2017 年 1 月 25 日	-	9 年	管理学硕士。曾担任大公国际资信评级有限公司评级部

					高级信用分析师，平安大华基金投研部信用研究员、专户业务部投资经理。2015 年 9 月加入本公司，自 2015 年 12 月起担任固定收益部基金经理。
--	--	--	--	--	---

## 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 65 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易和反向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券收益率高位趋势下行，经济预期走弱及货币持续宽松是主要触发因素，其中也有



资管新规和美债上行等因素阶段性干扰。具体看，1 季度受开工较晚影响，工业生产有所回落，但大宗价格维持在高位；2 季度开工恢复且外需向好，生产较为强劲，四、五月 PMI 指数中的生产指数、新订单指数均企稳反弹，带动工业品价格指数维持在高位。但代表预期的货币条件和信用条件均在收紧，M2 增速下行到 8.0% 的低位，社融增速持续下行，市场对未来经济走势较为悲观。为了对冲货币信用收缩，央行货币政策转向，实施了两次降准，同时公开市场投放也较为积极，政策微调带来了明显效果，货币市场持续宽松。债券收益率在一月份见顶后呈现持续下行趋势，但五月份也出现了一波收益率反弹，主要是资管新规出台后市场的抛售行为以及期间十年期美债收益率持续上行到 3% 以上对国内阶段性影响。截至 6 月 30 日，10 年期国债和国开债的收益率分别下行 41BP、57BP 至 3.48% 和 4.25%；1 年 AAA 短融、3 年期 AA+ 中票、5 年期 AA+ 中票分别下行 67BP、63BP 和 59BP 至 4.54%、4.91% 和 5.08%。

权益市场方面，年初在资金面宽松以及人民币升值的环境下，风险偏好有所抬升，A 股市场经历了短暂的连续快速上涨，市场情绪高涨，家电、白酒、房地产、银行等热门板块持续受到追捧。短暂的乐观后，在资管新规落地和海外经济超预期带来的全球货币超预期收紧的担忧中，市场很快转为快速下跌。随后市场风险偏好持续降低，一方面，美联储处于货币紧缩通道中，人民币汇率承压，加上贸易战反复胶着进一步制约 A 股市场风险偏好。另一方面，2 季度信用风险事件的暴露，引发了紧信用环境下对经济下行压力的担忧。而后，随着市场的快速下行，股权质押风险再次成为市场关注的焦点。整体看，上半年各指数全线下跌，上证综指、沪深 300、创业板指分别下跌 13.90%、12.90% 和 8.33%。可转债市场亦跟随正股下跌，中证转债指数下跌 2.17%。

上半年组合在债券上的操作较为积极，基于信用收缩趋势和名义增速的持续回落预期，长期利率债具备配置价值，通过增加利率债配置拉长组合久期；同时信用收缩及资管新规出台背景下，信用环境仍不乐观，将组合的信用资质进一步上移。权益方面保持相对谨慎。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

基金转型后，2018 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日，本基金份额净值增长率为 0.19%，业绩比较基准收益率为 0.09%；

基金转型前，2018 年 1 月 1 日至 6 月 19 日（基金最后运作日），本基金份额净值增长率为 1.80%，业绩比较基准收益率为 2.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济依然存在下行压力。首先信用收缩的影响在未来一个季度将会逐渐显现，而且中美贸易战、基建下台阶、地产调控不放松等负面因素会进一步拖累经济；其次 PPI 指数高

点已过，翘尾因素减弱及新涨价因素缩窄均指向名义经济增长在未来两个季度确定性的下行。货币政策有进一步宽松的空间，旨在对冲中美贸易战不确定性、资管新规落地后银行资产回表风险、美国加息背景下外汇占款外流的压力，但节奏和力度可能会有所控制；而信用收缩导致信用风险上升，预计未来风险事件将持续暴露。债券方面，利率债在名义 GDP 高点已现背景下，利率中枢将下行，虽然在金融监管及去杠杆政策持续推进的过程中，3 季度供需关系稍有不和，但政策面和基本面对利率债相对更友好，调整即可增加仓位。信用债则面临更为错综复杂的市场环境，违约风险可能进一步扩散，中低等级信用债利差走扩压力仍然存在。组合投资策略上，坚持中高等级信用债辅以杠杆操作的策略，同时利率债具备较高配置价值，但需要注重波段操作。

权益市场方面，我们依然认为趋势性行情在当前内忧外患的格局下难现，经济数据仍有待下行，上市公司盈利存在下修空间，短期对市场保持谨慎，控制仓位。但另一方面，几个前期制约市场的重要因素已出现改善。虽然紧信用环境短期难以彻底改变，去杠杆仍会坚决执行，但至少货币政策宽松信号已明确，财政政策方向上亦不会更紧，对于符合政策方向的中小企业融资环境边际上也会有所改善。当前股价已经反应了前述悲观预期，且风险偏好已经降至极低范围，部分优质公司受经济环境影响较小，且经过调整估值已具有一定吸引力，在风险释放充分后值得积极把握。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员

会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

从 2018 年 1 月 31 日至 2018 年 6 月 19 日（基金转型前），景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金在第一次自由开放期的最后一日（2018 年 1 月 31 日）日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况，触发了《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定的转型条款。自 2018 年 6 月 20 日起，景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金转型为景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金。

## §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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	91,724.49
结算备付金		294,518.52
存出保证金		16,739.97
交易性金融资产	6.4.7.2	18,653,300.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		18,653,300.00
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	249,760.17
应收股利		-
应收申购款		9.94
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		19,306,053.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 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		1,500,000.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		52,718.65
应付管理人报酬		10,989.95
应付托管费		3,139.99
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	597.49
应交税费		-
应付利息		698.64

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	187,518.49
负债合计		1,755,663.21
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	16,597,929.41
未分配利润	6.4.7.10	952,460.47
所有者权益合计		17,550,389.88
负债和所有者权益总计		19,306,053.09

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0573 元，基金份额总额 16,597,929.41 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
<b>一、收入</b>		51,216.78
1. 利息收入		22,966.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	204.32
债券利息收入		22,762.46
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
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	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	28,250.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
<b>减：二、费用</b>		18,371.94

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,784.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,081.37
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	-
5. 利息支出		1,568.56
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	11,937.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>32,844.84</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>32,844.84</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 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)	17,888,221.58	990,896.51	18,879,118.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,844.84	32,844.84
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)	-1,290,292.17	-71,280.88	-1,361,573.05
其中：1. 基金申购款	18.84	1.04	19.88
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-1,290,311.01	-71,281.92	-1,361,592.93
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)	16,597,929.41	952,460.47	17,550,389.88

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：

\_\_\_\_\_  
康乐

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
吴建军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
邵媛媛

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1771 号《关于准予景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 211,682,802.85 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 027 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 212,008,523.41 份基金份额,其中认购资金利息折合 325,720.56 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需要符合中国证监会的相关规定。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制),股票、权证等收益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%,其中,本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内,本基金持有现或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,封闭期内不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中证综合债指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

本基金以定期开放的方式运作。每个运作周期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一自由开放期结束之日次日起(包括该日)12 个月的期间。本基金开放期分为受限开放期和自由开放期,其它时间为封闭期,每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作,共包含为两个封闭期和一个受限开放期;本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期。封闭期内本基金不接受基金份额的申购和赎回,亦不上市交易。

由本基金基金管理人于 2018 年 6 月 20 日发布《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金



合同》生效的公告，本基金于 2018 年 6 月 20 日转型为普通开放式基金，转型后基金名称相应变更为“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”，并于 6 月 20 日开放本基金的日常申购、赎回业务。

转型后根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括债券（包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。转型后本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率× 90%+ 沪深 300 指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2018 年 8 月 23 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日止期间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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2018 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 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间。

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

### 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

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

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

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

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

#### 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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按

照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	91,724.49
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	91,724.49

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,617,870.40	5,429.60
	银行间市场	10,049,900.00	-19,900.00
	合计	18,667,770.40	-14,470.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	18,667,770.40	18,653,300.00	-14,470.40
----	---------------	---------------	------------

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本基金本报告期末的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

本基金于本报告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 2018年6月30日
应收活期存款利息	42.94
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	119.25
应收债券利息	249,591.23
应收资产支持证券利息	-
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	6.75
合计	249,760.17

### 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 2018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	597.49



合计	597.49
----	--------

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	187,518.49
合计	187,518.49

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	17,888,221.58	17,888,221.58
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	18.84	18.84
本期赎回(以“-”号填列)	-1,290,311.01	-1,290,311.01
本期末	16,597,929.41	16,597,929.41

注：本基金转型后，于2018年6月20日开放日常申购、赎回业务。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：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	865,753.82	125,142.69	990,896.51
本期利润	4,594.84	28,250.00	32,844.84
本期基金份额交易产生的变动数	-62,435.85	-8,845.03	-71,280.88
其中：基金申购款	0.91	0.13	1.04
基金赎回款	-62,436.76	-8,845.16	-71,281.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	807,912.81	144,547.66	952,460.47

**6.4.7.11 存款利息收入**

项目	本期 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	50.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	145.71
其他	8.46
合计	204.32

**6.4.7.12 股票投资收益**

本基金本报告期内无股票买卖差价收入。

**6.4.7.13 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28,250.00
——股票投资	-
——债券投资	28,250.00
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	28,250.00

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月20日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	1,808.18
信息披露费	9,041.01
债券托管账户维护费	1,088.00
合计	11,937.19

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
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	
	2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	3,784.82	
其中：支付销售机构的客户维护费	1,658.60	

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 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	1,081.37	

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/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**

本基金的基金管理人于本报告期末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	
	2018 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	91,724.49	50.15

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2018 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,500,000.00 元，于 2018 年 7 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。

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

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

##### 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导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：75.20%）。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监

会认定的特殊投资组合不受该比例限制), 由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内, 对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制, 并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018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	91,724.49	0.00	0.00	0.00	0.00	-	91,724.49
结算备付金	294,518.52	-	-	-	-	-	294,518.52
存出保证金	16,739.97	-	-	-	-	-	16,739.97
交易性金融资产	0.00	0.00	13,543,300.00	5,110,000.00	0.00	0.00	18,653,300.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	249,760.17	249,760.17
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	0.00	-	-	-	-	9.94	9.94
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	402,982.98	0.00	13,543,300.00	5,110,000.00	0.00	249,770.11	19,306,053.09
负债							
卖出回购金融资产款	1,500,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	1,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	52,718.65	52,718.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,989.95	10,989.95
应付托管费	-	-	-	-	-	3,139.99	3,139.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	597.49	597.49
应付利息	-	-	-	-	-	698.64	698.64
应交税费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	187,518.49	187,518.49
负债总计	1,500,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	255,663.21	1,755,663.21
利率敏感度缺口	-1,097,017.02	0.00	13,543,300.00	5,110,000.00	0.00	-	-

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（2018年6月30日）
	市场利率下降 25 个基点	60,546.22
	市场利率上升 25 个基点	-60,315.72



#### 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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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 2018 年 6 月 30 日	
	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	-	-
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	0.00	0.00

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2018 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	0.00
	沪深 300 指数下降 5%	0.00

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 18,653,300.00 元，无属于第一层次，第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 19 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	56,021.46	496,012.26
结算备付金		294,518.52	523,343.09
存出保证金		16,739.97	28,877.52
交易性金融资产	6.4.7.2	18,625,050.00	189,705,568.46
其中：股票投资		-	19,988,100.72
基金投资		-	-
债券投资		18,625,050.00	169,717,467.74
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	-	20,018,270.03
应收证券清算款		100,000.00	-
应收利息	6.4.7.5	237,202.37	3,516,203.26
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		19,329,532.32	214,288,274.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 19 日</b>	<b>上年度末 2017 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		100,000.00	1,000,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		164,971.69	-
应付管理人报酬		7,205.13	126,550.84
应付托管费		2,058.62	36,157.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	597.49	60,769.63
应交税费		-	-
应付利息		-	1,130.97

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	175,581.30	69,000.00
负债合计		450,414.23	1,293,608.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	17,888,221.58	205,471,845.88
未分配利润	6.4.7.10	990,896.51	7,522,819.93
所有者权益合计		18,879,118.09	212,994,665.81
负债和所有者权益总计		19,329,532.32	214,288,274.62

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 19 日，基金份额净值 1.0553 元，基金份额总额 17,888,221.58 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日(基金最后运作日)止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		2,553,593.57	4,978,637.82
1. 利息收入		1,369,299.58	3,886,543.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	87,995.73	1,031,537.54
债券利息收入		1,102,308.23	2,634,145.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		178,995.62	220,859.92
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,857,723.66	-102,633.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,968,389.22	-228,951.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-104,308.06	109,115.57
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-6,357.50	17,202.24
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,673,429.67	1,194,728.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-

列)			
<b>减：二、费用</b>		503,616.19	1,426,474.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	186,218.97	637,997.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	53,205.44	182,284.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	68,079.75	28,313.32
5. 利息支出		4,147.59	409,144.48
其中：卖出回购金融资产支出		4,147.59	409,144.48
6. 税金及附加		2,154.78	-
7. 其他费用	6.4.7.19	189,809.66	168,734.04
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,049,977.38	3,552,163.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,049,977.38	3,552,163.66

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 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）	205,471,845.88	7,522,819.93	212,994,665.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,049,977.38	2,049,977.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-187,583,624.30	-8,581,900.80	-196,165,525.10
其中：1. 基金申购款	11,533.45	517.22	12,050.67
2. 基金赎回款	-187,595,157.75	-8,582,418.02	-196,177,575.77
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）	17,888,221.58	990,896.51	18,879,118.09
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	212,008,523.41	-	212,008,523.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,552,163.66	3,552,163.66
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	212,008,523.41	3,552,163.66	215,560,687.07

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第1771号《关于准予景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币211,682,802.85元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第027号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为212,008,523.41份基金份额,其中认购资金利息折合325,720.56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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基

金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括债券(包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、可转换债券(含分离型可转换债券)及其他经中国证监会允许投资的债券)、中央银行票据、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、同业存单、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、通知存款、定期存款)等。本基金同时投资于国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需要符合中国证监会的相关规定。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%(自由开放期开始前一个月至自由开放期结束后一个月内不受此比例限制)，股票、权证等收益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。任一开放期内，本基金持有现或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，封闭期内不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

本基金以定期开放的方式运作。每个运作周期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一自由开放期结束之日次日起(包括该日)12 个月的期间。本基金开放期分为受限开放期和自由开放期，其它时间为封闭期，每个运作周期以封闭期和受限开放期相交替的方式运作，共包含为两个封闭期和一个受限开放期；本基金在相邻两个运作周期之间设置自由开放期。封闭期内本基金不接受基金份额的申购和赎回，亦不上市交易。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2018 年 8 月 23 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日(基金最后运作日)止期间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 2018 年 6 月 19 日(基金最后运作日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日(基金最后运作日)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

本基金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

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收



入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 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 2018 年 6 月 19 日
活期存款	56,021.46
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	56,021.46

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 19 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,617,870.40	8,607,050.00
	银行间市场	10,049,900.00	10,018,000.00
	合计	18,667,770.40	18,625,050.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,667,770.40	18,625,050.00	-42,720.40

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本期末的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 2018年6月19日
应收活期存款利息	10,009.51
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	260.37
应收债券利息	226,828.77
应收资产支持证券利息	-
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	103.72
合计	237,202.37

#### 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 2018年6月19日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	597.49
合计	597.49

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月19日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	175,581.30
合计	175,581.30

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月19日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,471,845.88	205,471,845.88
本期申购	11,533.45	11,533.45
本期赎回（以“-”号填列）	-187,595,157.75	-187,595,157.75
- 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	17,888,221.58	17,888,221.58

注：1、根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《景顺长城景瑞双利定期开放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，其他时间为封闭期。根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金第一次受限开放期业务的公告》，本次受限开放期的时间为2018年1月25日至1月31日；

2、根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于转型前（2018年5月22日至6月19日）开放赎回；

3、本基金其他时间封闭运作。

**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
上年度末	4,939,203.68	2,583,616.25	7,522,819.93
本期利润	4,723,407.05	-2,673,429.67	2,049,977.38
本期基金份额交易产	-8,796,856.91	214,956.11	-8,581,900.80

生的变动数			
其中：基金申购款	573.26	-56.04	517.22
基金赎回款	-8,797,430.17	215,012.15	-8,582,418.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	865,753.82	125,142.69	990,896.51

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
活期存款利息收入	60,605.28
定期存款利息收入	24,888.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,281.78
其他	219.78
合计	87,995.73

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
卖出股票成交总额	29,061,980.38
减：卖出股票成本总额	25,093,591.16
买卖股票差价收入	3,968,389.22

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月19日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	187,480,301.08
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	183,163,059.46
减：应收利息总额	4,421,549.68
买卖债券差价收入	-104,308.06

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益发生额为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
股票投资产生的股利收益	-6,357.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	-6,357.50

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
1. 交易性金融资产	-2,673,429.67
——股票投资	-2,722,076.56
——债券投资	48,646.89
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,673,429.67

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本期其他收入发生额为零。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
交易所市场交易费用	66,854.75
银行间市场交易费用	1,225.00
合计	68,079.75

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日
审计费用	27,944.60
信息披露费	139,724.70
债券托管账户维护费	17,512.00

银行划款手续费	4,628.36
合计	189,809.66

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 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

### 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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应付关联方佣金。

### 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月19日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	186,218.97	637,997.36
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	69,282.41	199,362.85

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 0.70% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	53,205.44		182,284.96	

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 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

本基金本期及上年度可比期间均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自有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人本期和上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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和上年度末均未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 19 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	56,021.46	60,605.28	1,061,016.56	26,056.50

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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

本基金本期和上年度可比期间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

本基金本期未进行利润分配。

## **6.4.12 期末（2018 年 6 月 19 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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票**

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**

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 6 月 19 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000.00 元，于 2018 年 6 月 20 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由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

### **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导致基金资产损失和收益变化的风险。

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



的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：75.20%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 19 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	56,021.46	0.00	0.00	0.00	0.00	-	56,021.46
结算备付金	294,518.52	-	-	-	-	-	294,518.52
存出保证金	16,739.97	-	-	-	-	-	16,739.97

交易性金融资产	0.00	0.00	13,519,050.00	5,106,000.00	0.00	0.00	18,625,050.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	237,202.37	237,202.37
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	0.00	-	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	367,279.95	0.00	13,519,050.00	5,106,000.00	0.00	337,202.37	19,329,532.32
负债							
卖出回购金融资产款	100,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	100,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	164,971.69	164,971.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,205.13	7,205.13
应付托管费	-	-	-	-	-	2,058.62	2,058.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	597.49	597.49
应付利息	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	175,581.30	175,581.30
负债总计	100,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	350,414.23	450,414.23
利率敏感度缺口	267,279.95	0.00	13,519,050.00	5,106,000.00	0.00	-	-
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	496,012.26	-	-	-	-	-	496,012.26
结算备付金	523,343.09	-	-	-	-	-	523,343.09
存出保证金	28,877.52	-	-	-	-	-	28,877.52
交易性金融资产	99,922,000.00	30,097,000.00	20,183,203.04	9,960,264.70	9,555,000.00	19,988,100.72	189,705,568.46
买入返售金融资产	20,018,270.03	-	-	-	-	-	20,018,270.03
应收利息	-	-	-	-	-	3,516,203.26	3,516,203.26
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	120,988,502.90	30,097,000.00	20,183,203.04	9,960,264.70	9,555,000.00	23,504,303.98	214,288,274.62
负债							
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	126,550.84	126,550.84
应付托管费	-	-	-	-	-	36,157.37	36,157.37
应付交易费用	-	-	-	-	-	60,769.63	60,769.63
应付利息	-	-	-	-	-	1,130.97	1,130.97
其他负债	-	-	-	-	-	69,000.00	69,000.00
负债总计	1,000,000.00	-	-	-	-	293,608.81	1,293,608.81
利率敏感度缺口	119,988,502.90	30,097,000.00	20,183,203.04	9,960,264.70	9,555,000.00	23,210,695.17	212,994,665.81

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（2018年6月19日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	89,342.26	272,703.41
市场利率上升 25 个基点	-88,997.63	-267,997.92	

#### 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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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 2018年6月19日		上年度末 2017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	-	-	19,988,100.72	9.38
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	19,988,100.72	9.38

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月）	上年度末（2017年12月）

	19 日)	31 日)
沪深 300 指数上升 5%	0.00	1,215,380.55
沪深 300 指数下降 5%	0.00	-1,215,380.55

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 19 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 18,625,050.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日，第一层次的余额为 20,134,568.46 元，属于第二层次的余额为 169,571,000.00 元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 19 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2017 年 12 月 31 日：无）。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告（转型后）

### 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,653,300.00	96.62
	其中：债券	18,653,300.00	96.62
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	386,243.01	2.00
8	其他各项资产	266,510.08	1.38
9	合计	19,306,053.09	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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	5,110,000.00	29.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,543,300.00	77.17
	其中：政策性金融债	13,543,300.00	77.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,653,300.00	106.28

## 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	180404	18 农发 04	100,000	10,030,000.00	57.15
2	010107	21 国债(7)	50,000	5,110,000.00	29.12
3	018005	国开 1701	35,000	3,513,300.00	20.02

## 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	16,739.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	249,760.17
5	应收申购款	9.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	266,510.08

**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**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## §7 投资组合报告（转型前）

### 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,625,050.00	96.36
	其中：债券	18,625,050.00	96.36
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	350,539.98	1.81
8	其他资产	353,942.34	1.83
9	合计	19,329,532.32	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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	002304	洋河股份	2,330,048.00	1.09
2	600585	海螺水泥	2,131,375.00	1.00
3	603899	晨光文具	1,489,658.00	0.70

4	000786	北新建材	425,738.00	0.20
5	002572	索菲亚	423,100.00	0.20
6	601088	中国神华	407,025.00	0.19
7	600176	中国巨石	270,729.00	0.13
8	601318	中国平安	268,169.00	0.13
9	601601	中国太保	81,725.00	0.04

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	3,455,575.64	1.62
2	601601	中国太保	3,231,663.88	1.52
3	000001	平安银行	2,827,803.34	1.33
4	601318	中国平安	2,719,603.00	1.28
5	000786	北新建材	2,280,441.00	1.07
6	002572	索菲亚	2,179,274.48	1.02
7	600585	海螺水泥	2,175,575.90	1.02
8	600176	中国巨石	2,162,391.00	1.02
9	002304	洋河股份	2,155,995.14	1.01
10	000333	美的集团	2,093,335.60	0.98
11	000568	泸州老窖	1,929,101.00	0.91
12	603899	晨光文具	1,503,111.40	0.71
13	601088	中国神华	348,109.00	0.16

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	7,827,567.00
卖出股票收入（成交）总额	29,061,980.38

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

#### 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	5,106,000.00	27.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,519,050.00	71.61
	其中：政策性金融债	13,519,050.00	71.61
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,625,050.00	98.65

## 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	180404	18 农发 04	100,000	10,018,000.00	53.06
2	010107	21 国债(7)	50,000	5,106,000.00	27.05
3	018005	国开 1701	35,000	3,501,050.00	18.54

## 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	16,739.97
2	应收证券清算款	100,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	237,202.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	353,942.34

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## §8 基金份额持有人信息（转型后）

### 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
467	35,541.60	-	-	16,597,929.41	100.00%

### 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。

## §8 基金份额持有人信息（转型前）

### 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
490	36,506.57	-	-	17,888,221.58	100.00%

### 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(转型后)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	17,888,221.58
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	18.84
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,290,311.01
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)	-
本报告期期末基金份额总额	16,597,929.41

注：本基金转型后，于 2018 年 6 月 20 日开放日常申购、赎回业务。



## §9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	212,008,523.41
本报告期期初基金份额总额	205,471,845.88
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	11,533.45
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	187,595,157.75
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)	-
本报告期期末基金份额总额	17,888,221.58

注：1、根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《景顺长城景瑞双利定期开放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，其他时间为封闭期。根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金第一次受限开放期业务的公告》，本次受限开放期的时间为 2018 年 1 月 25 日至 1 月 31 日；

2、根据《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于转型前（2018 年 5 月 22 日至 6 月 19 日）开放赎回；

3、本基金其他时间封闭运作。

## §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

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2017 年 12 月 29 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意许义明先生辞去本公司总经理一职，聘任康乐先生担任本公司总经理。

2、本基金管理人于 2018 年 2 月 14 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任赵代中先生担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2018 年 5 月 31 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，聘任黎海威先生担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2018 年 6 月 2 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，同意刘奇伟先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 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（转型后）****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	
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	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
兴业证券股份有限公司	-	-	7,200,000.00	100.00%	-	-

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
兴业证券股份有限公司	2	36,889,547.38	100.00%	34,355.47	100.00%	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
兴业证券股份有限公司	32,617,743.17	100.00%	171,100,000.00	100.00%	-	-

## 10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2018年6月20日

2	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》生效的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
5	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
6	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
7	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加民商基金销售(上海)有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 20 日
9	景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金关于在直销机构开通基金申购、赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 21 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 6 月 29 日

## 10.8 其他重大事件 (转型前)

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于 2018 年 1 月 25 日至 1 月 31 日第一	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 19 日

	个自由开放期开放申购、赎回业务的公告		
2	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于第二次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 19 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大泰金石基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 20 日
4	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于第二次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 20 日
5	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于 2018 年 1 月 25 日至 1 月 31 日第一个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 20 日
6	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于 2018 年 1 月 25 日至 1 月 31 日第一个自由开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 22 日
7	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 2017 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	2018 年 1 月 22 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 22 日
9	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金关于第二次受限开放期净赎回最大比例的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 1 月 22 日
10	关于景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金参加部分销售机构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	2018 年 1 月 25 日
11	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金触发转型条	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2018 年 2 月 1 日

	款的提示性公告	金管理人网站	
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 2 月 6 日
13	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	2018 年 2 月 14 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海有鱼基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 2 月 28 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海有鱼基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 2 月 28 日
16	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 2018 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	2018 年 3 月 10 日
17	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 2018 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	2018 年 3 月 10 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 22 日
19	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 23 日
20	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 23 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 23 日
22	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 2017 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 3 月 28 日
24	景顺长城景瑞双利定期开放债	中国证券报, 上海证	2018 年 3 月 28 日

	券型证券投资基金 2017 年年度报告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 2 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳盈信基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 11 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳盈信基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 11 日
28	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金 2018 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	2018 年 4 月 21 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海钜派钰茂基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 23 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海钜派钰茂基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 23 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 24 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于存量客户非居民涉税信息收集功能上线的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 25 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于实施存量非居民金融账户涉税信息尽职调查的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 25 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 26 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任公司基金申购及定期	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2018 年 4 月 27 日



	定额投资申购费率优惠活动的公告		
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2018年4月27日
37	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2018年5月18日
38	景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金转型的提示性公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2018年5月21日
39	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	2018年5月31日
40	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司基金认/申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2018年5月31日
41	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	2018年6月2日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180129--20180130	20,000,050.00	-	20,000,050.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况,可能会出现如下风险:

#### 1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

#### 2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(5) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金在第一次自由开放期的最后一日日终发生基金净资产低于 5000 万元的情况,触发了《景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定的转型条款。本基金管理人根据基金合同约定履行相应程序后,自 2018 年 6 月

20 日起，景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金转型为景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金。有关本次基金转型的详细信息参见本基金管理人发布的一系列相关公告。

2、根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性新规》”）的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 62 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议进行修改。并按照法规要求对适用基金持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入该基金的基金财产。修改后的基金合同、托管协议及赎回费相关规则调整等事宜已于 2018 年 3 月 31 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2018 年 3 月 23 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的公告》。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 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

2018年8月25日