# 景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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

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体独立董事签字同意,并出席董事长签发。

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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,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。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型后)

| | |
|---|---|
| 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。<br>1.资产配置策略<br>本基金运用且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时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。<br>2.固定收益类资产投资策略<br>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。<br>3.权益资产投资策略<br>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。 |
| 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 | 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。<br>1.资产配置策略<br>本基金运用且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时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。<br>2.期限配置策略<br>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资产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限进行适当的匹配。<br>3.固定收益类资产投资策略<br>基金管理人根据国债、金融债、企业(公司)债、分离交易可转债债券部分等品种与同期限国债或央票之间收益率利差的扩大和收窄的分析,主动地增加规期利差将收窄的债券类属品种的投资比例,降低规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。<br>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。<br>4.权益资产投资策略<br>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。 |
| 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 | 杨柳阳 | 曾麓燕 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 021-52629999-212040 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfmc.com | 0152926@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95561 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 021-62535823 |

2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 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 |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.19% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年6月30日 |
| 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 |

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。

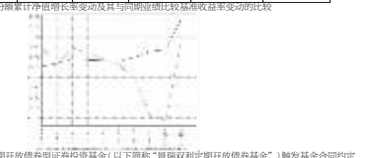
转型前

金额单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 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 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.80% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年6月19日 |
| 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 |

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。

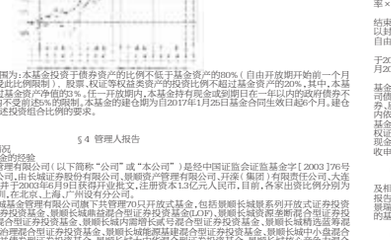
3.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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%,其中现金不包括执算备付金、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 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%。(1)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%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,本基金投资组合比例上述投资组合比例约束生效。

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、开源(集团)有限责任公司、友谊信托投资有限公司共同发起设立,并于2003年6月11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40%、40%、11%、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,包括景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金、景顺长城融通债券型证券投资基金、景顺长城融通稳健债券型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长或可超内需型证券投资基金、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、景顺长城大中华混合型证券投资基金、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混合型证券投资基金、景顺长城优质精选混合型证券投资基金、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、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金、景顺长城内需发现混合型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、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、景顺长城研究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、景顺长城非货币市场基金、景顺长城中国国企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、景顺长城景和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城聚益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城鼎利债券型证券投资基金、景顺长城鼎沪深300指数证券投资基金、景顺长城核心技术主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐定期开放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、景顺长城保证金收益债券型证券投资基金、景顺长城景泰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景泰利债券型证券投资基金、景顺长城景丰灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景和灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景和灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景和