

长京东越定期开放债券型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

利率和高等债券收益率明显下行,中低评级债券利率逐步上行,信用利差不断上升并变为高风险水平。3季度,受央行降准和债转股MLF等利政策影响,债券市场基本面保持良好,收益率曲线趋于平坦,加杠杆和中等等级信用债收益率企稳,转债市场表现良好,地方债发行增加供给冲击,表现整体偏弱。进入4季度,经济增速超预期下行压力, GDP增速放缓,经济领先指标PMI数据下降到荣枯线以下,与联储沟通近几月新推低通胀政策大幅下行,市场多预期债转股为一次,纵观全球,10年期国债收益率从年初3.9%下降至年末3.2%位置,债券市场整体呈现双向格局。

报告期内,本基金增加了中低评级信用债的配置比例,在久期控制上以中短久期为主,适度提高了产品的杠杆比例,以获取稳定收益。

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.0131元;报告期内,本基金份额净值增长率为4.24%,同期业绩比较基准收益率为7.1%。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,本基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的30%,但在每个开放期的前1个月和后1个月以及开放期前一个月不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占资产净值的比例不受限制,但在开放期末持有现金(不包括结算存余、存出保本基金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

7.2 会计核算和估值

7.2.1 会计核算和估值

7.2.2 会计核算和估值

7.2.3 会计核算和估值

7.2.4 会计核算和估值

7.2.5 会计核算和估值

7.2.6 会计核算和估值

7.2.7 会计核算和估值

7.2.8 会计核算和估值

7.2.9 会计核算和估值

7.2.10 会计核算和估值

7.2.11 会计核算和估值

7.2.12 会计核算和估值

7.2.13 会计核算和估值

7.2.14 会计核算和估值

7.2.15 会计核算和估值

7.2.16 会计核算和估值

7.2.17 会计核算和估值

7.2.18 会计核算和估值

7.2.19 会计核算和估值

7.2.20 会计核算和估值

7.2.21 会计核算和估值

7.2.22 会计核算和估值

7.2.23 会计核算和估值

7.2.24 会计核算和估值

7.2.25 会计核算和估值

7.2.26 会计核算和估值

7.2.27 会计核算和估值

7.2.28 会计核算和估值

7.2.29 会计核算和估值

7.2.30 会计核算和估值

7.2.31 会计核算和估值

7.2.32 会计核算和估值

7.2.33 会计核算和估值

7.2.34 会计核算和估值

7.2.35 会计核算和估值

7.2.36 会计核算和估值

7.2.37 会计核算和估值

7.2.38 会计核算和估值

7.2.39 会计核算和估值

7.2.40 会计核算和估值

7.2.41 会计核算和估值

7.2.42 会计核算和估值

7.2.43 会计核算和估值

7.2.44 会计核算和估值

7.2.45 会计核算和估值

7.2.46 会计核算和估值

7.2.47 会计核算和估值

7.2.48 会计核算和估值

7.2.49 会计核算和估值

7.2.50 会计核算和估值

7.2.51 会计核算和估值

7.2.52 会计核算和估值

7.2.53 会计核算和估值

7.2.54 会计核算和估值

7.2.55 会计核算和估值

7.2.56 会计核算和估值

7.2.57 会计核算和估值

7.2.58 会计核算和估值

7.2.59 会计核算和估值

7.2.60 会计核算和估值

7.2.61 会计核算和估值

7.2.62 会计核算和估值

7.2.63 会计核算和估值

7.2.64 会计核算和估值

7.2.65 会计核算和估值

7.2.66 会计核算和估值

7.2.67 会计核算和估值

7.2.68 会计核算和估值

7.2.69 会计核算和估值

7.2.70 会计核算和估值

7.2.71 会计核算和估值

7.2.72 会计核算和估值

7.2.73 会计核算和估值

7.2.74 会计核算和估值

7.2.75 会计核算和估值

7.2.76 会计核算和估值

7.2.77 会计核算和估值

7.2.78 会计核算和估值

7.2.79 会计核算和估值

7.2.80 会计核算和估值

7.2.81 会计核算和估值

7.2.82 会计核算和估值

7.2.83 会计核算和估值

7.2.84 会计核算和估值

7.2.85 会计核算和估值

分配; ②本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额再投资;投资者选择不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红; ③选择红利再投资方式的,基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折合基金份额,红利再投资的份额按申购费率;

④基金份额分配前基金净值不得低于面值;即基金份额分配基准日的基金净值减去每单位基金份额的累计未分配收益后不得低于面值;

⑤每一基金份额享有同等分配权; ⑥法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

(4) 收益分配方式

本基金收益分配方案中明确载明收益分配原则的可供分配利润、基金收益分配比例、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(5) 收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定,并由基金托管人复核,在2个工作日内指定媒介公告并报中国证监会备案。基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)不得超过10个工作日。

基金份额持有人有权对赎回基金份额或其他手续费用由投资者自行承担,但投资者赎回基金份额少于一定金额,不足支付赎回手续费或其他手续费时,基金登记机构将基金份额持有人的基金份额自动转为基金份额,红利再投资的计算方法,依照《长江证券(上海)资产管理有限公司开放式基金业务规则》执行。

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

7.4.5.2 会计估计变更的说明

7.4.5.3 差错更正的说明

7.4.5.4 差错更正的说明

7.4.5.5 差错更正的说明

7.4.5.6 差错更正的说明

7.4.5.7 差错更正的说明

7.4.5.8 差错更正的说明

7.4.5.9 差错更正的说明

7.4.5.10 差错更正的说明

7.4.5.11 差错更正的说明

7.4.5.12 差错更正的说明

7.4.5.13 差错更正的说明

7.4.5.14 差错更正的说明

7.4.5.15 差错更正的说明

7.4.5.16 差错更正的说明

7.4.5.17 差错更正的说明

7.4.5.18 差错更正的说明

7.4.5.19 差错更正的说明

7.4.5.20 差错更正的说明

7.4.5.21 差错更正的说明

7.4.5.22 差错更正的说明

7.4.5.23 差错更正的说明

7.4.5.24 差错更正的说明

7.4.5.25 差错更正的说明

7.4.5.26 差错更正的说明

7.4.5.27 差错更正的说明

7.4.5.28 差错更正的说明

7.4.5.29 差错更正的说明

7.4.5.30 差错更正的说明

7.4.5.31 差错更正的说明

7.4.5.32 差错更正的说明