
景顺长城政策性金融债债券型
证券投资基金
2019年第1季度报告

2019年3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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2019 年 4 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。本报告中财务资料未经审计。

自 2019 年 2 月 28 日起原景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金转型为景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金。原景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 2 月 27 日止，景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金本报告期自 2019 年 2 月 28 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	景顺长城政策性金融债债券
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	2019 年 2 月 28 日
报告期末基金份额总额	6,870,154.75 份
投资目标	本基金在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过精选债券，获取优化收益。</p> <p>2、债券类金融工具投资策略</p> <p>在品种选择层面，本基金将基于各品种债券类金融工具收益率水平的变化特征、宏观经济预测分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。</p> <p>本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。本基金将综合考察收益率曲线，通过预期收益率曲线形态变化来调整投资组合的头寸。</p> <p>当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。</p>
业绩比较基准	中债-金融债券总指数收益率。
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。
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

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	景顺长城景瑞双利债券
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
报告期末基金份额总额	7,598,523.77 份
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	<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 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 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 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。</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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年2月28日（基金合同生效日） - 2019年3月31日)
1. 本期已实现收益	13,683.57
2. 本期利润	10,894.58
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0015
4. 期末基金资产净值	7,487,813.33
5. 期末基金份额净值	1.0899

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、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、本基金基金合同生效日为 2019 年 2 月 28 日。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年2月27日)
1. 本期已实现收益	121,777.01
2. 本期利润	22,403.31
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0025
4. 期末基金资产净值	8,269,143.45
5. 期末基金份额净值	1.0882

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、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。

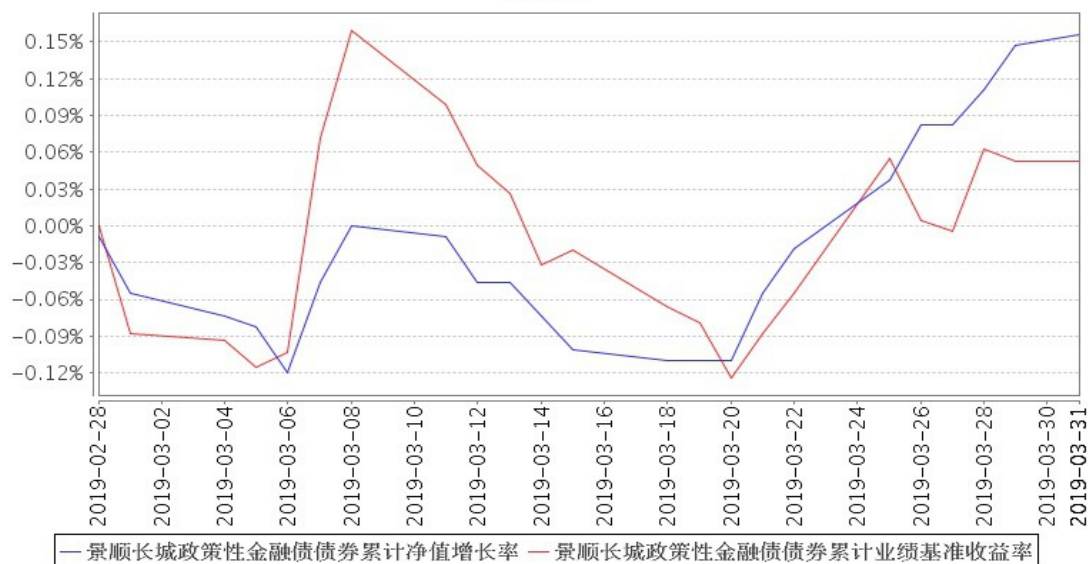
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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 2019-02-28（基金合同生效日）至 2019-03-31	0.16%	0.03%	0.05%	0.06%	0.11%	-0.03%

3.2.2 自基金转型以来基金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

景顺长城政策性金融债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：2019年2月28日，景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金转型为景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）。基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，投资于政策性金融债（国家开发银行、中国农业发展银行、中国进出口银行发行的金融债券）比例不低于非现金基金资产的80%。本基金持有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。本基金的建仓期为自 2019 年 2 月 28 日转型后基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2019 年 2 月 28 日）起至本报告期末不满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.3 本报告期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	净值增长率①	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 2019-01-01 至 2019-02-27 (基金合同失效前日)	0.10%	0.08%	2.96%	0.15%	-2.86%	-0.07%

3.2.4 自基金合同生效以来基金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

景顺长城景瑞双利债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。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。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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2019年02月28日	-	10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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2018年06月20日	2019年2月27日	10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；

3、因景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资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。

4.2 管理人对报告期内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》、《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、《景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金基金合同》、《景顺长城政策性金融债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 公平交易专项说明

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 27 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，公司旗下指数基金因指数成份股调整，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，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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 1 季度，国内经济下行仍在持续但经济活动中积极因素开始增多。一方面，工业企业利润增速持续下滑，制造业投资明显回落，出口受外需拖累跌入负增长，社会零售品消费偏弱，尤其是限额以上消费增速出现明显下滑，工业生产也呈现回落态势，经济仍在寻底；另一方面，国内社融存量增速开始企稳，持续的宽信用政策取得一定效果。3 月官方制造业 PMI 录得 50.5%，较 2 月份的 49.2% 明显回升，在连续 3 个月低于临界点后重返扩张区间，明显超市场预期，反映经济整体景气度有所改善。

海外方面，欧元区前两大经济体德国和法国的制造业 PMI 数据均不佳，全球经济失速的风险在上升。美联储鸽派程度超预期，引发美债收益率出现短暂的期限倒挂，对美国经济衰退的担忧也在加剧。

国内货币政策继续保持宽松，但央行着力消除市场对更大程度宽松的预期。降准方面，易行长

指出我国降准的空间已较前几年小；降息方面，易行长指出无风险利率经过 2018 年的大幅下行后，进一步降低实体企业融资成本更重要的是风险溢价的下降，也在避免市场对降息产生期望。

1 季度，国内债券市场总体波动下行趋势，其中季初大幅下行，之后波动上行。10 年国债、10 年国开债、5 年 AAA 中票、3 年 AAA 中票和 1 年 AAA 中票收益率分别下行 16BP、6BP、4BP、20BP 和 38BP。国债表现好于政策性金融债，信用债中短端品种好于长端，收益率呈现牛陡走势。尽管民企纾困政策频出，但民企违约仍在持续，并向行业中具有较大影响力的龙头企业扩散；国企非标违约也在增多，信用风险依然较严峻。

1 季度本基金债券方面整体降久期，大幅减配长久期利率债，并适当降低杠杆水平。

展望 2 季度，全球经济增长可能继续放缓，国内经济下行的压力依然存在，政策还会延续宽信用的方向，货币政策保持稳健宽松不会改变。但中美贸易谈判可能取得成果、基建投资反弹和房地产投资具有韧性对基本面有支撑，经济表现可能好于预期；信贷和经济企稳证伪需要时间，国内通胀的压力在上升，权益上涨过快后可能形成泡沫，也将对货币政策进一步宽松形成制约。因此，债市下行需要更多的利多因素，但也不具备形成熊市的基础；预计数据扰动和交易情绪将对债市产生较大的影响，收益率调整后可能出现震荡格局。

整体策略上，债券以中短久期利率债做基础配置，等待长久期利率债调整后的参与机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

基金转型后，2019 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2019 年 3 月 31 日，本基金份额净值增长率为 0.16%，业绩比较基准收益率为 0.05%；

基金转型前，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 2 月 27 日（基金合同失效前日），本基金份额净值增长率为 0.10%，业绩比较基准收益率为 2.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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”。从 2018 年 6 月 20 日至 2019 年 2 月 27 日，景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

2019 年 2 月 28 日，“景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金”转型为“景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金”。从 2019 年 2 月 28 日至 2019 年 3 月 29 日，景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	8,037,572.00	90.83
	其中：债券	8,037,572.00	90.83
	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	433,789.68	4.90
8	其他资产	377,639.66	4.27
9	合计	8,849,001.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	515,900.00	6.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,521,672.00	100.45
	其中：政策性金融债	-	-
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	8,037,572.00	107.34

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018006	国开 1702	32,000	3,274,880.00	43.74
2	108602	国开 1704	30,000	3,042,300.00	40.63
3	018008	国开 1802	5,920	604,432.00	8.07
4	018005	国开 1701	6,000	600,060.00	8.01
5	010107	21 国债(7)	5,000	515,900.00	6.89

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,007.44
2	应收证券清算款	99,570.47
3	应收股利	-
4	应收利息	276,031.78
5	应收申购款	29.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	377,639.66

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	10,027,980.00	95.09
	其中：债券	10,027,980.00	95.09
	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	436,934.56	4.14
8	其他资产	81,010.25	0.77
9	合计	10,545,924.81	100.00

5.11 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.12 报告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

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.13 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,427,020.00	114.00
2	央行票据	-	-

3	金融债券	600,960.00	7.27
	其中：政策性金融债	-	-
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	10,027,980.00	121.27

5.14 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	66,000	6,799,980.00	82.23
2	010303	03 国债(3)	26,000	2,627,040.00	31.77
3	018005	国开 1701	6,000	600,960.00	7.27

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.16 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。

5.17 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.18.1 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。

5.18.2 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。

5.18.3 本期国债期货投资评价

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。

5.19 投资组合报告附注

5.19.1 本基金投资的前十名证券的发行主体是否出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

5.19.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

5.19.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	926.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79,748.95
5	应收申购款	334.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,010.25

5.19.4 报告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。

5.19.5 报告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。

5.19.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

转型后：

单位：份

基金合同生效日（2019年2月28日）持有的基金份额	7,598,523.77
基金合同生效日至报告期期末基金总申购份额	28,285.77
减：基金合同生效日至报告期期末基金总赎回份额	756,654.79
基金合同生效日至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	6,870,154.75

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

转型前：

单位：份

报告期期初基金份额总额	8,790,196.96
报告期期间基金总申购份额	9,369,923.95
减：报告期期间基金总赎回份额	10,561,597.14
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
2019年2月27日（基金合同失效前日）基金份额总额	7,598,523.77

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，已于 2019 年 1 月 31 日至 2019 年 2 月 26 日以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，并于 2019 年 2 月 27 日表决通过了《关于修改景顺长城景瑞双利债券型证券投资基金投资相关内容、基金管理费率、托管费率以及基金合同终止的事由的议案》。2019 年 2 月 28 日，本基金变更为景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金，管理费率由 0.7%年费率下调至 0.3%年费率，托管费率由 0.2%年费率下调至 0.1%年费率。有关详细信息参见本基金管理人于 2019 年 1 月 26 日至 2 月 28 日发布的一系列相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 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》、《景顺长城政策性金融债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》、《景顺长城政策性金融债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》、《景顺长城政策性金融债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。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 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

2019 年 4 月 20 日