

# 景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 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：江苏银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 24 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 20 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。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 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>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	34
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.....	34
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.11 投资组合报告附注 .....	35
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>36</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
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情况.....	36
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>36</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>37</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变 .....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	37
10.8 其他重大事件 .....	38
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>40</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 .....	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	41
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>41</b>
12.1 备查文件目录 .....	41
12.2 存放地点 .....	41
12.3 查阅方式 .....	41

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金
基金简称	景顺长城景泰盈利纯债债券
场内简称	无
基金主代码	007537
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,041,572,459.42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<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、债券投资策略</p> <p>1) 债券类属资产配置</p> <p>基金管理人根据国债、金融债、企业（公司）债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>2) 债券投资策略</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、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，</p>

	以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	柯振林
	联系电话	0755-82370388	025-58588217
	电子邮箱	investor@igwfm.com	kezhenlin@jsbchina.cn
客户服务电话		4008888606	95319
传真		0755-22381339	025-58588155
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	江苏省南京市中华路26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	江苏省南京市中华路26号
邮政编码		518048	210001
法定代表人		丁益	夏平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	35,334,943.88
本期利润	29,182,670.13
加权平均基金份额本期利润	0.0288
本期加权平均净值利润率	2.76%
本期基金份额净值增长率	2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	46,674,814.67
期末可供分配基金份额利润	0.0448

期末基金资产净值	1,088,247,274.09
期末基金份额净值	1.0448
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.48%

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。

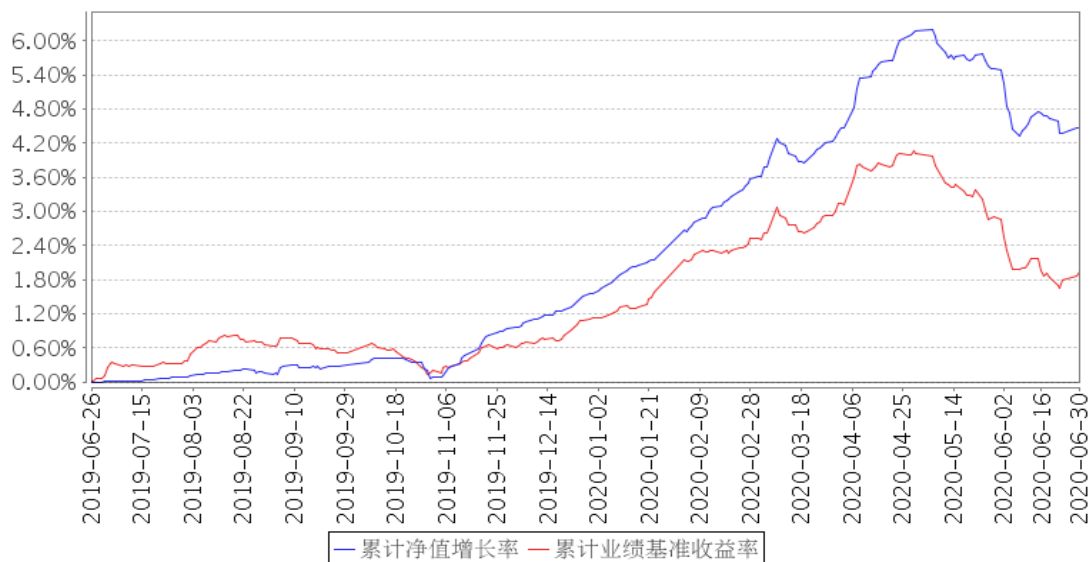
## 3.2 基金净值表现

### 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	-0.97%	0.13%	-0.94%	0.12%	-0.03%	0.01%
过去三个月	0.17%	0.12%	-1.04%	0.12%	1.21%	0.00%
过去六个月	2.88%	0.11%	0.79%	0.11%	2.09%	0.00%
过去一年	4.48%	0.08%	1.87%	0.08%	2.61%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.48%	0.08%	1.94%	0.08%	2.54%	0.00%

### 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

景顺长城景泰盈利纯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：基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%；本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 6 月 26 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 2020 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 96 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(QDII)、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、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、景顺长城政策性金融债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、景顺长城 MSCI 中国 A 股

国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。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

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		
袁媛	本基金的基金经理、固定收益部投资副总监	2019 年 6 月 26 日	-	13	经济学硕士。曾任职于齐鲁证券北四环营业部，也曾担任中航证券证券投资部投资经理、安信证券资产管理部投资主办等职务。2013 年 7 月加入本公司，担任固定收益部资深研究员，自 2014 年 4 月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部投资副总监兼基金经理。

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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《公开募集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、《景顺长城景泰盈利纯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 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 18 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交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，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 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

全球上半年全球资产表现紧密跟随新型冠状病毒疫情的演化。先是呈现剧烈波动，随后在各国央行的紧急出手下波动率降低，风险资产出现明显修复。随着 2 月底疫情进入海外扩散阶段，全球资本市场剧烈动荡。疫情与油价大幅下跌的冲击下，美国一度陷入流动性危机，美联储两度紧急降息重回“零利率”、重启 QE 并实施无上限 QE，将资产购买范围扩大至所有投资级债权类

资产，设立海外央行回购工具向全球提供美元流动性。全球央行都紧急出手，先后用宽货币和宽财政的手段来稳定经济。二季度全球资产风险资产出现明显修复。发达经济体 4 月开始疫情逐步受控并逐步开启解封，复工复产逐步推进，欧洲疫情形势较为稳定。爆发重点逐步转向新兴市场。而近期美国疫情叠加游行示威活动影响出现反复，后续需要保持关注。从海外经济基本面情况看，无论是发达还是新兴市场，在遭受疫情冲击之后开始出现经济数据环比改善迹象，但整体经济在未来一段时间陷入技术性衰退仍是大概率事件。海外央行的宽松幅度事实上正在接近金融危机时的高点。此外，近期美欧贸易摩擦有所升温，需要关注对于全球避险情绪的扰动。

国内方面，年初突发的疫情打断了我国经济原本弱复苏的进度，严格的防控措施导致社会生产消费活动大面积停滞，投资消费均受到了疫情的显著冲击。一季度实际 GDP 增速和各项经济指标明显下滑。但由于我国率先控制住疫情，复工复产推进初期，各项经济指标环比改善斜率较大。目前我国实际的产能恢复率已达 90%以上，经济环比修复最快阶段正在过去，开始面临需求疲弱约束，环比改善速度逐步放缓。整体上看年内经济仍是一个弱复苏的格局，二季度实际 GDP 增速回升到 3%左右的水平。4-6 月的 PMI 数据同比概念基本上呈现出匀速修复状态，但仍处于负增长区间。需求端方面，4、5 月出口连续超预期主因是防疫物资的出口，其后续可能继续与传统出口商品呈现“此消彼长”状态，从而平滑外需冲击；固定资产投资方面主要支撑主要来自于基建以及房地产，4 月中下旬开始的项目赶工以及后续专项债募资持续将继续推动基建投资增速走高，制造业投资则继续保持微弱反弹；消费方面依旧没有出现补偿性消费的迹象，汽车消费恢复仍在继续但速度开始放缓。通胀方面，CPI 同比在猪肉价格带动下趋于下行，而 PPI 同比可能已在 5 月份见底，后续将进入缓慢修复过程。

货币政策方面，应对疫情发展，货币政策经历了从应急模式到正常化的过程。疫情初期，央行通过降准、再贷款再贴现投放等一系列方式向市场补充流动性并及时下调市场利率，引导实体经济融资成本下行。宽信用层面一季度表现非常积极。通过出台帮助中小企业缓解流动性压力措施和加快广义财政扩张等几方面来保证复产复工有序进行。二季度货币政策总体宽松，尤其是大超市场预期下调超额存款准备金利率，这也是自 2008 年以来首次下调，但在内外部环境变化下央行相机抉择微调较快，4 月开始宏观经济指标呈现良好回升迹象，同时央行开始重新考虑汇率及由前期隔夜加权利率过低导致的资金空转套利问题。货币政策从最为宽松的对冲疫情非常态模式回归常态，资金利率在货币政策引导下出现快速上行。抗疫期间的极度宽松货币环境正逐步收敛，央行在公开市场操作以及降准降息工具的使用上面均较为克制，追求总量政策的适度。未来央行意图通过改革、规范等方式降低银行负债成本、企业融资成本的决心较强，但降成本的实现预计仍需要央行货币政策方面的适当配合。

债券市场方面，收益率走势分别在疫情发展和货币政策正常化两因素分阶段主导下出现“过山车”行情。春节前到 4 月下调超额存款准备金利率期间，伴随疫情海外扩散、货币政策不断加码等因素，收益率一路下行，创出历史新低。在央行货币政策明显收敛背景下，二季度利率债收益率触底反弹。随着整体经济数据在复工复产推动下开始明显环比改善，央行货币政策逐步正常化，操作屡次低于市场预期，并通过多种工具传递出“宽信用”意愿，市场阶段性出现恐慌情绪，收益率一度反弹到接近今年年初疫情前的位置，日内收益率波动也明显加大。截至 6 月底，1 年期国债和国开债分别较去年末下行 19BP 和 31BP 至 2.18% 和 2.19%。10 年期国债和国开债分别较去年末下行 31BP 和 48BP 至 2.82% 和 3.10%。信用利差低位震荡。截至 6 月底，3 年 AAA、AA+ 和 AA 信用债分别较去年末下行 23BP、14BP 和 5BP 至 3.20%、3.41% 和 3.74%。

组合操作方面，组合主要以持有中短期中高等级信用债为主，一季度鉴于货币政策宽松延续和资金面稳定且资金利率较低，积极运用杠杆策略。在对经济数据进行预判和市场分析基础上，在收益率下行机会相对确定性时点对中长久期利率债进行了两波灵活的波段操作。在下调超额存款准备金利率后逐步降低组合久期和杠杆，在收益率大幅上行且短端资金稳定后，用中短久期中高等级信用债加了部分杠杆。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，本基金份额净值增长率为 2.88%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，目前整体宏观场景已由“衰退”转向“复苏”，二季度实际 GDP 增速预计将反弹至 2%-3%，预计三季度将进一步修复至潜在增速附近，其中基建投资将进一步明显发力，政府债券继续发行也将带动社融等指标继续上行。在“稳就业保民生”的核心诉求之下，关注三季度就业方面可能出现的脉冲式冲击，政策将如何应对也可能对相关行业造成影响。从价格指数来看，PPI 同比大概率在 5 月份已经见底，此后逐步向上修复，而在库存去化压力等因素的影响下这个过程将会较为缓慢，价格因素也将带动企业盈利增速继续缓慢回升，叠加货币政策与财政政策对于“宽信用”的重视，整体上看权益资产的表现将好于债券资产。

债券方面，宏观经济运行环比修复，央行货币政策操作由“宽货币”向“宽信用”转化，对于利率债整体观点较为谨慎，交易机会主要来自超调后的收益率修复。可从几个方面进行考虑：基本面方面，考虑当前收益率水平是否与整体宏观经济基本面匹配，是否已出现超调迹象，三季度预计实际 GDP 增速将有望达到 5-6% 的潜在增速，相对应的长端利率中枢应当在 2.8% 上下较为合适，后续可能出现的外需承压、海内外疫情复发等均是潜在触发因素。尤其关注在结构性存款、信托融资监管后的社融增速会否出现放缓；货币政策方面，应当关注市场的货币政策预期是否可

能存在偏差，后续 PPI 同比将在较长时间内维持负增长，海外流动性宽松环境也将持续一段时间，中国央行实施从紧的货币政策目前来看并无基础；而从交易层面看，目前资金利率已经接近政策利率，此前调整已较为充分，但期限利差已被显著压缩，长端利差保护较此前明显下降。后续票息为王，调整后的中短久期信用债配置价值提升，具体投资品种看，城投平台作为地区维稳、执行防疫建设和直接融资的中坚力量，是宽信用政策最直接受益者，债务安全性仍是最高，可在避开债务负担相对较重地区的基础上择优配置；产业债中，随着房地产销售开始转正，房地产企业处于融资政策相对友好和销售资金回流不断改善阶段，龙头房企债券可重点关注。

组合操作计划上，债券市场以中高等级中短久期信用债票息为主，利率波段交易主要来自收益率超调后的部分修复，需谨慎参与，不追涨杀跌；密切关注各项宏观经济数据、政策调整和市场资金面情况，保持对组合的信用风险和流动性风险的关注。

#### 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

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,在托管景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金托管协议》的约定,尽职尽责履行了托管人应尽的义务,没有从事任何损害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

本报告期内,本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现景顺长城基金管理有限公司在景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为,或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由基金管理人所编制和披露的景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	1,425,636.35	1,757,316.62
结算备付金		-	17,992.48
存出保证金		112,437.43	72,945.52
交易性金融资产	6.4.7.2	1,331,766,200.00	1,367,545,047.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,244,720,000.00	1,347,545,047.60
资产支持证券投资		87,046,200.00	20,000,000.00
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	21,603,614.78	20,629,098.04
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	375.05	-
资产总计		1,354,908,263.61	1,390,022,400.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019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		266,015,666.99	374,051,109.97
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20.75	111.04
应付管理人报酬		265,661.85	257,802.74
应付托管费		88,553.97	85,934.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,856.04	43,727.81
应交税费		122,550.92	190,658.07
应付利息		22,197.34	63,032.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,481.66	79,000.00
负债合计		266,660,989.52	374,771,376.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,041,572,459.42	999,604,586.79
未分配利润	6.4.7.10	46,674,814.67	15,646,436.64
所有者权益合计		1,088,247,274.09	1,015,251,023.43
负债和所有者权益总计		1,354,908,263.61	1,390,022,400.26

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0448 元，基金份额总额 1,041,572,459.42



份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 26 日（基 金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		34,414,706.70	32,497.79
1. 利息收入		24,082,882.56	32,497.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	29,126.50	32,497.79
债券利息收入		23,130,987.71	-
资产支持证券利息收入		891,614.08	-
买入返售金融资产收入		31,154.27	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,484,097.89	-
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	16,484,097.89	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
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	-6,152,273.75	-
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	-	-
减：二、费用		5,232,036.57	11,849.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,574,341.76	7,895.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	524,780.60	2,631.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	29,974.97	-
5. 利息支出		2,909,443.64	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,909,443.64	-
6. 税金及附加		80,413.94	-
7. 其他费用	6.4.7.19	113,081.66	1,322.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,182,670.13	20,648.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,182,670.13	20,648.16

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	999,604,586.79	15,646,436.64	1,015,251,023.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,182,670.13	29,182,670.13
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）	41,967,872.63	1,845,707.90	43,813,580.53
其中：1. 基金申购款	42,321,129.13	1,856,923.73	44,178,052.86
2. 基金赎回款	-353,256.50	-11,215.83	-364,472.33
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）	1,041,572,459.42	46,674,814.67	1,088,247,274.09
项目	上年度可比期间 2019 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 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）	240,133,353.54	-	240,133,353.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,648.16	20,648.16
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）	240,133,353.54	20,648.16	240,154,001.70

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

景顺长城景泰盈利纯债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[2019]945号《关于准予景顺长城景泰盈利纯债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《景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集设立不包括认购资金利息共募集人民币240,112,340.84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(2019)第0383号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金基金合同》于2019年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为240,133,353.54份基金份额,其中认购资金利息折合21,012.70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,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景泰盈利纯债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为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、政府支持机构债、次级债及其他中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的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合计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。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

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2020年8月20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<年度报告和中期报告>》、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》、《景顺长城景泰盈利纯债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 2020 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	
	2020年6月30日	
活期存款	1,425,636.35	
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个月至1年	-	
存款期限1年以上	-	
其他存款	-	
合计	1,425,636.35	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	82,934,259.18	82,281,000.00	-653,259.18
	银行间市场	1,169,079,397.69	1,162,439,000.00	-6,640,397.69
	合计	1,252,013,656.87	1,244,720,000.00	-7,293,656.87
资产支持证券	86,910,000.00	87,046,200.00	136,200.00	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,338,923,656.87	1,331,766,200.00	-7,157,456.87	

##### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	363.74
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	-
应收债券利息	20,855,317.40
应收资产支持证券利息	747,888.10
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	-
应收出借证券利息	-
其他	45.54
合计	21,603,614.78

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	375.05
待摊费用	-
合计	375.05

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	42,856.04
合计	42,856.04

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	103,481.66
合计	103,481.66

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	999,604,586.79	999,604,586.79
本期申购	42,321,129.13	42,321,129.13
本期赎回（以“-”号填列）	-353,256.50	-353,256.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,041,572,459.42	1,041,572,459.42

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

#### 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	16,225,653.90	-579,217.26	15,646,436.64
本期利润	35,334,943.88	-6,152,273.75	29,182,670.13
本期基金份额交易产生的变动数	1,729,999.57	115,708.33	1,845,707.90
其中：基金申购款	1,739,912.71	117,011.02	1,856,923.73
基金赎回款	-9,913.14	-1,302.69	-11,215.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,290,597.35	-6,615,782.68	46,674,814.67

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	19,710.33
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	8,119.46
其他	1,296.71
合计	29,126.50

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,254,829,860.45
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,206,046,388.88
减：应收利息总额	32,299,373.68

买卖债券差价收入	16,484,097.89
----------	---------------

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	15,090,000.00
减：卖出资产支持证券成本总额	15,090,000.00
减：应收利息总额	-
资产支持证券投资收益	-

**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 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,152,273.75
股票投资	-
债券投资	-6,288,473.75
资产支持证券投资	136,200.00
基金投资	-
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	-6,152,273.75

**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**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	1,862.47
银行间市场交易费用	28,112.50
合计	29,974.97



**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
合计	113,081.66

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人

注：以下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**

本基金于本报告期及上年度可比期间均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**

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金于本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,574,341.76	7,895.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	524,780.60	2,631.72

注：支付基金托管人江苏银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 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及上年度末未投资本基金。

**6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年6月26日（基金合同生效日）至2019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
江苏银行	1,425,636.35	19,710.33	194,133,353.54	21,253.35

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**6.4.12 期末(2020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 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 266,015,666.99 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101675007	16 杭州城建 MTN001	2020 年 7 月 1 日	101.03	371,000	37,482,130.00
101801423	18 甬开投 MTN001	2020 年 7 月 1 日	102.59	400,000	41,036,000.00
101900853	19 宁河西 MTN002	2020 年 7 月 1 日	102.11	400,000	40,844,000.00
101900948	19 萧山环境 MTN001	2020 年 7 月 1 日	103.17	700,000	72,219,000.00
102000268	20 嘉公路 MTN001	2020 年 7 月 1 日	97.68	400,000	39,072,000.00
102000376	20 宣城国资 MTN001	2020 年 7 月 1 日	100.11	500,000	50,055,000.00
合计				2,771,000	280,708,130.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 116.86%（上年末：129.60%）。

### 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上市公司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%，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%（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）。

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。

#### 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。

##### 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账面价值，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

单位：人民币元

本期末 2020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
<b>资产</b>							
银行存款	1,425,636.35	-	-	-	-	-	1,425,636.35
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	112,437.43	-	-	-	-	-	112,437.43
交易性金融资产	20,216,000.00	-	162,386,200.00	958,528,000.00	190,636,000.00	-	1,331,766,200.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	21,603,614.78	21,603,614.78
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	375.05	375.05
<b>资产总计</b>	<b>21,754,073.78</b>	<b>-</b>	<b>162,386,200.00</b>	<b>958,528,000.00</b>	<b>190,636,000.00</b>	<b>21,603,989.83</b>	<b>1,354,908,263.61</b>
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20.75	20.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	265,661.85	265,661.85
应付托管费	-	-	-	-	-	88,553.97	88,553.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	266,015,666.99	-	-	-	-	-	266,015,666.99

应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	42,856.04	42,856.04
应付利息	-	-	-	-	-	22,197.34	22,197.34
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	122,550.92	122,550.92
其他负债	-	-	-	-	-	103,481.66	103,481.66
负债总计	266,015,666.99	-	-	-	-	645,322.53	266,660,989.52
利率敏感度缺口	-244,261,593.21	-162,386,200.00	958,528,000.00	190,636,000.00	-	-	-
上年度末 2019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	1,757,316.62	-	-	-	-	-	1,757,316.62
结算备付金	17,992.48	-	-	-	-	-	17,992.48
存出保证金	72,945.52	-	-	-	-	-	72,945.52
交易性金融资产	1,747,047.60	-276,317,000.00	845,176,000.00	244,305,000.00	-	-	1,367,545,047.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	20,629,098.04	20,629,098.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,595,302.22	-276,317,000.00	845,176,000.00	244,305,000.00	20,629,098.04	-	1,390,022,400.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	111.04	111.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	257,802.74	257,802.74
应付托管费	-	-	-	-	-	85,934.25	85,934.25
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	374,051,109.97	-	-	-	-	-	374,051,109.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	43,727.81	43,727.81
应付利息	-	-	-	-	-	63,032.95	63,032.95
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	190,658.07	190,658.07
其他负债	-	-	-	-	-	79,000.00	79,000.00
负债总计	374,051,109.97	-	-	-	-	720,266.86	374,771,376.83
利率敏感度缺口	-370,455,807.75	-276,317,000.00	845,176,000.00	244,305,000.00	-	-	-

## 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	
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-7,589,816.14	-7,971,007.30
	市场利率下降 25 个基点	7,673,448.65	8,047,437.90

#### 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，所面临的最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

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同）。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金未持有权益类资产（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 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 2020 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 1,331,766,200.00 元，无属于第一或第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日第二层次的余额为 1,367,545,047.60 元，无属于第一或第三层次的余额）。



## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## (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 2020 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（2019 年 12 月 31 日：同）。

## (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) 其他

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

### 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	1,331,766,200.00	98.29
	其中：债券	1,244,720,000.00	91.87
	资产支持证券	87,046,200.00	6.42
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	1,425,636.35	0.11
8	其他各项资产	21,716,427.26	1.60
9	合计	1,354,908,263.61	100.00

### 7.2 报告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**

本基金本报告期内未持有股票投资。

**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**

本基金本报告期内未持有股票投资。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

本基金本报告期内未持有股票投资。

**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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,084,000.00	5.52
	其中：政策性金融债	60,084,000.00	5.52
4	企业债券	324,308,000.00	29.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	860,328,000.00	79.06
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,244,720,000.00	114.38

**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	101900948	19 萧山环境 MTN001	700,000	72,219,000.00	6.64
2	1680363	16 济专项债	700,000	70,469,000.00	6.48
3	2080029	20 鄂交投债 01	700,000	69,027,000.00	6.34
4	200201	20 国开 01	600,000	60,084,000.00	5.52
5	101900248	19 南昌水投 MTN001	550,000	56,903,000.00	5.23

**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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	138544	元熹 6 优 1	300,000	30,039,000.00	2.76
2	138456	链融 22A1	200,000	20,056,000.00	1.84
3	138635	20 碧华 A1	200,000	20,000,000.00	1.84
4	138514	元熹 5 优 1	120,000	12,025,200.00	1.11
5	165561	19 融信优	200,000	4,926,000.00	0.45

## 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

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。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，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。

### 7.11.2 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。

### 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	112,437.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,603,614.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	375.05
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	21,716,427.26
---	----	---------------

#### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 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 (%)
300	3,471,908.20	1,041,503,611.01	99.99	68,848.41	0.01

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,393.85	0.00

### 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 6 月 26 日) 基金份额总额	240,133,353.54
本报告期期初基金份额总额	999,604,586.79
本报告期基金总申购份额	42,321,129.13
减：本报告期基金总赎回份额	353,256.50
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少 以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,041,572,459.42

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 月 6 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，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 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，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

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。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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

#### 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	
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足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。

2、本基金本期租用交易单元未发生变化。

### 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
中信证券股份有限公司	396,461,420.53	100.00%	552,000,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2020 年 1 月 21 日

	基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	网站	
3	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 30 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 31 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 3 日
7	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 6 日
8	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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 6 日
9	关于景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金限制伍拾万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 13 日
10	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 19 日
11	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 20 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 7 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
15	景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
16	景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 30 日

	的公告		
20	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 15 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日
22	关于景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金恢复接受伍拾万元以上申购及转换转入业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 6 月 11 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	20200101-20200630	999,352,460.98	-	-	999,352,460.98	95.95
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

无。

## §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泰盈利纯债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景泰盈利纯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。

### 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

2020年8月24日