景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2019年8月23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部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月21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。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	景顺长城景泰稳利定期开放债券	
场内简称	无	
基金主代码	005327	
交易代码	005327	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年12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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	186,478,545.50份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景泰稳利定期开放债券A	景顺长城景泰稳利定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	005327	006065
报告期末下属分级基金的份额总额	161,791,731.68份	24,686,813.82份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下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	1、封闭期投资策略 (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。 (2)债券类属资产配置 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。 (3)债券投资策略 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。 (4)资产支持证券投资策略 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,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,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 2、开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。
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	本基金为债券型基金,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	田东辉
	联系电话	0755-82370388	010-68858113
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		4008888606	95580
传真		0755-22381339	010-68858120

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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	景顺长城景泰稳利定期开放债券A	景顺长城景泰稳利定期开放债券C
本期已实现收益	2,280,325.96	1,095,537.35
本期利润	2,896,885.13	1,111,723.47
加权平均基金份额本期利润	0.0193	0.0190
本期基金份额净值增长率	2.12%	1.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0447	0.0437
期末基金资产净值	169,899,320.47	25,896,977.14
期末基金份额净值	1.0501	1.0490

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。

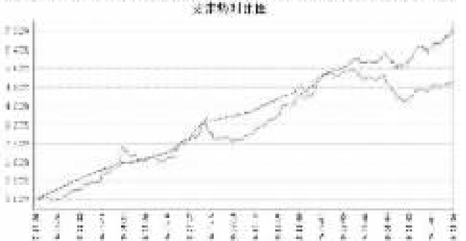
3.2基金净值表现

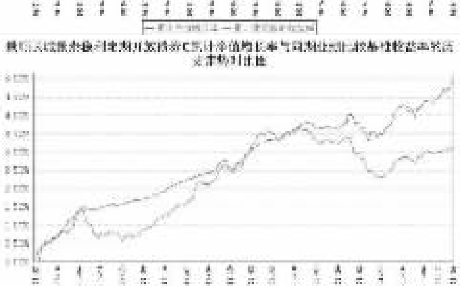
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城景泰稳利定期开放债券A						
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	0.74%	0.04%	0.28%	0.03%	0.46%	0.01%
过去三个月	0.95%	0.08%	-0.24%	0.06%	1.19%	0.02%
过去六个月	2.12%	0.06%	0.24%	0.06%	1.88%	0.00%
过去一年	4.95%	0.05%	2.82%	0.06%	2.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.27%	0.04%	5.04%	0.06%	2.23%	-0.02%

景顺长城景泰稳利定期开放债券C						
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	0.69%	0.04%	0.28%	0.03%	0.41%	0.01%
过去三个月	0.86%	0.08%	-0.24%	0.06%	1.10%	0.02%
过去六个月	1.91%	0.06%	0.24%	0.06%	1.67%	0.00%
过去一年	4.86%	0.05%	2.82%	0.06%	2.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.05%	3.14%	0.06%	1.76%	-0.01%

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%,在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。本基金的建仓期为自2017年12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。本基金于2018年6月11日增设C类基金份额,并于2018年6月27日开始对C类份额进行估值。

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2019年6月30日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理75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、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。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		
成念良	本基金的基金经理	2017年12月26日	-	10	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。
陈威霖	本基金的基金经理	2017年12月26日	-	8	管理学硕士。曾担任平安利顺货币经纪公司债券市场部债券经纪人。2013年6月加入本公司,历任交易管理部交易员、固定收益部信用研究员,自2016年4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"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。

4.2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《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、《景顺长城景泰稳利定期开放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57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。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易,经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为,非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2019年上半年国内外经济金融环境复杂且多变。首先国内经济经历1季度短期企稳后五月份开始再度显示出疲弱态势,工业增加值大幅回落,中采PMI综合指标掉入收缩区间。投资方面制造业投资持续低迷,基建投资小幅反弹低于预期,房地产投资持续高增但开始有见顶迹象;进出口持续负增长,全球经济走弱及贸易摩擦的影响显著;消费低迷,扣除价格因素的实际消费增速已经下降至历史低位。

其次国内政策区间管理,频繁微调预调。货币政策1季度较为宽松,四月份边际收紧,五月开始由于经济走弱及包商事件再度趋于宽松,以隔夜加权回购利率为代表的货币市场利率从四月份最高2.9%回落到六月份的1%附近;而逆周期调节政策频出,地方债加快发行,地方专项债可有条件作为资本金等财政政策推出。

同时,贸易摩擦的反复以及五月份包商事件对市场影响深远。贸易摩擦从1季度缓和到四月底升级再到六月份的缓和,不改变中美贸易等方面摩擦的长期性和复杂性,关税的提升以及全球产业链的变化,对国内及全球的增长将会产生较大影响;而包商事件打破了银行体系的刚兑,短期是流动性风险,更长期看是信用的分层和金融资源的再分配,谨防对实体领域的信用收缩。

海外方面,经济持续走弱,货币转向宽松。美国及欧日的制造业PMI指数持续走低,增长和通胀的不确定性上升;欧洲率先转向宽松,美国经历了金融市场大幅波动和长短端利率倒挂后,美联储从停止加息快速转向准备降息。

上半年利率债收益率波动较大,一月初降准后开始波动上行;四月在较好的经济金融数据、政治局会议对政策微调、央行货币政策边际收紧等因素冲击下,收益率上行速度加快;五月初债市在中美贸易谈判出现变数、央行为维稳进行定向降准和公开市场净投放、经济数据出现全面回踩等因素支撑下,收益率出现一波明确下行;五月底至六月份受包商银行事件影响,收益率冲高后震荡。上半年10年期国债和国开债的收益率分别下行0.1BP和3BP至3.23%和3.61%。信用债方面,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,包商事件导致的信用分层,包括地方城投平台在内的低资质企业风险也在增加,信用风险依然较严峻。半年度3年期AA+中票、5年期AA+中票、1年AAA短融分别下行20BP、1BP和39BP至3.85%、4.34%和3.20%。

本基金上半年整体加仓中等久期利率债,减持信用债。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2019年上半年,景顺长城景泰稳利定期开放债券A份额净值增长率为2.12%,业绩比较基准收益率为0.24%。

2019年上半年,景顺长城景泰稳利定期开放债券C份额净值增长率为1.91%,业绩比较基准收益率为0.24%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,海外随着美国经济回落,联储释放降息信号,全球新一轮宽松即将开启,预计年内联储降息1-2次。国内方面,预计整体经济增长进一步回落,地产已经开始出现走弱,制造业和基建投资依然较弱,消费受基数影响回升,但整体难有起色。2季度包商银行事件后将产生长远影响,预计小银行的信用扩张能力会大幅收缩,低等级企业的融资成本会明显上升,会起到紧信用的作用,抵消了部分政策放松的效果。政策面,下半年货币政策可能通过降准配合地方债发行;直接降息存在一定制约,较大可能采用"利率两轨并一轨"模式,通过LPR利率下行引导实体融资利率下行。下半年财政政策仍有空间,允许地方专项债用作部分项目的资本金,将对基建投资带来正面影响,但整体宏观杠杆率较高水平下,预计政策主要是对经济起到托底作用,整体经济延续弱势下行。

债券投资方面,3季度是做多长久期利率的窗口,但在接近前期低点的时候需注意波段操作。中低等级信用利差有继续走扩压力,下半年中低等级信用债集中到期压力较大叠加结构化产品的消失,预计后续信用风险事件还会持续。策略上建议宽松的货币环境下杠杆效应显著,可通过中高等级品种提高杠杆。

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

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至2018年12月25日,本基金A类份额可供分配利润为892,195.39元,本基金C类份额可供分配利润为4,370,552.77元,本基金的基金管理人已于2019年1月3日完成权益登记,本基金A类份额每10份基金份额派发红利0.10元,本基金C类份额每10份基金份额派发红利0.10元。详细信息请查阅相关分红公告。

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,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称"本托管人")在景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内,本基金共进行利润分配109.87万元。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	115,594,755.60	47,958,931.48
结算备付金	-	1,732,457.59
存出保证金	12,457.33	13,546.58
交易性金融资产	261,141,000.00	140,950,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	261,141,000.00	140,950,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	6,150,392.32	1,842,817.82
应收股利	-	-
应收申购款	-	19,087,271.11
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	382,898,605.25	211,585,024.58
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	70,549,724.72	33,069,784.89
应付证券清算款	-	20,909.80
应付赎回款	116,318,255.19	71,648,338.30
应付管理人报酬	73,784.05	36,407.30
应付托管费	24,594.66	12,135.77
应付销售服务费	11,794.65	39,647.54
应付交易费用	6,966.83	20,015.32
应交税费	212.70	15,439.35
应付利息	11,176.71	404.36
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,798.13	369,000.00
负债合计	187,102,307.64	105,232,082.63
所有者权益:		
实收基金	186,478,545.50	102,355,628.93
未分配利润	9,317,752.11	3,997,313.02
所有者权益合计	195,796,297.61	106,352,941.95
负债和所有者权益总计	382,898,605.25	211,585,024.58

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额总额186,478,545.50份,其中景顺长城景泰稳利定期开放债券A基金份额总额为161,791,731.68份,基金份额净值1.0501元;景顺长城景泰稳利定期开放债券C基金份额总额为24,686,813.82份,基金份额净值1.0490元。

6.2利润表

会计主体:景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	5,056,772.57	16,088,707.03
1.利息收入	4,558,805.05	18,705,456.10
其中:存款利息收入	34,198.68	5,840,210.62
债券利息收入	4,502,786.47	11,148,937.89
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	21,819.90	1,716,307.59
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-134,807.84	-2,615,709.75
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-134,807.84	-2,615,709.75
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	632,745.29	-1,039.32
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	30.07	-
减:二、费用	1,048,163.97	3,150,103.75
1.管理人报酬	322,848.15	873,625.95
2.托管费	107,616.08	291,208.59
3.销售服务费	121,085.36	-
4.交易费用	8,741.76	14,407.15
5.利息支出	365,264.23	1,736,740.74
其中:卖出回购金融资产支出	365,264.23	1,736,740.74
6.税金及附加	7,210.26	30,484.03
7.其他费用	115,398.13	203,637.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,008,608.60	12,938,603.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	4,008,608.60	12,938,603.28

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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)	102,355,628.93	3,997,313.02	106,352,941.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,008,608.60	4,008,608.60
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)	84,122,916.57	2,410,578.47	86,533,495.04
其中:1.基金申购款	305,640,349.91	11,973,143.61	317,613,493.52
2.基金赎回款	-221,517,433.34	-9,562,565.14	-231,079,998.48
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)	-	-1,098,747.98	-1,098,747.98
五、期末所有者权益(基金净值)	186,478,545.50	9,317,752.11	195,796,297.61
项目	上年度可比期间 2018年1月1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)	770,327,835.74	718,858.53	771,046,694.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,938,603.28	12,938,603.28
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)	-470,131,628.38	-1,552,191.74	-471,683,820.12
其中:1.基金申购款	101,450,074.38	152,175.07	101,602,249.45
2.基金赎回款	-571,581,702.76	-1,704,366.81	-573,286,069.57
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)	-	-9,012,836.66	-9,012,836.66
五、期末所有者权益(基金净值)	300,196,207.36	3,092,433.41	303,288,640.77

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

景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2017]1952号文《关于准予景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准,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《景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金基金合同》作为发起人于2017年12月1日至2017年12月15日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60467014_H09号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年12月26日(基金合同生效日)生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币770,157,249.08元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币170,586.66元,以上实收基金合计为人民币770,327,835.74元,折合770,327,835.74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,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的约定,经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,景顺长城基金管理有限公司决定自2018年6月11日起对景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金在现有份额的基础上增设C类基金份额,原基金份额转为A类基金份额。A类基金份额在投资者申购时收取申购费用,在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用,而不计提销售服务费;C类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用,而在赎回时根据持有期限收取赎回费,且从本类别基金资产中计提销售服务费。两类基金份额分别设置代码,并分别计算基金份额净值。两类份额之间不得相互转换。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券、可转换债券(含分离型可转换债券)、可交换债券、银行存款、同业存单等,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。本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。

本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%,在每个开放期的前10个工作日和后10个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制。同时,在具体会计估值核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

无。

6.4.6税项

(1)印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

(2)增值税及附加、企业所得税

自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,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;根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,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(以下称资管产品运营业务),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的,资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资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,股权的股息、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)个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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、注册登记人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司("邮储银行")	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3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未发生应支付关联方佣金支出。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	322,848.15	873,625.95
其中:支付销售机构的客户维护费	43,519.50	105.07

注: 基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,616.08	291,208.59

注:基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景泰稳利定期开放债券A	景顺长城景泰稳利定期开放债券C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	2.40	2.40
邮储银行	-	100.03	100.03
合计	-	102.43	102.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景泰稳利定期开放债券A	景顺长城景泰稳利定期开放债券C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	-	-
邮储银行	-	-	-
合计	-	-	-

注:1、本基金于2018年6月11日起对景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金在现有份额的基础上增设C类基金份额类别,原份额更名为A类基金份额。

2、基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮储银行	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
邮储银行	-	-	-	-	330,611,000.00	82,321.97

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.8.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
邮储银行	115,594,755.60	21,893.61	32,261,656.42	67,066.53

注:本基金的活期银行存款由基金托管人邮储银行保管,并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内均未重大参与关联方承销的证券投资。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末,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为70,549,724.72元,是以如下债券作为质押:

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
180211	18国开11	2019年7月1日	101.20	340,000	34,408,000.00
190203	19国开03	2019年7月1日	99.36	430,000	42,724,800.00
合计				770,000	77,132,800.00

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2019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划分为第二层次的余额为人民币261,141,000.00元,无划分为第一层次和第三层次的余额(于2018年12月31日,第二层次的余额为人民币140,950,000.00元,无划分为第一层次和第三层次的余额)。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况,本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次;根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具;本基金本报告期无净转入(转出)第三层次。

(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。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月21日经本基金的基金管理人批准。

§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	261,141,000.00	68.20
	其中:债券	261,141,000.00	68.20
	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	115,594,755.60	30.19
8	其他各项资产	6,162,849.65	1.61
9	合计	382,898,605.25	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前十名股票投资明细

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	261,141,000.00	133.37
	其中:政策性金融债	261,141,000.00	133.37
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	261,141,000.00	133.37

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	180211	18国开11	900,000	91,080,000.00	46.52
2	190203	19国开03	800,000	79,488,000.00	40.60
3	180212	18国开12	500,000	50,560,000.00	25.82
4	190202	19国开02	300,000	29,901,000.00	15.27
5	180202	18国开02	100,000	10,112,000.00	5.16

7.7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。

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	12,457.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,150,392.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,162,849.65

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。

§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

份额级别	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(%)
景顺长城景泰稳利定期开放债券A	682	237,231.28	156,403,887.53	96.67	5,387,844.15	3.33
景顺长城景泰稳利定期开放债券C	242	102,011.63	999.90	0.00	24,685,813.92	100.00
合计	924	201,816.61	156,404,887.43	83.87	30,073,658.07	16.13

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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

单位:份

项目	景顺长城景泰稳利定期开放债券A	景顺长城景泰稳利定期开放债券C
基金合同生效日(2017年12月26日)基金份额总额	770,327,835.74	-
本报告期期初基金份额总额	28,190,932.55	74,164,696.38
本报告期基金总申购份额	267,216,031.48	38,424,318.43
减:本报告期基金总赎回份额	133,615,232.35	87,902,200.99
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	161,791,731.68	24,686,813.82

注:总申购份额含自由开放期申购份额含转换入及红利再投资份额,总赎回份额含自由开放期日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: 报告期内本基金管理人无重大人事变动。 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	
平安证券股份有限公司	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.本基金本报告期交易单元未变更。

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
平安证券股份有限公司	125,237,783.55	100.00%	1,083,000,000.00	100.00%	-	-

§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	20190402-20190630	-	146,740,049.99	-	146,740,049.99	78.69
	2	20190402-20190626	-	96,134,397.23	96,134,397.23	-	-
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。

景顺长城基金管理有限公司
2019年8月23日