

景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39

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	40
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	40
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.11 投资组合报告附注	40
§ 8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§ 12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	景顺长城景泰汇利定期开放债券	
场内简称	无	
基金主代码	003605	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 11 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,853,455,306.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类
下属分级基金的交易代码	003605	008554
报告期末下属分级基金的份额总额	5,853,165,916.18 份	289,390.11 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种，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	<p>1、封闭期投资策略</p> <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) 固定收益类资产投资策略</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、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。</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，以期获得长期稳定收益。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95595
传真	0755-22381339	010-63639132
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	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类
本期已实现收益	86,139,307.88	24,824.51
本期利润	155,044,323.93	50,031.10
加权平均基金份额本期利润	0.0305	0.0367
本期加权平均净值利润率	2.58%	3.13%
本期基金份额净值增长率	2.70%	2.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	948,416,147.06	45,381.90
期末可供分配基金份额利润	0.1620	0.1568
期末基金资产净值	6,969,376,627.53	343,025.61
期末基金份额净值	1.1907	1.1853
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	38.46%	18.88%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.43%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.22%	-0.02%
过去三个月	1.33%	0.04%	1.06%	0.07%	0.27%	-0.03%
过去六个月	2.70%	0.04%	2.42%	0.07%	0.28%	-0.03%
过去一年	4.50%	0.05%	3.27%	0.06%	1.23%	-0.01%
过去三年	12.44%	0.05%	6.58%	0.05%	5.86%	0.00%
自基金合同生效起至今	38.46%	0.05%	17.06%	0.06%	21.40%	-0.01%

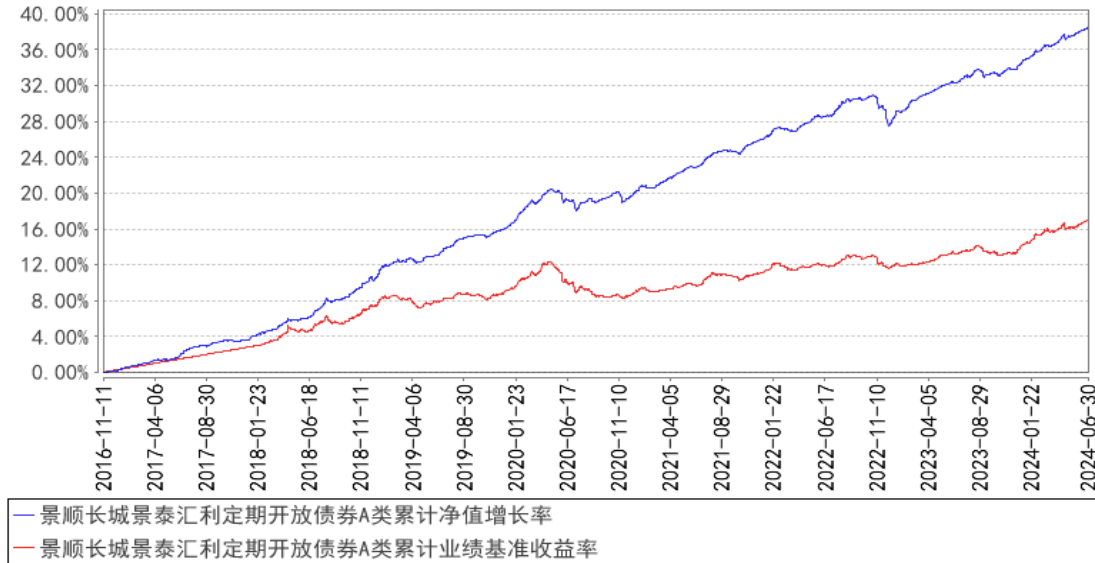
景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类

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	0.42%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.23%	-0.02%
过去三个月	1.31%	0.05%	1.06%	0.07%	0.25%	-0.02%
过去六个月	2.66%	0.04%	2.42%	0.07%	0.24%	-0.03%
过去一年	4.41%	0.05%	3.27%	0.06%	1.14%	-0.01%
过去三年	12.12%	0.05%	6.58%	0.05%	5.54%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.88%	0.06%	7.62%	0.06%	11.26%	0.00%

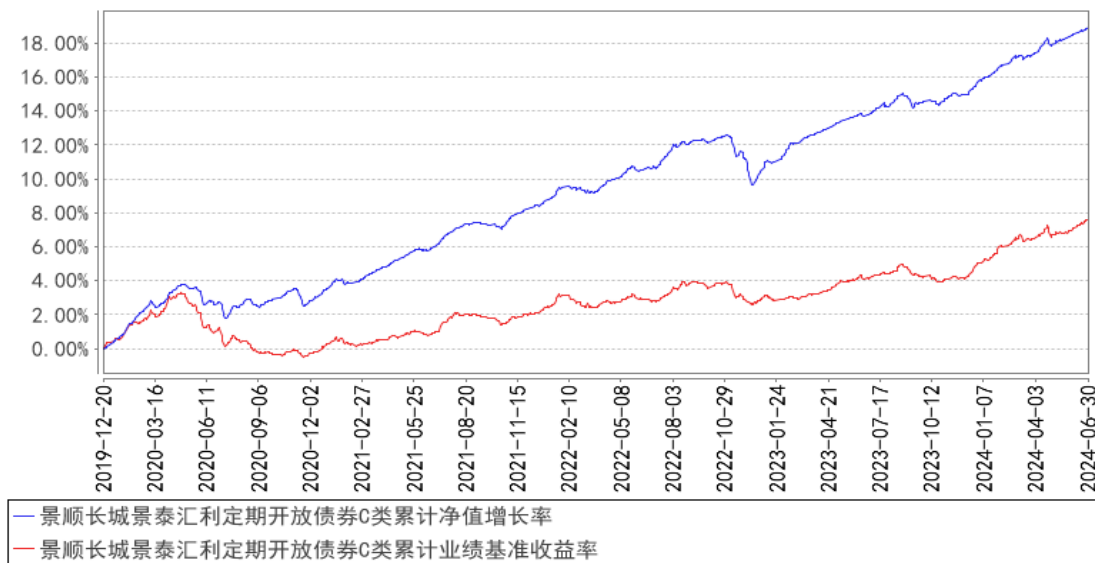
注：本基金于 2019 年 12 月 19 日增设 C 类基金份额，并于 2019 年 12 月 20 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城景泰汇利定期开放债券A类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



景顺长城景泰汇利定期开放债券C类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：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 1 个月和后 1 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内，本基金每个交易日日终持有现金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。本基金的建仓期为自 2016 年 11 月 11 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。自 2018 年 2 月 7 日，本基金的业绩比较基准由“六个月银行定期存款利率（税后）+1.2%”改为“中债综合全价（总值）指数”。本基金于 2019 年 12 月 19 日增设 C 类基金份额，并于 2019 年 12 月 20 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“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，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2024年6月30日，本公司旗下共管理184只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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		
何江波	本基金的基金经理	2019年2月14日	-	14年	经济学硕士。曾任中国农业银行股份有限公司总行信用管理部行业政策一处专员。2016年4月加入本公司，担任专户投资部投资经理，自2019年2月起担任固定收益部基金经理，现任固定收益部总监、基金经理。具有14年证券、基金行业从业经验。

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。

4.1.3 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合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》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、《景顺长城景泰汇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 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

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

上半年经济增速整体节奏前高后低，内生需求不足和外部干扰不断是当前经济面临的主要矛盾。

消费保持温和复苏，但整体数据偏弱。自疫情以来，受地产市场拖累，我国居民及企业消费明显走弱。除房价外，就业情况同样对国民消费形成较大影响。

通胀方面，当前处于低通胀阶段，但数据有所改善。一是猪肉价格上涨对 CPI 的贡献在扩大，二是新旧能源交替转换过程中对 CPI 的拉动，三是季节性的旅游文娱相关服务消费稳步增长，核心 CPI 支撑韧性较强。

工业企业利润方面，受到 PPI 的制约影响偏高。从历史经验来看，由于工业增加值的同比增速相对稳定，价格变动对利润率的影响更为明显。而今年以来 PPI 持续低位运行，利润率回升更多依靠增加值的拉动。从利润率的增速水平来看，1-4 月份工业企业营业收入利润率累计同比

增速为 1.0%，好于 1-3 月份的 0.0%，但低于 1-2 月的 2.2%。从利润率的绝对水平来看，1-4 月工业企业营业收入利润率为 5.0%，亦处于有数据以来的较低水位。

上半年，银行间资金面整体保持平稳，但资金价格中枢多数情况下仍处于政策利率之上。上半年央行降准 50 个基点，释放流动性约 1 万亿元。同时在重要时点上，央行通过 7 天、14 天逆回购操作向市场提供流动性支持，确保流动性整体保持平稳。

现券市场方面，二季度收益率震荡下行，一年存单收益率下行 28BP，5 年、10 年和 30 国债分别下行 18BP、5BP 和 0.5BP。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景泰汇利 A 类基金份额净值增长率为 2.70%，业绩比较基准收益率为 2.42%。

2024 年上半年，景泰汇利 C 类基金份额净值增长率为 2.66%，业绩比较基准收益率为 2.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内经济可能出现边际回升。发行进度明显落后的地方政府债有望提速，地方债项目落地有望带动银行配套信贷投放，设备更新和消费品以旧换新也有望在金融端获得更多支持，信贷有望边际改善。“607”国常会提出“继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，稳地产政策有望持续出台。国务院发布《推动大规模设备更新和消费品以旧换新行动方案》，对设备更新行动提出了更为具体的指导和量化目标，叠加预算内资金、5000 亿“科技创新和技术改造再贷款”以及财政贴息的支持，设备投资有望延续高增速。房价环比的加速下行对居民资产负债表的冲击依旧持续抑制居民的消费意愿，但随着财政力度的边际扩大，有望带动经济边际回暖，从而带动居民就业和收入边际改善，叠加暑期出游旺季，有望带动消费向上修复。通胀将会维持偏弱回升的态势。随着专项债的加速发行使用叠加超长期特别国债项目的落地，有望带动基建实物工作量提升，从而对 PPI 价格形成支撑，但是房地产维持弱势、结构性供需错配依旧对价格形成持续压制，价格偏弱的格局将会延续。

债市方面，融资需求偏弱、欠配压力未缓解以及存贷款利率继续下行，都是债市的重要支撑。但收益率下行过快，各种利差处于新低，市场继续下行面临的阻力在不断加大。不过在基本面、资金面以及配置盘的支撑下，即便有调整，幅度也将有限，调整将是加仓的好机会。

策略上中短久期债券立足票息，积极把握长久期债券的交易机会。

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、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 2024 年 1 月 29 日，本基金 A 类份额可供分配利润为 762,289,339.86 元；本基金 C 类份额可供分配利润为 317,372.83 元。本基金的基金管理人已于 2024 年 2 月 1 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 0.177 元，本基金 C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.176 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，中国光大银行股份有限公司在景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基

金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	654,530.24	1,767,613.47
结算备付金		7,057,451.07	39,312,634.97
存出保证金		8,511.91	27,305.72
交易性金融资产	6.4.7.2	8,074,670,403.29	7,109,190,034.30
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,074,670,403.29	7,109,190,034.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		496,000.00	274,667.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		8,082,886,896.51	7,150,572,256.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
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		1,110,293,287.27	1,768,378,717.81
应付清算款		13,116.18	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,710,045.47	1,363,621.15
应付托管费		570,015.13	454,540.37
应付销售服务费		28.06	205.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		379,832.99	445,774.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	200,918.27	458,317.53
负债合计		1,113,167,243.37	1,771,101,176.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	5,853,455,306.29	4,570,692,591.67
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,116,264,346.85	808,778,488.18
净资产合计		6,969,719,653.14	5,379,471,079.85
负债和净资产总计		8,082,886,896.51	7,150,572,256.28

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 5,853,455,306.29 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.1907 元，基金份额 5,853,165,916.18 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1853 元，基金份额 289,390.11 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		180,848,097.59	231,184,949.28
1. 利息收入		285,863.89	1,232,728.08
其中：存款利息收入	6.4.7.13	273,744.05	171,122.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,119.84	1,061,605.82
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		111,632,011.06	142,510,732.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	111,632,011.06	142,510,732.68
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	68,930,222.64	87,441,488.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		25,753,742.56	29,863,208.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,951,543.70	10,762,765.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,983,847.83	3,587,588.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	798.36	1,117.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		13,388,177.45	14,908,400.77

其中：卖出回购金融资产支出		13,388,177.45	14,908,400.77
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		291,130.54	465,721.97
8. 其他费用	6.4.7.23	138,244.68	137,614.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		155,094,355.03	201,321,740.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		155,094,355.03	201,321,740.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		155,094,355.03	201,321,740.29

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,570,692,591.67	-	808,778,488.18	5,379,471,079.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,570,692,591.67	-	808,778,488.18	5,379,471,079.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,282,762,714.62	-	307,485,858.67	1,590,248,573.29
（一）、综合收益总额	-	-	155,094,355.03	155,094,355.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,282,762,714.62	-	234,288,794.72	1,517,051,509.34
其中：1. 基金申购款	1,786,779,188.36	-	325,671,192.28	2,112,450,380.64

2. 基金赎回款	-504,016,473.74	-	-91,382,397.56	-595,398,871.30
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-81,897,291.08	-81,897,291.08
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,853,455,306.29	-	1,116,264,346.85	6,969,719,653.14
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,601,704,527.02	-	563,752,652.17	5,165,457,179.19
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4,601,704,527.02	-	563,752,652.17	5,165,457,179.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,302,026,827.50	-	361,170,172.15	1,663,196,999.65
(一)、综合收益总额	-	-	201,321,740.29	201,321,740.29
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,302,026,827.50	-	159,848,431.86	1,461,875,259.36
其中: 1. 基金申购款	4,396,215,980.94	-	626,668,461.29	5,022,884,442.23
2. 基金赎回款	-3,094,189,153.44	-	-466,820,029.43	-3,561,009,182.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产	-	-	-	-

减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,903,731,354.52	-	924,922,824.32	6,828,654,178.84

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

景顺长城景泰汇利定期开放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[2016]1388号《关于准予景顺长城景泰汇利定期开放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《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币2,000,257,911.47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(2016)第1467号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2016年11月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,000,437,930.99份基金份额,其中认购资金利息折合180,019.52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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景泰汇利定期开放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依法发行的固定收益类品种,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。

根据本基金基金份额持有人大会于 2018 年 1 月 8 日表决通过的《关于景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金调整基金运作方式并修改基金合同的议案》的相关规定，本基金于 2018 年 2 月 7 日正式调整基金运作方式。经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，基金管理人景顺长城基金管理有限公司已修订《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金合同》。调整后的基金合同约定，本基金的投资组合比例调整为：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 天和后 10 天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，本基金每个交易日日终持有现金（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。本基金的业绩比较基准调整为：中债综合全价（总值）指数。

根据本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2019 年 12 月 13 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，自 2019 年 12 月 19 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。根据更新后的《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但不同类别基金份额之间不能相互转换。

本基金以定期开放的方式运作。本基金拟设定封闭期，每相邻两个开放期之间运作时段为一个封闭期，时长 3 个月。封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间。本基金自封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，每个开放期为 5 工作日。在开放期间本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务。本基金原封闭期时长为 6 个月。

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 2024 年 8 月 28 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前(如适用)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。

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 2018 年 1 月 1 日起(如适用)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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	654,530.24
等于：本金	654,382.01
加：应计利息	148.23
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	654,530.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	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	1,089,726,417.13	16,394,748.49	1,114,867,748.49	8,746,582.87
	银行间市场	6,807,991,228.13	79,873,974.80	6,959,802,654.80	71,937,451.87
	合计	7,897,717,645.26	96,268,723.29	8,074,670,403.29	80,684,034.74
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,897,717,645.26	96,268,723.29	8,074,670,403.29	80,684,034.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	72,273.59
其中：交易所市场	-
银行间市场	72,273.59
应付利息	-
预提费用	128,644.68
合计	200,918.27

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,568,623,051.96	4,568,623,051.96
本期申购	1,786,675,425.03	1,786,675,425.03
本期赎回（以“-”号填列）	-502,132,560.81	-502,132,560.81
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	5,853,165,916.18	5,853,165,916.18

景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,069,539.71	2,069,539.71
本期申购	103,763.33	103,763.33
本期赎回（以“-”号填列）	-1,883,912.93	-1,883,912.93
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	289,390.11	289,390.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	742,543,405.62	65,878,997.07	808,422,402.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	742,543,405.62	65,878,997.07	808,422,402.69
本期利润	86,139,307.88	68,905,016.05	155,044,323.93
本期基金份额交易产生的变动数	201,595,794.63	33,010,551.17	234,606,345.80
其中：基金申购款	282,124,803.92	43,528,417.44	325,653,221.36
基金赎回款	-80,529,009.29	-10,517,866.27	-91,046,875.56
本期已分配利润	-81,862,361.07	-	-81,862,361.07
本期末	948,416,147.06	167,794,564.29	1,116,210,711.35

景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	326,429.62	29,655.87	356,085.49
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	326,429.62	29,655.87	356,085.49
本期利润	24,824.51	25,206.59	50,031.10
本期基金份额交易产生的变动数	-270,942.22	-46,608.86	-317,551.08
其中：基金申购款	15,554.38	2,416.54	17,970.92
基金赎回款	-286,496.60	-49,025.40	-335,522.00
本期已分配利润	-34,930.01	-	-34,930.01

本期末	45,381.90	8,253.60	53,635.50
-----	-----------	----------	-----------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		37,794.03
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		235,826.26
其他		123.76
合计		273,744.05

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		109,713,364.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		1,918,646.92
债券投资收益——赎回差价收入		-
债券投资收益——申购差价收入		-
合计		111,632,011.06

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额		4,018,411,453.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额		3,961,674,661.75
减：应计利息总额		54,764,908.71

减：交易费用	53,236.50
买卖债券差价收入	1,918,646.92

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	68,930,222.64
股票投资	-
债券投资	68,930,222.64
资产支持证券投资	-
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	68,930,222.64
----	---------------

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,900.00
合计	138,244.68

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
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,951,543.70	10,762,765.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,595,988.28	1,280,125.26
应支付基金管理人的净管理费	7,355,555.42	9,482,640.38

注：支付基金管理人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 X 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,983,847.83	3,587,588.56

注：支付基金托管人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 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	649.54	649.54

光大银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	649.54	649.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	995.78	995.78
光大银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	995.78	995.78

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
光大银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
光大银行	-	-	-	-	570,081,000.00	43,112.43

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

份额单位：份

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
光大银行	1,923,926,788.74	32.87	1,923,926,788.74	42.11

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的总份额。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
光大银行-活期	654,530.24	37,794.03	2,598,137.80	84,419.48

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

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

单位：人民币元

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024年2月1日	-	2024年2月1日	0.1770	68,348,565.78	13,513,795.29	81,862,361.07	-

合计	-	-	-	0.1770	68,348,565.78	13,513,795.29	81,862,361.07	-
景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份 额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 2 月 1 日	-	2024 年 2 月 1 日	0.1760	3,647.39	31,282.62	34,930.01	-
合计	-	-	-	0.1760	3,647.39	31,282.62	34,930.01	-

6.4.12 期末（2024 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

本基金于本报告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

截至本报告期末 2024 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 1,011,285,972.19 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
102100616	21 科学城 MTN002	2024 年 7 月 1 日	104.56	600,000	62,735,270.14
102101734	21 无锡建投 MTN003(权益出资)	2024 年 7 月 1 日	106.01	100,000	10,601,131.15
102280342	22 洋河 MTN001A	2024 年 7 月 1 日	101.80	200,000	20,359,639.34
102280982	22 洋河 MTN002	2024 年 7 月 1 日	101.41	100,000	10,140,734.25
102282060	22 鄂交投 MTN004	2024 年 7 月 1 日	102.85	500,000	51,424,344.26
102282077	22 闽能源 MTN003	2024 年 7 月 1 日	102.65	600,000	61,591,842.62
102380899	23 光大水务 MTN001	2024 年 7 月 1 日	102.47	200,000	20,493,205.48
102381570	23 徐州新盛 MTN003	2024 年 7 月 1 日	102.34	200,000	20,467,358.90
102381697	23 光大水务 MTN002	2024 年 7 月 1 日	104.42	400,000	41,768,852.46
102382170	23 光大水务 MTN003	2024 年 7 月 1 日	103.74	500,000	51,869,655.74
220008	22 付息国债 08	2024 年 7 月 1 日	117.61	900,000	105,847,622.95
220215	22 国开 15	2024 年 7 月 1 日	107.77	100,000	10,777,251.37
220220	22 国开 20	2024 年 7 月 1 日	105.46	100,000	10,545,964.48
230002	23 付息国债 02	2024 年 7 月 1 日	103.76	100,000	10,376,180.33
230023	23 付息国债 23	2024 年 7 月 1 日	112.69	1,000,000	112,691,147.54
230205	23 国开 05	2024 年 7 月 1 日	106.51	200,000	21,301,610.96
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 1 日	102.20	274,000	28,001,553.86

230215	23 国开 15	2024 年 7 月 1 日	105.19	600,000	63,114,491.80
102100891	21 汉江国资 MTN002	2024 年 7 月 2 日	104.75	300,000	31,426,339.73
102280638	22 厦门住宅 MTN001	2024 年 7 月 2 日	102.11	400,000	40,842,498.63
102282455	22 松江国投 MTN002	2024 年 7 月 2 日	102.48	100,000	10,248,065.57
102382753	23 绍兴交投 MTN002	2024 年 7 月 2 日	104.04	300,000	31,211,000.00
102103138	21 镜湖开发 MTN003	2024 年 7 月 3 日	102.60	700,000	71,817,207.65
102103222	21 镜湖开发 MTN002	2024 年 7 月 3 日	102.48	200,000	20,495,213.11
102281803	22 芜湖建设 MTN004	2024 年 7 月 3 日	103.33	500,000	51,665,360.66
102380412	23 钱江世纪 MTN001	2024 年 7 月 3 日	103.41	400,000	41,364,081.10
102382792	23 成都天府 MTN001	2024 年 7 月 3 日	104.46	500,000	52,231,803.28
102381654	23 泰州城建 MTN002	2024 年 7 月 4 日	104.98	500,000	52,488,688.52
102382768	23 长交集团 MTN001	2024 年 7 月 4 日	104.03	300,000	31,209,000.00
102383026	23 瀚蓝 MTN001	2024 年 7 月 4 日	102.85	300,000	30,856,121.31
合计				11,174,000	1,179,963,237.19

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,007,315.08 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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%。

于本报告期末，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的账面价值占基金净资产的比例为 110.30%（上年度末：128.56%）。

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公司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 2024 年 6	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

景顺长城景泰汇利定期开放债券 2024 年中期报告

月 30 日							
资产							
货币资金	654,530.24	-	-	-	-	-	654,530.24
结算备付金	7,057,451.07	-	-	-	-	-	7,057,451.07
存出保证金	8,511.91	-	-	-	-	-	8,511.91
交易性金融资产	-30,941,663.01	1,799,449,985.80	4,658,657,770.94	1,585,620,983.54	-	-	-8,074,670,403.29
应收清算款	-	-	-	-	-	496,000.00	496,000.00
资产总计	7,720,493.22	30,941,663.01	1,799,449,985.80	4,658,657,770.94	1,585,620,983.54	496,000.00	8,082,886,896.51
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,710,045.47	1,710,045.47
应付托管费	-	-	-	-	-	570,015.13	570,015.13
应付清算款	-	-	-	-	-	13,116.18	13,116.18
卖出回购金融资产款	1,110,293,287.27	-	-	-	-	-	-1,110,293,287.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28.06	28.06
应交税费	-	-	-	-	-	379,832.99	379,832.99
其他负债	-	-	-	-	-	200,918.27	200,918.27
负债总计	1,110,293,287.27	-	-	-	-	2,873,956.10	1,113,167,243.37
利率敏感度缺口	-1,102,572,794.05	30,941,663.01	1,799,449,985.80	4,658,657,770.94	1,585,620,983.54	-	-
上年度末 2023 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							
货币资金	1,767,613.47	-	-	-	-	-	1,767,613.47
结算备付金	39,312,634.97	-	-	-	-	-	39,312,634.97
存出保证金	27,305.72	-	-	-	-	-	27,305.72
交易性金融资产	104,217,258.08	-	367,653,447.09	5,082,417,222.57	1,554,902,106.56	-	-7,109,190,034.30
应收清算款	-	-	-	-	-	274,667.82	274,667.82
资产总计	145,324,812.24	-	367,653,447.09	5,082,417,222.57	1,554,902,106.56	274,667.82	7,150,572,256.28
负债							

应付管理人报酬						-1,363,621.15	1,363,621.15
应付托管费						454,540.37	454,540.37
卖出回购金融资产款	1,768,378,717.81						-1,768,378,717.81
应付销售服务费						205.01	205.01
应交税费						445,774.56	445,774.56
其他负债						458,317.53	458,317.53
负债总计	1,768,378,717.81					-2,722,458.62	1,771,101,176.43
利率敏感度缺口	-1,623,053,905.57		367,653,447.09	5,082,417,222.57	1,554,902,106.56		

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		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-44,716,891.52	-31,796,524.75
	市场利率下降25个基点	45,686,293.01	32,058,644.81

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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告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

本报告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 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	8,074,670,403.29	7,109,190,034.30
第三层次	-	-
合计	8,074,670,403.29	7,109,190,034.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	8,074,670,403.29	99.90
	其中：债券	8,074,670,403.29	99.90
	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	7,711,981.31	0.10
8	其他各项资产	504,511.91	0.01
9	合计	8,082,886,896.51	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	228,914,950.82	3.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,937,782,043.58	27.80
	其中：政策性金融债	158,048,899.00	2.27
4	企业债券	1,280,945,762.08	18.38
5	企业短期融资券	50,092,110.68	0.72
6	中期票据	3,838,557,411.34	55.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	738,378,124.79	10.59
9	其他	-	-
10	合计	8,074,670,403.29	115.85

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	230023	23 付息国债 23	1,000,000	112,691,147.54	1.62
2	220008	22 付息国债 08	900,000	105,847,622.95	1.52
3	102282361	22 武侯产业 MTN001	1,000,000	103,056,459.02	1.48
4	112412055	24 北京银行 CD055	1,000,000	98,898,881.45	1.42
5	112499288	24 南京银行 CD141	1,000,000	98,728,238.41	1.42

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

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 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

北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	8,511.91
2	应收清算款	496,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	504,511.91

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

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 (%)

景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	870	6,727,776.92	5,850,241,857.92	99.95	2,924,058.26	0.05
景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	46	6,291.09	0.00	0.00	289,390.11	100.00
合计	916	6,390,235.05	5,850,241,857.92	99.95	3,213,448.37	0.05

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

项目	份额级别	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	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	5,563.03	0.000095
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	1.72	0.000594
	合计	5,564.75	0.000095

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	份额级别	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	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	0~10
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	-
	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城景泰汇利定期开放债券 A 类	景顺长城景泰汇利定期开放债券 C 类
基金合同生效日（2016 年 11 月 11 日）基金份额总额	2,000,437,930.99	-
本报告期期初基金份	4,568,623,051.96	2,069,539.71

额总额		
本报告期基金总申购份额	1,786,675,425.03	103,763.33
减：本报告期基金总赎回份额	502,132,560.81	1,883,912.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,853,165,916.18	289,390.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 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未发生重大人事变动。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金本报告期末更换会计师事务所。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 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，本基金的托管人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 (%)	
兴业证券股份有限公司	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，最近三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、本基金本期交易单元未发生变更。

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 (%)
兴业证券股份有限公司	51,187,256.30	100.00	26,775,700,000.00	100.00	-	-

司						
---	--	--	--	--	--	--

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	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 1 月 12 日至 1 月 18 日第二十四期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 9 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日
3	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 1 月 12 日至 1 月 18 日第二十四期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日
4	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 1 月 12 日至 1 月 18 日第二十四期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 11 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
6	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
7	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 31 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 22 日
9	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
11	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 13 日
13	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	2024 年 4 月 15 日
14	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 4 月 19 日至 4 月 25 日第二十五期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 16 日
15	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 4 月 19 日至 4 月 25 日第二十五期开放申	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 17 日

	购、赎回业务的公告		
16	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于 2024 年 4 月 19 日至 4 月 25 日第二十五个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 18 日
17	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
19	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金关于开放转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 23 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 24 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
22	景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日
23	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	2024 年 6 月 21 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 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	20240101-20240630	1,923,926,788.74	0.00	0.00	1,923,926,788.74	32.87

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汇利定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城景泰汇利定期开放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

2024年8月30日