东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27日

§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。本半年度报告由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23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01月01日起至06月30日。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	东方红稳添利纯债
基金主代码	002650
前端交易代码	002650
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2016年5月13日
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	968,559,369.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为纯债基金,主要通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金将采用自上而下的方法,在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上,对市场基本利率、债券类产品收益率、货币类产品收益率等大类产品收益率水平变化进行评估,并结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,针对不同行业、不同投资品种选择投资策略,以此做出最佳的资产配置及风险控制。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。
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,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,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		上海东方证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李云亮	张燕
	联系电话	021-63325888	0755-83199084
	电子邮箱	service@dfham.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009200808	95555
传真		021-63326981	0755-83195201

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.dfham.com
基金半年度报告备置地点	上海东方证券资产管理有限公司 上海市中山南路318号2号楼31层 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

§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)
本期已实现收益	18,383,001.06
本期利润	19,453,874.75
加权平均基金份额本期利润	0.0261
本期基金份额净值增长率	2.59%
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	0.0091
期末基金资产净值	1,049,327,963.26
期末基金份额净值	1.0834

注:1、表中的“期末”均指报告期最后一日,即6月30日;“本期”指2019年1月1日－ 2019年06月30日。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

4、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(为期末余额,不是当期发生数)。

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	0.43%	0.02%	0.27%	0.03%	0.16%	-0.01%
过去三个月	0.84%	0.04%	-0.05%	0.05%	0.89%	-0.01%
过去六个月	2.59%	0.04%	0.46%	0.05%	2.13%	-0.01%
过去一年	7.45%	0.05%	2.81%	0.05%	4.64%	0.00%
过去三年	12.12%	0.07%	1.69%	0.06%	10.43%	0.01%
自基金合同生效起至今	12.90%	0.07%	1.90%	0.06%	11.00%	0.01%

注:1、自基金合同生效日起至今指2016年5月13日－2019年6月30日。

2、根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理,t日收益率(benchmarkt)按下列公式计算:

benchmarkt =80% *[t日中债综合指数/(t-1日中债综合指数)-1] +20%*[中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率/365);

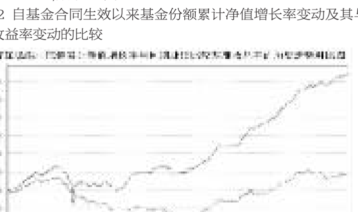
其中,t=1,2,3,. . . T,T表示时间截至日;

t日至T日的期间收益率(benchmarkTt)按下列公式计算:

benchmarkTt =[∏Tt(1+benchmarkt)]-1

其中,T=2,3,4,. . . ; ∏Tt (1+benchmarkt) 表示t日至T日的(1+benchmarkt)数学连乘。

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:截止日期为2019年6月30日。

§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

上海东方证券资产管理有限公司成立于2010年7月28日,是国内首家获中国证监会批准设立的券商系资产管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元在原东方证券资产管理业务总部的基础上成立。2013年8月,公司成为首家获得“公开募集证券投资基金管理业务资格”的证券公司。公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2019年6月30日,本基金管理人共管理东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿元三年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红中国优势灵活配置混合型证券投资基金、东方红领先精选灵活配置混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金、东方红优势精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红睿轩三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红汇阳债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红汇利债券型证券投资基金、东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东方红沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿华沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红优享红利沪港深灵活配置混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红货币市场基金、东方红睿玺三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红目标优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、东方红创新优选三年定期开放混合型证券投资基金、东方红配置精选混合型证券投资基金、东方红恒元五年定期开放混合型证券投资基金、东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金三十五只证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
纪文静	上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理、兼任东方红领先精选混合型证券投资基金、东方红稳健精选混合型证券投资基金、东方红睿逸定期开放混合型发起式证券投资基金、东方红6个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、东方红收益增强债券型证券投资基金、东方红信用债债券型证券投资基金、东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金、东方红战略精选沪港深混合型证券投资基金、东方红价值精选混合型证券投资基金、东方红益鑫纯债债券型证券投资基金、东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。	2016年5月13日	–	12	硕士,曾任东海证券股份有限公司固定收益部投资研究经理、销售交易经理,德邦证券股份有限公司债券投资与交易部总经理,上海东方证券资产管理有限公司固定收益部副总监;现任上海东方证券资产管理有限公司公募固定收益投资部副总经理兼任东方红领先精选混合、东方红稳健精选混合、东方红睿逸定期开放混合、东方红6个月定开纯债、东方红收益增强债券、东方红信用债债券、东方红稳添利纯债、东方红战略精选混合、东方红价值精选混合、东方红益鑫纯债债券、东方红智逸沪港深定开混合基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注:1、上述表格内基金首任基金经理“任职日期”指基金合同生效日,“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期;对此后非首任基金经理,基金经理的“任职日期”和“离任日期”均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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,上海东方证券资产管理有限公司作为本基金管理人,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、基金合同以及其它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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

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

年初宽信用政策开始发挥作用,金融数据企稳回升,市场对经济企稳的预期进一步增强;但中美贸易摩擦的反复、“包商事件”以及地产政策等的收紧,后续又引发了市场对宽信用效果持续性存疑、对经济继续下滑的担忧。债券市场上半年整体处于震荡走势,受益于宽松的货币市场环境,债券的息差收益仍然相对确定。上半年10年国债收益率持平在3.22%,10年国开收益率下行3BP至3.61%。本产品在债券配置上精选个券,有效防范信用风险,调整组合久期和杠杆,力争获取稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0834元;本报告期基金份额净值增长率为2.59%,业绩比较基准收益率为0.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为整体环境对债市仍有支撑。在外部不确定因素未消除之前,货币政策难以转紧,而中美贸易问题尽管有所缓解,但由此出口的压力依然存在。从内部来看,地产销售和投资逐渐下行、三四线城市棚改效应消退、新开工增速下行以及因城施策的调控政策下,后期地产销售和投资增速将逐渐下行,经济依然承压。尽管积极的财政政策将起到一定的托底作用,但难以改变趋势。在宽松的货币政策及经济承压的环境下,收益率易下难上,机会成本较低。信用债方面,“包商事件”的潜在影响仍未消除,信用利差扩大是必然趋势,同时由于机构需求将更加集中于高等级债券,AAA品种的溢价未来将持续。因此操作上仍需维持个券精细化操作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性,对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致(中国证监会规定的特殊品种除外)。为了保障基金能真实、准确地反映投资品种的公允价值,本基金管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系,估值委员会成员由投资、研究、运营、合规、风控等相关业务分管领导组成,运营业务分管领导为估值委员会主任委员,运营部是估值委员会的日常办事机构,运营部的估值人员均具有专业会计学习经历,具有基金从业人员资格。对于基金特殊估值调整事项,由估值委员会下设的估值业务工作小组提出调整方案并提交估值委员会审议,保证基金估值的公平合理,保持估值政策和程序的一贯性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

2、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准 ;

3、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

4、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行

调整,不需召开基金份额持有人大会。

本报告期内本基金进行了二次利润分配:

本基金管理人于2019年3月11日发布《东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金分红公告》,收益分配基准日为2019年3月1日,每10份基金份额派发红利0.10元;本基金共计派发现金红利5,141,835.65元,红利再投形式2,304,584.25元;。本基金管理人于2019年6月13日发布《东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金分红公告》,收益分配基准日为2019年6月5日,每10份基金份额派发红利0.10元;本基金共计派发现金红利6,826,417.13元,红利再投形式2,237,052.68元。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金为发起式基金,基金合同生效已满三年,报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度/年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度/年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	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		1,773,136.88	3,195,176.82
结算备付金		16,250,818.78	17,773,926.60
存出保证金		50,846.51	31,619.96
交易性金融资产		1,096,734,595.90	659,454,025.30
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		1,096,734,595.90	659,454,025.30
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		–	17,100,145.65
应收证券清算款		10,215,881.04	–
应收利息		20,648,134.91	14,589,931.44
应收股利		–	–
应收申购款		2,000.00	9,999,000.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,145,675,414.02	722,143,825.77
负债和所有者权益	附注号	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		88,000,000.00	175,800,000.00
应付证券清算款		7,262,550.61	2,796,622.90
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		640,429.01	362,141.91
应付托管费		213,476.34	120,713.97
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		3,244.99	6,508.27
应交税费		88,082.63	61,634.97
应付利息		47,945.26	122,960.66
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		91,721.92	260,000.00
负债合计		96,347,450.76	179,530,582.68
所有者权益:			
实收基金		968,559,369.64	504,418,466.21
未分配利润		80,768,593.62	38,194,776.88
所有者权益合计		1,049,327,963.26	542,613,243.09
负债和所有者权益总计		1,145,675,414.02	722,143,825.77

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0834元,基金份额总额968,559,369.64份。

6.2 利润表

会计主体:东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金

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	附注号	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		22,915,585.37	19,765,918.00
1.利息收入		19,572,298.05	13,957,397.12
其中:存款利息收入		150,275.90	31,773.93
债券利息收入		19,398,103.87	13,621,169.52
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		23,918.28	304,453.67
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,799,154.94	-29,129,881.06
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		1,799,154.94	-29,129,881.06
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)		1,070,873.69	34,938,401.94
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)		473,258.69	–
减:二、费用		3,461,710.62	1,954,199.83
1. 管理人报酬		1,196,853.50	717,474.38
2. 托管费		398,951.16	239,158.15
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		7,068.83	7,627.60
5. 利息支出		1,682,755.94	772,383.36
其中:卖出回购金融资产支出		1,682,755.94	772,383.36
6. 税金及附加		53,963.23	46,108.93
7. 其他费用		122,117.96	171,447.41
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		19,453,874.75	17,811,718.17
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		19,453,874.75	17,811,718.17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金

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)	504,418,466.21	38,194,776.88	542,613,243.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	19,453,874.75	19,453,874.75
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)	464,140,903.43	39,629,831.70	503,770,735.13
其中:1.基金申购款	560,246,591.15	47,675,774.21	607,922,365.36
2.基金赎回款	-96,105,687.72	-8,045,942.51	-104,151,630.23
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)	–	-16,509,889.71	-16,509,889.71
五、期末所有者权益(基金净值)	968,559,369.64	80,768,593.62	1,049,327,963.26
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)	706,109,668.00	913,430.82	707,023,098.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	17,811,718.17	17,811,718.17
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)	-447,858,694.59	-8,158,759.22	-456,017,453.81
其中:1.基金申购款	216,254,104.75	5,398,057.64	221,652,162.39
2.基金赎回款	-664,112,799.34	-13,556,816.86	-677,669,616.20
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)	–	-3,530,548.34	-3,530,548.34
五、期末所有者权益(基金净值)	258,250,973.41	7,035,841.43	265,286,814.84

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:

潘鑫 军任莉 詹朋

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

东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金(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]669号《关于准予东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由上海东方证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红稳添利纯债债券型发起式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、发起式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集209,999,000.00元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字(2016)第130547号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2016年5月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为209,999,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司发行的短期公司债券、分离交易可转债的纯债部分、债券逆回购、同业存单、银行存款等固定收益类资产、国债期货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相关规定。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率*80%+同期中国人民银行公布的三年期银行定期存款税后收益率*20%。

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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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[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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 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

本基金本报告期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
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东
上海东方证券资产管理有限公司(“东证资管”)	基金管理人、基金销售机构
上海东证期货有限公司(“东证期货”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
东方证券	595,795,313.00	92.09	253,925,526.70	98.10

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
东方证券	12,126,100,000.00	98.39	171,400,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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	1,196,853.50	717,474.38
其中:支付销售机构的客户维护费	6,250.00	–

注:1.本基金的管理费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=EX0.30%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每季季末,按季支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2.实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和销售机构对账确认的金额为准。

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	398,951.16	239,158.15

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=EX0.10%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每季季末,按季支付。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延 。

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

注:本基金本报告期内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。

6.4.8.4 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

份额单位:份

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
基金合同生效日(2016年5月13日)持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.0325%	3.8722%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30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(%)
东方证券	19,530,273.44	2.02	19,530,273.44	3.87

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 期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,773,136.88	22,248.33	34,897,124.23	23,401.28

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金支付给东证期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2019年6月30日,本基金无应付交易手续费余额(2018年12月31日:同)。于2019年1月1日至2019年6月30日,本基金无当期交易手续费支出(2018年1月1日至2018年6月30日:同)。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于东证期货的结算账户和保证金账户中,结算备付金按银行同业利率计息,存出保证金不计息。于2019年6月30日,本基金的结算备付金余额为4,112,364.81元,无存出保证金。(2018年12月31日:4,097,483.78,无存出保证金)。于2019年1月1日至2019年6月30日,本基金当期结算备付金利息收入14,847.62元(2018年1月1日至2018年6月30日: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

注:本基金本报告期末未持有认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注:截至本报告期末2019年06月30日止,本基金无因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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日止,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88,000,000.00元,于2019年07月01日、07月03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。

6.4.10 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属于属于第二层次的余额为1,096,734,595.90元,无属于第一层次或第三层次的余额(2018年12月31日:第二层次659,454,025.30,无第一层次或第三层次)。

(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。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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2019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(2018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)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	1,096,734,595.90	95.73
	其中:债券	1,096,734,595.90	95.73
	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	18,023,955.66	1.57
8	其他各项资产	30,916,862.46	2.70
9	合计	1,145,675,414.02	100.00

注:本基金本报告期末未持有股票。

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

注:本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

注:本基金本报告期末未进行股票投资。

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

注:本基金本报告期末未进行股票投资。

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

注:本基金本报告期末未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末未进行股票投资。

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	17,768,800.00	1.69
2	央行票据	–	–
3	金融债券	265,978,000.00	25.35
	其中:政策性金融债	150,130,000.00	14.31
4	企业债券	606,294,295.90	57.78
5	企业短期融资券	160,860,000.00	15.33
6	中期票据	45,833,500.00	4.37
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,096,734,595.90	104.52

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	190210	19国开10	900,000	90,288,000.00	8.60
2	136270	16南网01	500,000	49,795,000.00	4.75
3	136519	16陆嘴01	400,000	40,292,000.00	3.84
4	190201	19国开01	400,000	39,984,000.00	3.81
5	143570	18兵器01	300,000	30,642,000.00	2.92

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

注: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

注: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

注: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

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未进行国债期货投资。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金持有的前十名证券的发行主体本期未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。

7.11.2

本基金本报告期末未持有股票。

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	50,846.51
2	应收证券清算款	10,215,881.04
3	应收股利	–
4	应收利息	20,648,134.91
5	应收申购款	2,000.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	30,916,862.46

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转债。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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

由于四舍五入的原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 持有份额	占总份额比例(%)	个人投资者 持有份额	占总份额比例(%)
326	2,971,041.01	965,199,545.84	99.65	3,359,823.80	0.35

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	40,629.18	0.0042

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.03	10,000,000.00	1.03	3年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,000.00	1.03	10,000,000.00	1.03	3年

注:本基金成立日期为2016年6月13日,截至2019年6月30日,已满3年。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2016年5月13日)基金份额总额	209,999,000.00
本报告期期初基金份额总额	504,418,466.21
本报告期基金总申购份额	560,246,591.15
减:本报告期基金总赎回份额	96,105,687.72
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	968,559,369.64

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内没有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

本报告期内,卢强同志自2019年5月21日起辞去基金管理人副总经理职务;李云亮同志自2019年5月29日起兼任公司首席信息官职务。 本报告期内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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该事务所自2017年度起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中信建投证券	2	–	–	–	–	–
宏信证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	1	–	–	–	–	–
中信证券	2	–	–	–	–	–
川财证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
天风证券	1	–	–	–	–	–
汇丰前海	1	–	–	–	–	–
东方证券	3	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
高华证券	1	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	1	–	–	–	–	–
华菁证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
中泰证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	2	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	1	–	–	–	–	–

注::1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易(如有)而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

(1)选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范,最近一年无重大违规行为;具有较强的研究服务能力;交易佣金收费合理。

(2)选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价,然后根据评价选择券商,与其签订协议租用交易单元。

3、报告期内本公司已取得上海交易所租用其他券商交易单元的资格并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜,后续将陆续切换租用的其他券商交易单元;本公司已在深圳交易所获得租用券商交易单元的资格,并已按公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜。

4、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况:新增中信建投证券2个、招商证券1个、国信证券1个、中信证券2个、川财证券1个、东吴证券1个、汇丰前海1个、东方证券1个、安信证券1个、西部证券1个、高华证券1个、长江证券1个、兴业证券1个、国金证券1个、申万宏源1个、华泰证券1个、民生证券1个、华菁证券1个、光大证券1个、中泰证券1个、海通证券2个、广发证券2个、华创证券1个、西南证券1个、方正证券1个、国泰君安1个交易单元。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	–	–	–	–	–	–
宏信证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
川财证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
汇丰前海	–	–	–	–	–	–
东方证券	595,795,313.00	92.09%	12,126,100,000.00	98.39%	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	51,180,633.94	7.91%	185,000,000.00	1.50%	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
华菁证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	14,000,000.00	0.11%	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–

§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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

上海东方证券资产管理有限公司

2019年8月27日