

景顺长城量化精选股票型证券投资基金

2019 第二季度 报告

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: 中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: 2019年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金净值不受亏损及本金损失。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告自2019年06月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	景顺长城量化精选股票型证券投资基金
基金代码	000979
基金简称	量化精选
基金类型	股票型证券投资基金
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2015年12月22日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

项目	报告期(2019年1-6月)	本报告期末(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
1. 本期已实现收益	10,267,500.00	10,267,500.00	10,267,500.00
2. 本期公允价值变动收益	-154,562,000.00	-154,562,000.00	-154,562,000.00
3. 本期投资收益(含公允价值变动)	41,000.00	41,000.00	41,000.00
4. 本期其他综合收益	3,399,999.99	3,399,999.99	3,399,999.99
5. 本期净资产	1,000,000.00	1,000,000.00	1,000,000.00

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金名称	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准
景顺长城量化精选股票型证券投资基金	4.86%	1.96%	2.90%

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城量化精选股票型证券投资基金自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 基金投资组合

3.3.1 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.2 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.3 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.4 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.5 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.6 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.7 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.8 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.9 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.10 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.11 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.12 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.13 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.14 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.15 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.16 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.17 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.18 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.19 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.20 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.21 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.22 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.23 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

3.3.24 本报告期末基金投资组合资产配置比例表

报告期末总资产	1,000,000.00
权益投资	950,000.00
固定收益投资	50,000.00
其他资产	0.00

§4 投资组合报告

4.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物、医药	16,488,494.41	2.31
B 综合	196,213,214.33	27.82
C 制造业	1,749,926,224.24	24.52
D 采矿业	17,378,200.00	2.44
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	116,283,817.78	1.64
G 信息技术业	94,210,217.19	1.32
H 批发和零售业	4,210,217.19	0.06
I 房地产业	1,210,217.19	0.02
J 金融业	1,210,217.19	0.02
K 其他	1,210,217.19	0.02

4.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 医药、生物、医药	16,488,494.41	2.31
B 综合	196,213,214.33	27.82
C 制造业	1,749,926,224.24	24.52
D 采矿业	17,378,200.00	2.44
E 建筑业	-	-
F 交通运输、仓储业	116,283,817.78	1.64
G 信息技术业	94,210,217.19	1.32
H 批发和零售业	4,210,217.19	0.06
I 房地产业	1,210,217.19	0.02
J 金融业	1,210,217.19	0.02
K 其他	1,210,217.19	0.02

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	12,102,171	79,626,849.00	11.12
2	000002	万科A	11,111,111	66,666,666.00	9.38
3	000004	比亚迪	6,666,667	52,222,222.00	7.34
4	000003	招商银行	5,555,556	44,444,444.00	6.24
5	000005	格力电器	4,444,444	35,555,556.00	5.00
6	000006	中兴通讯	3,333,333	26,666,667.00	3.73
7	000007	中国石化	2,222,222	17,777,778.00	2.50
8	000008	五粮液	1,111,111	8,888,889.00	1.24
9	000009	浦发银行	1,111,111	8,888,889.00	1.24
10	000010	中国平安	1,111,111	8,888,889.00	1.24

4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
2	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
3	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
4	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
5	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
6	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
7	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
8	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
9	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
10	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14

4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
2	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
3	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
4	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
5	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
6	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
7	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
8	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
9	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
10	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14

4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
2	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
3	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
4	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
5	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
6	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
7	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
8	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
9	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
10	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14

4.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
2	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
3	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
4	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
5	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
6	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
7	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
8	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
9	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
10	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14

4.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
2	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
3	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
4	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
5	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
6	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
7	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
8	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	0.14
9	100000	国债	1,000,000	1,000,000.00	