景顺长城中证500指数增强型证券投资基金

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03月25日(基金合同生效日)起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	景顺长城中证500指数增强
场内简称	无
基金主代码	006682
交易代码	006682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年3月25日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,301,950,016.11份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金,在力求有效跟踪标的指数,控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%的基础上,结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	1、资产配置策略 本基金为指数基金,股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后,对基金资产配置做出合适调整。 2、股票投资策略 本基金作为增强型的指数基金,一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数,另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 3、债券投资策略 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量,本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况,采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率,确定债券资产配置。 4、权证、股指期货投资策略 本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量,运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。 5、中小企业私募债券的投资策略 对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面,本基金会加强自下而上的分析,将机构评级与内部评级相结合,着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力,尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时,本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942

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3月25日(基金合同生效日) - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-23,220,779.67
本期利润	-74,279,619.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0536
本期基金份额净值增长率	-6.19%
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	-0.0618
期末基金资产净值	1,221,441,524.62
期末基金份额净值	0.9381

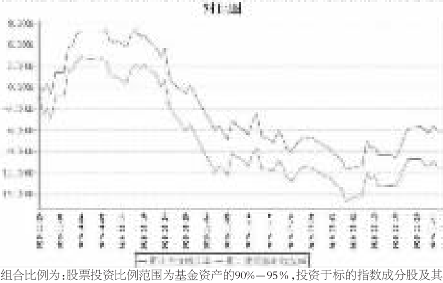
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位,小数点后第五位舍去,由此产生的误差计入基金资产。
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
5、本基金基金合同生效日为2019年3月25日。

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	1.76%	1.31%	0.75%	1.32%	1.01%	-0.01%
过去三个月	-8.18%	1.62%	-10.21%	1.72%	2.03%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-6.19%	1.60%	-11.33%	1.74%	5.14%	-0.14%

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:基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自2019年3月25日基金合同生效日起6个月。截至本报告期末,本基金仍处于建仓期。基金合同生效日(2019年3月25日)起至本报告期末不满一年。

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		
黎海威	本基金的基金经理、公司副总经理、量化及指数投资部投资总监	2019年3月25日	-	16	经济学硕士,CFA。曾担任美国穆迪KMV公司研究员,美国贝莱德集团(原巴克莱国际投资管理有限公司)基金经理、主动股票部副总裁,香港海通国际资产管理有限公司(海通国际投资管理有限公司)量化总监。2012年8月加入本公司,担任量化及ETF投资部投资总监,自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理,现担任公司副总经理兼量化及指数投资部总监兼量化及指数投资部基金经理。
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2019年3月25日	-	9	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司,担任量化及ETF投资部ETF专员;自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理,现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,“任职日期”为根据公司决定聘任后的公告日期,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2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、《景顺长城中证500指数增强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6月工业增加值累计增长6.0%,增速持平。6月PMI指数49.4,经济经历短期企稳后再度显示出疲态。6月PPI同比走平,环比下跌0.3%;CPI同比上涨2.7%,环比下跌0.1%,通胀预期维持平稳。6月M2同比增速8.5%,M1同比增速回升至4.4%,社会融资规模存量同比增长10.9%,增速维持平稳。6月末外汇储备3.1万亿美元,受贸易摩擦影响,汇率波动加大。年初在稳增长和宽信用的金融政策引导下,伴随着中美贸易摩擦预期改善,市场情绪较为乐观,迎来一波估值修复行情。2季度开始,美国对华为等公司的禁令超出市场预期,引发投资者对贸易摩擦和科技竞争的担忧,市场在冲高后加速回落进入震荡调整阶段。上半年上证综指、沪深300和创业板指数分别上涨19.45%,27.07%和20.87%。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2019年3月25日(基金合同生效日)至本报告期末,本基金份额净值增长率为-6.19%,业绩比较基准收益率为-11.33%。

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2019年下半年的宏观经济,全球经济面临增长放缓的风险,国内经济仍然存在下行压力。但随着中美贸易摩擦走向缓和,宽信用和稳增长货币政策延续,减税降费的实施,都会对经济基本面有一定支持。长期来看,改革创新是保持经济增长的根本动力,在供给侧改革和产业升级的背景下,我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前市场整体估值仍然处于合理位置,具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司,将具备较高的投资价值。

本基金是以中证500指数为基准的指数增强基金,我们的投资组合主要以基本面量化选股为主,风格上维持价值和成长之间的平衡,同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司,在股市波动中以自下而上选股为主以期产生超额收益。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策,基金估值委员会在遵守法律法规的前提下,通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式,谨慎合理地制定高效可行的估值方法,及时准确地进行份额净值的计量,保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后,将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人,基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,无误后返回给基金管理人,由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时,通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素,从价值投资的角度进行理论分析,并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证,并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通,必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性,控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后,基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对,法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末,本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作,由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在景顺长城中证500指数增强型证券投资基金(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。

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(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:景顺长城中证500指数增强型证券投资基金

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
资产:	
银行存款	73,402,385.90
结算备付金	3,563,194.65
存出保证金	800,342.67
交易性金融资产	1,150,648,641.25
其中:股票投资	1,150,648,641.25
基金投资	-
债券投资	-
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	14,705.74
应收股利	-
应收申购款	693,155.72
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,229,122,425.93
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	4,024,953.29
应付管理人报酬	1,187,380.19
应付托管费	197,896.72
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,144,812.17
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	125,858.94
负债合计	7,680,901.31
所有者权益:	
实收基金	1,301,950,016.11
未分配利润	-80,508,491.49
所有者权益合计	1,221,441,524.62
负债和所有者权益总计	1,229,122,425.93

注:1、报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9381元,基金份额总额1,301,950,016.11份。
2、本基金合同生效日为2019年3月25日,本财务报表实际报表编制期间为2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日。

6.2利润表

会计主体:景顺长城中证500指数增强型证券投资基金

本报告期:2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	-64,170,660.23
1.利息收入	372,829.13
其中:存款利息收入	372,829.13
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	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-14,529,493.62
其中:股票投资收益	-32,508,667.45
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	17,979,173.83
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-51,058,839.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,044,844.01
减:二、费用	10,108,959.19
1. 管理人报酬	4,306,742.01
2. 托管费	717,790.36
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	4,957,794.37
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	126,632.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-74,279,619.42
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-74,279,619.42

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城中证500指数增强型证券投资基金

本报告期:2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,508,879,568.71	-	1,508,879,568.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-74,279,619.42	-74,279,619.42
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)	-206,929,552.60	-6,228,872.07	-213,158,424.67
其中:1.基金申购款	67,114,201.88	-3,629,860.97	63,484,340.91
2.基金赎回款	-274,043,754.48	-2,599,011.10	-276,642,765.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,301,950,016.11	-80,508,491.49	1,221,441,524.62

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

景顺长城中证500指数增强型证券投资基金(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[2018]1897号文《关于准予景顺长城中证500指数增强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《景顺长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人于2019年2月21日至2019年3月20日向社会公开发行募集,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(2019)验字第60467014_H01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2019年3月25日正式生效。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1,507,912,000.78元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币967,567.93元,以上实收基金合计为人民币1,508,879,568.71元,折合1,508,879,568.71份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

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3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间经营成果和净值变动情况。

6.4.4重要会计政策和会计估计

6.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本报告期财务报表的实际编制期间系2019年3月25日(基金合同生效日)起至2019年6月30日止。

6.4.4.2记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2)金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债,主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债,按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,其摊销或减值产生的利得或损失,均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件时的金融资产将终止确认;当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

6.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,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;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按其估值日在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用相关可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值。

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时,金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和标的指数许可使用费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的相关交易费用在发生时按照确定的金额计入交易费用。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额计入当期费用。

6.4.4.11基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

(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”)	基金管理人股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金于本报告期无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3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,306,742.01
其中:支付销售机构的客户维护费	1,586,726.60

注:基金管理费每日计算,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1.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.20%/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3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	717,790.36

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的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/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

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本报告期基金管理人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3月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	73,402,385.90	338,943.69

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管,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

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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,本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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一层次的余额为人民币1,150,591,664.71,划分为第二层次的余额为人民币56,976.54元,无划分为第三层次的余额。

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	1,150,648,641.25	93.62
	其中:股票	1,150,648,641.25	93.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	76,965,580.55	6.26
8	其他各项资产	1,508,204.13	0.12
9	合计	1,229,122,425.93	100.00

7.2报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	22,409,972.40	1.83
B	采矿业	101,820,321.35	8.34
C	制造业	468,362,197.91	38.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	50,878,001.80	4.17
E	建筑业	9,278,791.90	0.76
F	批发和零售业	17,903,279.31	1.47
G	交通运输、仓储和邮政业	32,607,538.90	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,528,911.57	3.97
J	金融业	43,740,003.04	3.58
K	房地产业	83,885,423.52	6.87
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,066,376.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,505,353.14	0.86
R	文化、体育和娱乐业	40,918,047.60	3.35
S	综合	3,653,717.00	0.30
	合计	943,557,935.44	77.25

7.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,631,835.00	0.38
B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	138,930,768.21	11.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,064,527.40	0.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	18,370,275.66	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	12,941,862.24	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,890,605.36	0.48
J	金融业	2,140,493.94	0.18
K	房地产业	1,304,271.00	0.11
L	租赁和商务服务业	4,837,465.05	0.40
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,592,064.10	0.79
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	207,090,705.81	16.95

7.2.3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

7.3.1 期末指数投资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

金额单位:人民币元

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	000686	东北证券	3,967,200	34,951,032.00	2.86
2	601168	西部矿业	5,413,814	34,540,133.32	2.83
3	601928	凤凰传媒	4,143,428	33,437,463.96	2.74
4	002092	中泰化学	4,199,424	33,427,415.04	2.74
5	600325	华发股份	3,684,633	28,776,983.73	2.36
6	600801	华新水泥	1,247,502	25,261,915.50	2.07
7	600565	迪马股份	6,129,971	22,864,791.83	1.87
8	002299	圣农发展	885,070	22,409,972.40	1.83
9	600166	福田汽车	9,204,300	21,814,191.00	1.79
10	600639	浦东金桥	1,263,503	20,430,843.51	1.67

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资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

金额单位:人民币元

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	000596	古井贡酒	114,882	13,614,665.82	1.11
2	600897	厦门空港	536,784	12,941,862.24	1.06
3	300146	汤臣倍健	619,016	12,008,910.40	0.98
4	600153	建发股份	1,044,900	9,278,712.00	0.76
5	000034	神州数码	704,700	9,090,630.00	0.74
6	300367	东方网力	893,000	8,813,910.00	0.72
7	002020	京新药业	704,939	8,120,897.28	0.66
8	600096	云天化	1,328,011	7,914,945.56	0.65
9	002099	海翔药业	1,100,300	7,812,130.00	0.64
10	600873	梅花生物	1,621,064	7,764,896.56	0.64

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002092	中泰化学	49,495,141.67	4.05
2	601168	西部矿业	45,417,025.79	3.72
3	600657	信达地产	45,229,799.65	3.70
4	000543	皖能电力	42,463,724.89	3.48
5	600755	厦门国贸	41,276,930.30	3.38
6	000049	德赛电池	41,250,884.00	3.38
7	600325	华发股份	39,147,053.50	3.20
8	601928	凤凰传媒	38,639,059.90	3.16
9	600875	东方电气	38,433,954.86	3.15
10	600348	阳泉煤业	36,850,592.67	3.02
11	600017	日照港	36,486,583.95	2.99
12	000686	东北证券	36,187,751.30	2.96
13	601717	郑煤机	32,930,838.07	2.70
14	600565	迪马股份	30,582,252.19	2.50
15	000960	锡业股份	30,210,534.19	2.47
16	600655	豫园股份	28,627,532.80	2.34
17	002299	圣农发展	28,512,691.13	2.33
18	600639	浦东金桥	28,330,772.99	2.32
19	600312	平高电气	28,020,621.33	2.29
20	002038	双鹭药业	27,622,449.99	2.26
21	002110	三钢闽光	26,989,510.34	2.21
22	000581	威孚高科	25,533,130.40	2.09
23	002444	巨星科技	25,524,450.40	2.09
24	000596	古井贡酒	25,236,764.97	2.07
25	603444	吉比特	24,706,615.31	2.02

注:买入金额为成交金额(成交单价乘以成交数量),未考虑相关交易费用。

7.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600875	东方电气	51,550,169.44	4.22
2	600657	信达地产	37,841,007.90	3.10
3	600017	日照港	37,077,499.68	3.04
4	600755	厦门国贸	32,757,324.35	2.68
5	000049	德赛电池	31,013,712.71	2.54
6	600348	阳泉煤业	28,772,770.32	2.36
7	600655	豫园股份	25,323,697.62	2.07
8	002038	双鹭药业	23,565,951.71	1.93
9	600081	东风科技	21,832,107.14	1.79
10	000581	威孚高科	20,070,507.15	1.64
11	000932	华菱钢铁	19,344,592.80	1.58
12	603658	安图生物	19,242,643.40	1.58
13	600623	华谊集团	19,056,354.88	1.56
14	000960	锡业股份	18,692,860.08	1.53
15	000543	皖能电力	18,220,826.25	1.49
16	300347	泰格医药	17,843,928.66	1.46
17	601872	招商轮船	16,872,638.73	1.38
18	600160	巨化股份	16,651,909.35	1.36
19	000987	越秀金控	15,811,828.90	1.29
20	600966	博汇纸业	15,630,840.33	1.28

注:卖出金额为成交金额(成交单价乘以成交数量),未考虑相关交易费用。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,451,240,479.39
卖出股票收入(成交)总额	1,217,024,330.94

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额(成交单价乘以成交数量),未考虑相关交易费用。

7.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2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。

7.11.3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。

7.12投资组合报告附注

7.12.1

1、新疆中泰化学股份有限公司(以下简称“中泰化学”,股票代码:002092)下属公司新疆中泰化学托克逊能化有限公司(以下简称“托克逊能化”)由江苏中圣园科技股份有限公司EPC总承包承建的尚未完工的在建项目一石灰回转窑发生安全事故,于2019年4月26日收到吐鲁番市应急管理局出具的行政处罚听证告知书,对托克逊能化处以罚款90万元。

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中泰化学进行了投资。

2、其余九名证券的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。

7.12.2

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。

7.12.3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	800,342.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,705.74
5	应收申购款	693,155.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,508,204.13

7.12.4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。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§8基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
21,937	59,349.50	3,873,385.91	0.30	1,298,076,630.20	99.70

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	71,589.05	0.01

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

基金合同生效日(2019年3月25日)基金份额总额	1,508,879,568.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	67,114,201.88
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	274,043,754.48
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,301,950,016.11

注: 总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

在本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动:

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:

2019年5月,陈四清先生因工作调动,辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
招商证券股份有限公司	2	820,065,100.15	22.36%	763,729.25	22.36%	-
中国银河证券股份有限公司	1	653,165,812.56	17.81%	608,294.71	17.81%	-
平安证券股份有限公司	1	578,587,510.05	15.78%	538,838.72	15.78%	-
东方证券股份有限公司	2	458,462,878.21	12.50%	426,964.14	12.50%	-
广发证券股份有限公司	2	445,185,488.63	12.14%	414,605.26	12.14%	-
浙商证券股份有限公司	1	310,241,282.73	8.46%	288,928.44	8.46%	-
中信建投证券股份有限公司	2	254,816,127.02	6.95%	237,309.78	6.95%	-
华泰证券股份有限公司	1	137,259,761.48	3.74%	127,829.94	3.74%	-
海通证券股份有限公司	3	9,570,005.04	0.26%	8,912.23	0.26%	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:1、本基金与景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金共用交易单元。

2、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。

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
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§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

无。

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