# 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

## 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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 景顺长城MSCI中国A股国际通ETF |
| 场内简称 | 景顺MSCI |
| 基金主代码 | 512280 |
| 交易代码 | 512280 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年4月27日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 548,005,740.00份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2018年5月25日 |

2.2基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。 |
| 投资策略 | 本基金以MSCI中国A股国际通指数为标的指数,采用完全复制法,即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况(包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。<br>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 |
| 业绩比较基准 | MSCI中国A股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 贺倩 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfmc.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95599 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-68121816 |

2.4信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfmc.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

### §3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日-2019年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 105,037,245.12 |
| 本期利润 | 280,046,752.50 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3111 |
| 本期基金份额净值增长率 | 26.62% |
| 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 | 0.0289 |
| 期末基金资产净值 | 563,843,747.61 |
| 期末基金份额净值 | 1.0289 |

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。

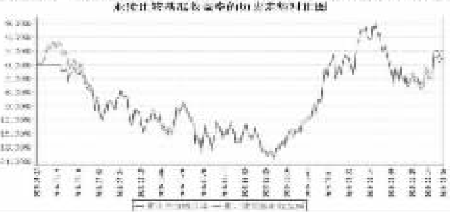
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

| 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 | 5.80% | 1.11% | 5.11% | 1.13% | 0.69% | -0.02% |
| 过去三个月 | 0.10% | 1.45% | -1.25% | 1.48% | 1.35% | -0.03% |
| 过去六个月 | 26.62% | 1.48% | 25.50% | 1.51% | 1.12% | -0.03% |
| 过去一年 | 11.70% | 1.47% | 9.19% | 1.51% | 2.51% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.89% | 1.41% | 1.30% | 1.45% | 1.59% | -0.04% |

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:基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2018年4月27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。

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 | | |
| 徐喻军 | 本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理 | 2018年4月27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MSCI中国A股国际通交易型开放式指数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以及"减税降费"等有利因素影响,市场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%。

本基金采用完全复制MSCI中国A股国际通指数的方法进行组合管理,通过控制跟踪误差和跟踪偏离度,力争基金收益和指数收益基本一致。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

2019年上半年,本基金份额净值增长率为26.62%,业绩比较基准收益率为25.50%。报告期内,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,跟踪误差(年化)控制在2%以内。

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。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

### §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MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 16,897,196.53 | 21,916,248.40 |
| 结算备付金 | 2,184,320.91 | 630,477.38 |
| 存出保证金 | 363,206.49 | 162,531.40 |
| 交易性金融资产 | 550,487,007.85 | 1,091,714,162.51 |
| 其中:股票投资 | 550,487,007.85 | 1,091,513,162.51 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | 201,000.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 3,683,237.34 | 4,348,057.65 |
| 应收利息 | 4,185.73 | 5,047.60 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 573,619,154.85 | 1,118,776,524.94 |
| 负债和所有者权益 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>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 | - | - |
| 应付证券清算款 | 7,148,260.22 | 3,990,304.24 |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 236,799.82 | 464,366.16 |
| 应付托管费 | 47,359.97 | 92,873.24 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 781,068.08 | 319,409.57 |
| 应交税费 | - | 0.46 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,561,919.15 | 2,235,919.48 |
| 负债合计 | 9,775,407.24 | 7,102,873.15 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 548,005,740.00 | 1,368,005,740.00 |
| 未分配利润 | 15,838,007.61 | -256,332,088.21 |
| 所有者权益合计 | 563,843,747.61 | 1,111,673,651.79 |
| 负债和所有者权益总计 | 573,619,154.85 | 1,118,776,524.94 |

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0289元,基金份额总额548,005,740.00份。

6.2利润表

会计主体: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

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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 285,164,335.87 | -109,601,955.06 |
| 1.利息收入 | 96,743.11 | 2,332,945.61 |
| 其中:存款利息收入 | 96,635.28 | 2,332,945.61 |
| 债券利息收入 | 107.83 | - |
| 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) | 107,874,225.32 | 357,975.28 |
| 其中:股票投资收益 | 102,966,273.04 | -11,538,062.39 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 126,660.37 | - |
| 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 | 4,781,291.91 | 11,896,037.67 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 175,009,507.38 | -113,278,519.40 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 2,183,860.06 | 985,643.45 |
| 减:二、费用 | 5,117,583.37 | 4,107,448.27 |
| 1. 管理人报酬 | 2,128,596.90 | 1,298,953.04 |
| 2. 托管费 | 425,719.39 | 259,790.64 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 2,196,086.12 | 2,327,076.47 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 税金及附加 | 0.08 | - |
| 7. 其他费用 | 367,180.88 | 221,628.12 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 280,046,752.50 | -113,709,403.33 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 280,046,752.50 | -113,709,403.33 |

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: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

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<br>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) | 1,368,005,740.00 | -256,332,088.21 | 1,111,673,651.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 280,046,752.50 | 280,046,752.50 |
| 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) | -820,000,000.00 | -7,876,656.68 | -827,876,656.68 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,750,000,000.00 | -40,527,587.26 | 1,709,472,412.74 |
| 2.基金赎回款 | -2,570,000,000.00 | 32,650,930.58 | -2,537,349,069.42 |
| 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) | 548,005,740.00 | 15,838,007.61 | 563,843,747.61 |
| 项目 | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)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) | 1,534,005,740.00 | - | 1,534,005,740.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -113,709,403.33 | -113,709,403.33 |
| 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) | -106,000,000.00 | 993,703.57 | -105,006,296.43 |
| 其中:1.基金申购款 | 592,000,000.00 | -10,568,007.34 | 581,431,992.66 |
| 2.基金赎回款 | -698,000,000.00 | 11,561,710.91 | -686,438,289.09 |
| 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) | 1,428,005,740.00 | -112,715,699.76 | 1,315,290,040.24 |

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MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金(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[2018]548号《关于准予景顺长城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MSCI 中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,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1,533,998,240.00元(含募集股票市值),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(2018)第283号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2018年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,534,005,740.00份基金份额,其中认购资金利息折合7,500.00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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证函[2018]第67号文审核同意,本基金1,534,005,740.00份基金份额于2018年5月25日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数MSCI中国A股国际通指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%。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份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、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、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。本基金的业绩比较基准为MSCI中国A股国际通指数(MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY))。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标ETF,募集成立了景顺长城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(以下简称"景顺长城MSCI中国A股国际通ETF联接基金")。景顺长城MSCI中国A股国际通ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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2019年8月21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》、《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基金合同》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2019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日期间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。

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2)对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,股票的股息、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)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。对基金从上市公司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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)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

本报告期,与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司("中国农业银行") | 基金托管人 |
| 长城证券股份有限公司("长城证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 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ETF联接基金") | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

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。

6.4.8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

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) |
| 长城证券 | - | - | 476,961,807.01 | 24.00 |

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 长城证券 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例(%) |
| 长城证券 | 444,195.89 | 24.00 | 444,195.89 | 24.00 |

注:1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,128,596.90 | 1,298,953.04 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注:支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 425,719.39 | 259,790.64 |

注:支付基金托管人中国农业银行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×0.10%/当年天数。

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

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。

6.4.8.4.2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<br>2019年6月30日 | | 上年度末<br>2018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(%) |
| 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 | 160,000,000.00 | 29.20 | 434,000,000.00 | 31.73 |

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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 16,897,196.53 | 85,964.01 | 39,391,140.99 | 758,997.37 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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

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。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截止本报告期末,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

截止本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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第一层次的余额为550,430,031.31元,属于第二层次的余额为56,976.54元,无属于第三层次的余额(2018年12月31日,第一层次的余额为1,080,758,730.71元,属于第二层次的余额为10,955,431.80元,无属于第三层次的余额。)

(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)基金申购款

于2019年上半年度,本基金申购基金份额的对价总额为1,709,472,412.74元,其中包括以股票支付的申购款1,169,015,989.73元和以现金支付的申购款540,456,423.01元(于2018上半年度,本基金申购基金份额的对价总额为581,431,992.66元,其中包括以股票支付的申购款403,222,525.09元和以现金支付的申购款178,209,467.57元)。

(3)其他

除公允价值和基金申购款外,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 | 550,487,007.85 | 95.97 |
| | 其中:股票 | 550,487,007.85 | 95.97 |
| 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 | 19,081,517.44 | 3.33 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,050,629.56 | 0.71 |
| 9 | 合计 | 573,619,154.85 | 100.00 |

注:本表权益投资股票项中,含可退替代款估值增值-1,397.42元,而7.2中不含可退替代款估值增值,因此二者存在差异。

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 | 7,238,955.00 | 1.28 |
| B | 采矿业 | 20,876,588.17 | 3.70 |
| C | 制造业 | 215,267,790.51 | 38.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,693,502.80 | 2.78 |
| E | 建筑业 | 16,298,249.90 | 2.89 |
| F | 批发和零售业 | 10,302,210.20 | 1.83 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 15,128,566.60 | 2.68 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 22,912,806.84 | 4.06 |
| J | 金融业 | 182,417,794.51 | 32.35 |
| K | 房地产业 | 27,698,431.51 | 4.91 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,702,747.40 | 1.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 455,094.00 | 0.08 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 4,500,491.00 | 0.80 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,358,258.00 | 0.60 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 549,851,486.44 | 97.52 |

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 | - | - |
| B | 采矿业 | 363,431.25 | 0.06 |
| C | 制造业 | 176,907.28 | 0.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 39,603.76 | 0.01 |
| J | 金融业 | 33,869.94 | 0.01 |
| K | 房地产业 | - | - |
| 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 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,106.60 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 636,918.83 | 0.11 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 34,120 | 33,574,080.00 | 5.95 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 289,711 | 25,671,291.71 | 4.55 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 549,478 | 19,770,218.44 | 3.51 |
| 4 | 000858 | 五 粮 液 | 103,600 | 12,219,620.00 | 2.17 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 555,200 | 10,154,608.00 | 1.80 |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 779,600 | 9,105,728.00 | 1.61 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 1,433,200 | 8,441,548.00 | 1.50 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 118,065 | 7,792,290.00 | 1.38 |
| 9 | 000002 | 万 科A | 258,585 | 7,191,248.85 | 1.28 |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 1,977,500 | 7,119,000.00 | 1.26 |

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 | 600968 | 海油发展 | 102,375 | 363,431.25 | 0.06 |
| 2 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 80,927.56 | 0.01 |
| 3 | 601698 | 中国卫通 | 10,103 | 39,603.76 | 0.01 |
| 4 | 603863 | 松炀资源 | 1,612 | 37,204.96 | 0.01 |
| 5 | 601236 | 红塔证券 | 9,789 | 33,869.94 | 0.01 |
| 6 | 300594 | 朗进科技 | 721 | 31,803.31 | 0.01 |
| 7 | 603867 | 新化股份 | 1,045 | 26,971.45 | 0.00 |
| 8 | 300788 | 中信出版 | 1,556 | 23,106.60 | 0.00 |

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初基金资产净值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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000858 | 五 粮 液 | 32,836,823.77 | 2.95 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 26,601,823.27 | 2.39 |
| 3 | 000002 | 万 科A | 24,831,996.60 | 2.23 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 22,331,870.00 | 2.01 |
| 5 | 002304 | 洋河股份 | 21,377,989.71 | 1.92 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 19,621,500.93 | 1.77 |
| 7 | 000333 | 美的集团 | 14,632,135.75 | 1.32 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 13,051,880.81 | 1.17 |
| 9 | 001979 | 招商蛇口 | 12,744,655.10 | 1.15 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 11,249,706.48 | 1.01 |
| 11 | 000725 | 京东方A | 10,781,127.00 | 0.97 |
| 12 | 002024 | 苏宁易购 | 10,326,449.70 | 0.93 |
| 13 | 000063 | 中兴通讯 | 10,124,591.00 | 0.91 |
| 14 | 002142 | 宁波银行 | 9,547,100.52 | 0.86 |
| 15 | 002594 | 比亚迪 | 9,292,491.90 | 0.84 |
| 16 | 002714 | 牧原股份 | 9,202,554.84 | 0.83 |
| 17 | 300498 | 温氏股份 | 8,929,707.21 | 0.80 |
| 18 | 000166 | 申万宏源 | 8,748,408.14 | 0.79 |
| 19 | 000776 | 广发证券 | 7,857,472.45 | 0.71 |
| 20 | 002475 | 立讯精密 | 7,685,619.18 | 0.69 |

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初基金资产净值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 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000858 | 五 粮 液 | 46,843,680.07 | 4.21 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 40,712,026.99 | 3.66 |
| 3 | 000002 | 万 科A | 37,283,458.79 | 3.35 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 32,398,740.46 | 2.91 |
| 5 | 002304 | 洋河股份 | 29,233,184.95 | 2.63 |
| 6 | 000001 | 平安银行 | 29,209,497.37 | 2.63 |
| 7 | 000651 | 格力电器 | 19,471,968.05 | 1.75 |
| 8 | 001979 | 招商蛇口 | 19,282,384.28 | 1.73 |
| 9 | 000725 | 京东方A | 16,601,858.00 | 1.49 |
| 10 | 002024 | 苏宁易购 | 15,357,050.00 | 1.38 |
| 11 | 000568 | 泸州老窖 | 15,027,066.64 | 1.35 |
| 12 | 000063 | 中兴通讯 | 14,610,885.38 | 1.31 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 14,121,978.97 | 1.27 |
| 14 | 002142 | 宁波银行 | 14,004,757.44 | 1.26 |
| 15 | 002594 | 比亚迪 | 13,681,644.84 | 1.23 |
| 16 | 000166 | 申万宏源 | 13,328,942.67 | 1.20 |
| 17 | 600519 | 贵州茅台 | 13,003,319.39 | 1.17 |
| 18 | 000776 | 广发证券 | 11,977,672.06 | 1.08 |
| 19 | 002475 | 立讯精密 | 11,814,609.07 | 1.06 |
| 20 | 002027 | 分众传媒 | 10,600,125.00 | 0.95 |

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 | 625,807,755.42 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 772,324,816.23 |

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,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,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、上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"浦发银行",股票代码:600000)于2018年7月26日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书(银反洗罚决字[2018]3号)。其因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等事项,违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条、第三十二条的规定,被人民银行处以170万元罚款。

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浦发银行进行了投资。

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 | 363,206.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,683,237.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,185.73 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,050,629.56 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601236 | 红塔证券 | 33,869.94 | 0.01 | 新股流通受限 |

### §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

8.1.1 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(%) |
| 5,041 | 108,709.73 | 148,002,507.00 | 27.01 | 240,003,233.00 | 43.80 |

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目 | 持有份额(份) | 占总份额比例(%) |
|---|---|---|
| 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 | 160,000,000.00 | 29.20 |

8.2期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国农业银行股份有限公司—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 | 160,000,000.00 | 29.20 |
| 2 | 中信证券股份有限公司 | 20,597,129.00 | 3.76 |
| 3 | 中信建投证券股份有限公司 | 18,954,699.00 | 3.46 |
| 4 | 同方全球人寿保险有限公司 | 12,848,700.00 | 2.34 |
| 5 | 招商证券股份有限公司 | 11,448,073.00 | 2.09 |
| 6 | 广发证券股份有限公司 | 11,024,599.00 | 2.01 |
| 7 | 华泰人寿保险股份有限公司—分红—个险分红 | 10,237,200.00 | 1.87 |
| 8 | 全球人寿保险股份有限公司—自有资金 | 9,348,600.00 | 1.71 |
| 9 | 全球人寿保险股份有限公司—自有资金 | 8,879,400.00 | 1.62 |
| 10 | 中国国际金融股份有限公司 | 7,949,690.00 | 1.45 |
| 11 | 江苏昆山农村商业银行股份有限公司-同心一定开系列理财产品 | 6,651,000.00 | 1.21 |

8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4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(2018年4月27日)基金份额总额 | 1,534,005,740.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,368,005,740.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,750,000,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,570,000,000.00 |
| 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 | 548,005,740.00 |

### §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1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。
2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

本期本基金未变更会计师事务所。

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 | |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | 1,149,732,822.87 | 82.37% | 1,070,754.55 | 82.37% | - |
| 中泰证券股份有限公司 | 2 | 87,630,454.02 | 6.28% | 81,609.65 | 6.28% | - |
| 方正证券股份有限公司 | 2 | 71,332,535.79 | 5.11% | 66,431.74 | 5.11% | - |
| 东兴证券股份有限公司 | 1 | 50,485,500.97 | 3.62% | 47,018.04 | 3.62% | - |
| 川财证券有限责任公司 | 1 | 22,255,398.46 | 1.59% | 20,726.49 | 1.59% | - |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | 7,380,858.84 | 0.53% | 6,873.97 | 0.53% | - |
| 平安证券股份有限公司 | 2 | 4,074,958.65 | 0.29% | 3,795.01 | 0.29% | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 1 | 2,098,985.00 | 0.15% | 1,954.79 | 0.15% | - |
| 华泰证券股份有限公司 | 1 | 562,666.00 | 0.04% | 524.43 | 0.04% | - |
| 东北证券股份有限公司 | 1 | 235,218.00 | 0.02% | 219.06 | 0.02% | - |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 大同证券有限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期新增一个 |
| 广发证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 本期新增 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | 本期新增一个 |
| 中信证券股份有限公司 | 4 | - | - | - | - | 本期新增一个 |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注: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 |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 川财证券有限责任公司 | 1,019,264.40 | 81.43% | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 232,516.80 | 18.57% | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 上海华信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 大同证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |

### §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

| 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 | - | - | - | - | - | - | - |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 本基金的联接基金 | 1 | 20190101-20190630 | 434,000,000.00 | 8,000,000.00 | 282,000,000.00 | 160,000,000.00 | 29.20 |

产品持有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的20%的情况,可能会出现如下风险:

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:

(1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;

(2)如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(3)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(4)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(5)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(6)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

景顺长城基金管理有限公司
2019年8月23日