景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	景顺长城沪港深领先科技股票
场内简称	无
基金主代码	004476
交易代码	004476
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月7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
报告期末基金份额总额	162,877,254.30份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下,重点投资于具备核心科技或技术优势的优质上市公司,把握相关领域科技发展与公司技术研发能力所带来的投资机会,力争获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略,自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的符合领先科技主题的股票构建投资组合。 1、资产配置策略:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,重点关注包括GDP增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势,同时强调金融市场投资者行为分析,关注资本市场资金供求关系变化等因素,在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度, 运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2、股票投资策略:本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略,自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的符合领先科技主题的股票构建投资组合。 3、债券投资策略 :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。 4、中小企业私募债投资策略: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。 5、股指期货投资策略:本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
业绩比较基准	中证TMT产业主题指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	田青
	联系电话	0755-82370388	010-67595096
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008888606	010-67595096
传真		0755-22381339	010-66275853

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	36,606,018.42
本期利润	78,067,507.88
加权平均基金份额本期利润	0.2495
本期基金份额净值增长率	23.64%
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	0.0928
期末基金资产净值	177,995,034.15
期末基金份额净值	1.093

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三位,小数点后第四位四舍五入,由此产生的误差计入基金资产。

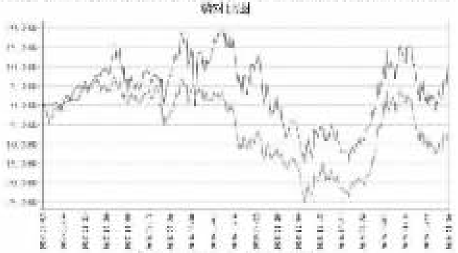
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	6.43%	1.40%	2.45%	1.12%	3.98%	0.28%
过去三个月	-1.00%	1.84%	-8.59%	1.44%	7.59%	0.40%
过去六个月	23.64%	1.71%	18.06%	1.46%	5.58%	0.25%
过去一年	1.77%	1.67%	0.26%	1.40%	1.51%	0.27%
自基金合同生效起至今	9.30%	1.51%	-8.24%	1.25%	17.54%	0.26%

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:本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例范围为80%-95%,其中投资于国内依法上市的股票比例不超过基金资产的95%,投资于港股通标的股票比例不超过基金资产的95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%—20%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0—3%。本基金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后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资于领先科技主题的股票资产不低于非现金基金资产的80%。本基金的建仓期为自2017年7月7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		
詹成	本基金的基金经理	2017年7月7日	-	8	通信电子工程博士。曾担任英国诺基亚研发中心研究员。2011年7月加入本公司,历任研究部研究员、专户投资部投资经理,自2015年12月起担任股票投资部基金经理。
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	2017年7月7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。

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、《景顺长城沪港深领先科技股票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,但结合交易时机和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

虽然2019年上半年GDP实际增速创下新低,但我们认为这是在宏观经济转型升级过程中, 一个正常的结果,从2015年底以来,中国启动供给侧结构性改革,通过去产能和去杠杆,成功地降低了投资增速,抑制了债务扩张,投资增速降低了,GDP增速也自然下降了。但在这个过程中,我们发现行业集中度在快速提升,传统经济各个行业的龙头公司ROE不但没有下降,反而出现了提升,从上半年股票市场来看,也充分反映了这个特点,各行各业龙头公司获得了明显的估值溢价。从实业的角度来看,很多行业产业格局已定,没有颠覆性技术出现的话,龙头公司会持续跑赢行业。

新兴产业周期出现了一定上升的苗头,但5月份后中美贸易摩擦再次升级,打断了产业趋势上升的势头,科技相关的公司股价在今年2季度出现了明显回撤。

消费增速是今年上半年最大的亮点,上半年社会消费品零售总额增速达到8.4%,远超同期5.8%的投资增速和0.1%的出口增速,在经济下行的过程中,消费增长体现出了极强的韧性,上半年股市涨幅排前的行业和个股大部分都是消费行业,消费行业的领涨也从侧面印证今年的消费数据表现出色。

报告期内,本基金重点配置了精选顺应中国未来产业发展趋势的行业,以不变的产业趋势应对万变的市场,个股选择上,我们买入并持有具有长期竞争优势、增长持续稳健、管理层优秀且估值合理的公司,整体业绩表现优于基准。

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23.64%,业绩比较基准收益率为18.06%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们觉得宏观经济还是有下行的压力,在抑制房地产投资的情况下,信用扩张速度很难反弹,同时中美贸易摩擦也会扰动国内和海外投资人的情绪,股票市场呈现区间震荡的概率较大。但从中期的维度来看,我们并不悲观,目前大部分的A股和港股公司的估值依然不贵,大幅下跌的空间非常有限,甚至在全球范围内比较都具有不错的性价比,一旦负面消息对投资人心理的冲击边际上减弱,具有长期成长性的行业和公司将会出现明显的估值修复。

我们应该看到中国的经济结构正在发生积极的变化,中国经济将告别以投资,工业化为主,粗放型增长的模式,逐步转向以科技创新和消费升级为主导的新发展阶段。很多中国企业在锐意进取的管理层带领下,依托庞大的内需市场,新时代中国发展积累沉淀下来的产业链和技术优势,以及不断释放的工程师红利,逐步承接全球范围内的产能转移,在互联网,家电,汽车零部件,消费电子,光伏,高端装备,化工等领域,中国企业已经具备了一定的全球竞争力,全球化的进程已经开启。同时5G牌照的发放,中国开始大规模的建设5G网络,也代表了新一轮技术创新周期的开启,越来越多的迹象表明5G产业链的景气度已经开始快速提升,相信在这一轮技术周期中,越来越多的中国科技公司将成长壮大。

其次,中国也正在加速向消费驱动型经济转型,随着中国人均收入水平不断提升,基本的衣食住行得到满足后,居民在休闲,娱乐,教育,医疗等领域的消费支出不断增加。随着80,90后逐步变成主力消费人群,居民更加注重品质消费,为品牌支付溢价的意愿不断提高,有助于龙头消费品公司快速提升市场集中度。同时,中国消费市场有其他国家和地区不可比拟的广度和深度,不仅一二三四五线城市的消费拥有不同层次的梯度效应,而且13亿人口的庞大内需市场能带来巨大的规模效应,这注定了中国居民消费升级的产业趋势将会是长期,稳定且持续的。

操作策略上,我们依然会围绕科技创新和消费升级这两个核心产业趋势来做重点配置,以不变的产业趋势应对万变的市场,我们相信在这两个领域中越来越多的中国企业能成长为巨擘,我们力争在中长期的维度为持有人创造持续稳定的净值增长。

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,以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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金

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	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	32,898,519.70	71,852,055.76
结算备付金	634,360.01	754,648.59
存出保证金	170,082.43	150,590.11
交易性金融资产	155,950,370.71	340,283,673.45
其中:股票投资	155,485,067.91	340,283,673.45
基金投资	-	-
债券投资	465,302.80	-
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	10,980,146.68	-
应收利息	6,010.44	15,023.71
应收股利	147,492.22	1,093.50
应收申购款	172,233.04	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	200,959,215.23	413,057,085.12
负债和所有者权益	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	-	-
应付证券清算款	-	2,035,182.39
应付赎回款	22,126,399.65	-
应付管理人报酬	250,246.16	535,064.04
应付托管费	41,707.70	89,177.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	388,239.76	473,492.49
应交税费	3.02	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	157,584.79	364,500.00
负债合计	22,964,181.08	3,497,416.29
所有者权益:		
实收基金	162,877,254.30	463,078,716.32
未分配利润	15,117,779.85	-53,519,047.49
所有者权益合计	177,995,034.15	409,559,668.83
负债和所有者权益总计	200,959,215.23	413,057,085.12

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.093元,基金份额总额162,877,254.30份。

6.2利润表

会计主体:景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	82,698,334.90	-4,787,955.26
1.利息收入	187,641.16	183,167.35
其中:存款利息收入	187,368.79	183,167.35
债券利息收入	272.37	-
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)	40,650,520.81	8,673,624.42
其中:股票投资收益	39,814,562.11	6,917,067.53
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	835,958.70	1,756,556.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	41,461,489.46	-14,008,062.00
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	398,683.47	363,314.97
减:二、费用	4,630,827.02	4,647,902.00
1.管理人报酬	2,368,322.68	2,262,417.52
2.托管费	394,720.46	377,069.60
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,757,184.20	1,816,970.53
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	0.99	-
7.其他费用	110,598.69	191,444.35
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	78,067,507.88	-9,435,857.26
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	78,067,507.88	-9,435,857.26

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金

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)	463,078,716.32	-53,519,047.49	409,559,668.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	78,067,507.88	78,067,507.88
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)	-300,201,462.02	-9,430,680.54	-309,632,142.56
其中:1.基金申购款	21,095,015.43	964,942.72	22,059,958.15
2.基金赎回款	-321,296,477.45	-10,395,623.26	-331,692,100.71
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)	162,877,254.30	15,117,779.85	177,995,034.15
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)	234,641,816.43	12,938,523.24	247,580,339.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,435,857.26	-9,435,857.26
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)	183,995,103.30	27,662,417.02	211,657,520.32
其中:1.基金申购款	345,222,304.06	46,758,566.23	391,980,870.29
2.基金赎回款	-161,227,200.76	-19,096,149.21	-180,323,349.97
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)	418,636,919.73	31,165,083.00	449,802,002.73

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

景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金(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]618号《关于准予景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2017]599号《关于景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金延期募集备案的回函》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《景顺长城沪港深领先科技股票型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,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682,642,607.57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(2017)第364号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同》于2017年7月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为682,869,499.13份基金份额,其中认购资金利息折合226,891.56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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行上市和交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及经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。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为80%-95%,其中投资于国内依法上市的股票比例不超过基金资产的95%, 投资于港股通标的股票比例不超过基金资产的95%; 除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%,其中权证投资比例不超过基金资产净值的0-3%。本基金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后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金投资于领先科技主题的股票资产不低于非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:中证TMT产业主题指数收益率×60%+恒生综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×20%。

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》、《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司 (以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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、基金销售机构

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 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	
	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	4,172,812.14	0.40	32,886,296.88	2.96

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 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	3,886.22	0.41	3,886.22	1.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1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	29,475.12	3.04	22,455.76	3.52

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。

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 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	2,368,322.68	2,262,417.52
其中:支付销售机构的客户维护费	448,620.59	740,610.11

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1.50%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×1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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	394,720.46	377,069.60

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/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

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

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		上年度可比期间 2018年1月1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
中国建设银行	32,898,519.70	169,980.48	67,016,243.19	146,748.26

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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155,893,394.17元,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340,283,673.45元,无属于第二或第三层次的余额)。

(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)其他

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	155,485,067.91	77.37
	其中:股票	155,485,067.91	77.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	465,302.80	0.23
	其中:债券	465,302.80	0.23
	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	33,532,879.71	16.69
8	其他各项资产	11,475,964.81	5.71
9	合计	200,959,215.23	100.00

注:权益投资中通过港股通交易机制投资港股的金额44,134,301.53元,占基金净值比例24.80%。

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

金额单位:人民币元

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	131,392.60	0.07
C	制造业	85,791,589.32	48.20
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	4,410,252.00	2.48
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	11,111,185.65	6.24
J	金融业	33,869.94	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,003,852.00	1.13
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	7,868,624.87	4.42
S	综合	-	-
	合计	111,350,766.38	62.56

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	12,188,700.91	6.85
能源	8,514,141.17	4.78
金融	-	-
工业	8,406,998.59	4.72
信息科技	8,510,930.42	4.78
公用事业	-	-
通讯	6,513,530.44	3.66
医疗	-	-
合计	44,134,301.53	24.80

注:以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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

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	300014	亿纬锂能	301,400	9,180,644.00	5.16
2	00968	信义光能	2,514,000	8,514,141.17	4.78
3	00268	金蝶国际	1,145,000	8,510,930.42	4.78
4	00788	中国铁塔	4,662,000	8,406,998.59	4.72
5	002841	视源股份	102,933	7,978,336.83	4.48
6	002007	华兰生物	260,700	7,948,743.00	4.47
7	002475	立讯精密	274,900	6,814,771.00	3.83
8	02269	药明生物	109,000	6,726,188.24	3.78
9	002422	科伦药业	222,754	6,622,476.42	3.72
10	300413	芒果超媒	159,875	6,562,868.75	3.69

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	300014	亿纬锂能	21,918,555.99	5.35
2	002384	东山精密	14,233,762.50	3.48
3	300604	长川科技	12,633,968.80	3.08
4	300207	欣旺达	11,868,793.33	2.90
5	000063	中兴通讯	10,580,772.00	2.58
6	300567	精测电子	10,173,477.36	2.48
7	002475	立讯精密	9,343,293.30	2.28
8	002727	一心堂	9,317,602.00	2.28
9	002402	和而泰	9,089,443.00	2.22
10	00268	金蝶国际	8,997,096.76	2.20
11	002007	华兰生物	8,386,826.60	2.05
12	002422	科伦药业	8,334,797.30	2.04
13	00788	中国铁塔	8,197,884.65	2.00
14	002129	中环股份	8,041,241.01	1.96
15	002123	梦网集团	7,856,075.99	1.92
16	300113	顺网科技	7,853,689.00	1.92
17	300059	东方财富	7,633,791.00	1.86
18	300413	芒果超媒	7,591,047.97	1.85
19	002555	三七互娱	7,516,385.28	1.84
20	02238	广汽集团	7,321,566.76	1.79

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	601318	中国平安	23,610,752.00	5.76
2	002384	东山精密	23,197,982.98	5.66
3	300014	亿纬锂能	21,025,112.96	5.13
4	00700	腾讯控股	17,775,093.68	4.34
5	300207	欣旺达	16,172,237.48	3.95
6	300482	万孚生物	14,589,039.21	3.56
7	300203	聚光科技	13,980,097.32	3.41
8	300567	精测电子	13,796,950.82	3.37
9	300604	长川科技	13,786,958.87	3.37
10	002821	凯莱英	13,168,121.20	3.22
11	300413	芒果超媒	13,160,273.79	3.21
12	300481	濮阳惠成	12,168,169.50	2.97
13	00354	中国软件国际	11,313,821.40	2.76
14	03898	中车时代电气	11,265,364.24	2.75
15	002382	蓝帆医疗	11,065,323.64	2.70
16	002916	深南电路	10,644,303.60	2.60
17	002376	新北洋	10,204,541.64	2.49
18	002223	鱼跃医疗	10,200,610.96	2.49
19	002739	万达电影	9,563,868.37	2.34
20	002179	中航光电	9,483,185.64	2.32
21	300750	宁德时代	9,369,069.86	2.29
22	00836	华润电力	9,310,686.70	2.27
23	002341	新纶科技	9,076,047.00	2.22
24	06169	宇华教育	9,029,401.85	2.20
25	600900	长江电力	8,980,436.09	2.19
26	002709	天赐材料	8,934,896.99	2.18
27	002402	和而泰	8,501,385.15	2.08
28	603197	保隆科技	8,470,511.20	2.07
29	002123	梦网集团	8,266,087.00	2.02

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	384,413,575.60
卖出股票收入(成交)总额	650,433,529.91

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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	465,302.80	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	465,302.80	0.26

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	128067	一心转债	2,444	274,339.00	0.15
2	128059	视源转债	1,662	190,963.80	0.11

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

本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。
1、时点选择:基金管理人在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。
2、套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖张数。
3、合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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、芒果超媒股份有限公司(以下简称"芒果超媒",股票代码:300413)于2019年1月2日收到中国保险监督管理委员会湖南保监局的行政处罚决定,其因存在未按照规定设立专门账簿记载业务收支情况,欺骗保险人、投保人、被保险人或者受益人等违法违规行为,违反了《保险法》相关规定,被处以合计9万元罚款。

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芒果超媒进行了投资。

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	170,082.43
2	应收证券清算款	10,980,146.68
3	应收股利	147,492.22
4	应收利息	6,010.44
5	应收申购款	172,233.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,475,964.81

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

本基金本报告期末前十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(%)
4,331	37,607.31	61,718,681.85	37.89	101,158,572.45	62.11

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	23,759.89	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(2017年7月7日)基金份额总额	682,869,499.13
本报告期期初基金份额总额	463,078,716.32
本报告期基金总申购份额	21,095,015.43
减:本报告期基金总赎回份额	321,296,477.45
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	162,877,254.30

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:
托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	
中国国际金融股份有限公司	1	203,237,312.26	19.67%	186,358.54	19.82%	-
中信证券股份有限公司	3	175,611,679.71	17.00%	159,590.81	16.97%	本期新增1个
西部证券股份有限公司	2	125,655,463.78	12.16%	110,235.54	11.72%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	90,623,247.89	8.77%	82,344.31	8.76%	本期新增
西藏东方财富证券股份有限公司	2	90,556,258.78	8.77%	83,340.15	8.86%	-
光大证券股份有限公司	2	64,565,121.00	6.25%	58,902.27	6.26%	-
中信建投证券股份有限公司	2	60,744,913.44	5.88%	55,243.62	5.88%	本期新增1个
长江证券股份有限公司	1	52,766,482.05	5.11%	48,721.56	5.18%	-
国信证券股份有限公司	2	40,900,275.29	3.96%	35,811.00	3.81%	-
天风证券股份有限公司	1	40,124,525.20	3.88%	37,367.93	3.97%	-
广发证券股份有限公司	1	22,314,701.15	2.16%	20,782.12	2.21%	-
华创证券有限责任公司	1	21,731,143.26	2.10%	20,237.30	2.15%	-
招商证券股份有限公司	1	15,976,708.80	1.55%	14,878.94	1.58%	-
方正证券股份有限公司	1	10,871,614.40	1.05%	10,124.73	1.08%	-
渤海证券股份有限公司	2	6,243,244.20	0.60%	5,814.46	0.62%	-
中泰证券股份有限公司	3	4,741,433.00	0.46%	4,416.53	0.47%	-
长城证券股份有限公司	2	4,172,812.14	0.40%	3,886.22	0.41%	-
东北证券股份有限公司	1	2,300,900.72	0.22%	2,142.81	0.23%	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	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	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

§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	1	20190226-20190226	82,629,974.60	-	82,629,974.60	-	-
	2	20190101-20190304	144,663,900.27	-	144,663,900.27	-	-
	3	20190312-20190326	144,663,900.27	-	144,663,900.27	-	-
	4	20190524-20190528	144,663,900.27	-	144,663,900.27	-	-
	5	20190227-20190630	81,018,137.41	-	37,700,000.00	43,318,137.41	26.60
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

景顺长城基金管理有限公司
2019年8月23日