

---

# 景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证 券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城低碳科技主题混合
场内简称	无
基金主代码	002244
交易代码	002244
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 11 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	130,113,250.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于与低碳科技主题相关的上市公司证券，通过积极主动的投资管理，在合理控制投资风险的同时，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>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。</p> <p>2、低碳科技主题配置策略：</p> <p>（1）低碳科技主题的界定</p> <p>低碳科技是能够直接或间接降低温室气体排放的科学技术手段，通过这些科学技术手段生产出来的产品或服务能够帮助人类社会更好的实现降低温室气体排放的目标，拥有这些科学技术手段的上市公司都是本基金的主题投资范围。</p> <p>（2）行业配置策略</p> <p>1）主要配置于能够直接降低温室气体排放的行业领域。</p> <p>2）其他的能够间接降低温室气体排放的行业领域。</p> <p>3）具体不同行业的配置取决于低碳经济的宏观产业政策、行业及公司基本面的风险收益比。</p> <p>（3）个股精选策略</p> <p>本基金将自上而下地系统性分析在降低温室气体排放领域的相关行业景气度和细分子行业龙头上市公司的产品布局，并进一步判断上市公司的未来盈利前景；在此基础上，再自下而上地分析上市公司的管理层治理能力及上市公司未来成长潜力，综合判断上市公司未来净利增速；最后本基金将结合国际、国内可比上市公司的估值水平和上市公司自身的成长性来判断上市公司的投资价值。</p>

	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、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	50%×中证全指指数收益率+50%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	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
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.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.igwfm.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	9,052,342.23
本期利润	21,471,959.54
加权平均基金份额本期利润	0.1585
本期基金份额净值增长率	18.95%
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	-0.0458
期末基金资产净值	124,148,816.41
期末基金份额净值	0.954

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	3.02%	1.31%	1.78%	0.62%	1.24%	0.69%
过去三个月	-2.55%	1.64%	-2.24%	0.81%	-0.31%	0.83%
过去六个月	18.95%	1.52%	12.80%	0.80%	6.15%	0.72%
过去一年	-4.50%	1.54%	5.42%	0.77%	-9.92%	0.77%
过去三年	-19.02%	1.34%	1.97%	0.57%	-20.99%	0.77%
自基金合同生效起至今	-0.25%	1.42%	7.84%	0.59%	-8.09%	0.83%

#### 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

景顺长城低碳科技主题混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的建仓期为自 2016 年 3 月 11 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		
李孟海	本基金的基金经理	2016 年 3 月 11 日	-	11	工学硕士。曾任职于天相投资顾问公司投资分析部，担任小组主管。2010 年 8 月加入本公司，担任研究部研究员，自 2015 年 3 月起担任股票投资部基金经理。

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合规守信情况的说明

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、《景顺长城低碳科技主题灵活配置混合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 年上半年国内外经济金融环境复杂且多变。首先，国内经济经历短期企稳后再度显示出疲弱态势，工业增加值大幅回落，中采 PMI 综合指标掉入收缩区间。投资方面，制造业投资持续低迷，基建投资小幅反弹低于预期，房地产投资持续高增但开始有见顶迹象；进出口持续负增长，全球经济走弱及贸易摩擦的影响显著；消费低迷，扣除价格因素的实际消费增速已经下降至历史低位。其次，国内政策区间管理，频繁微调预调。货币政策经历四月份边际收紧后，由于经济走弱及包商事件，五月再度趋于宽松，以隔夜加权回购利率为代表的货币市场利率从四月份最高 2.9% 回落到六月份的 1% 附近；而逆周期调节政策频出，地方债加快发行，地方专项债可有条件作为资本金等财政政策推出。同时，贸易摩擦的反复及包商事件对市场影响深远。贸易摩擦从四月

底加剧到六月份的阶段缓和，不改变中美贸易摩擦等方面的长期性和复杂性，关税的提升以及全球产业链的变化，对国内及全球的增长将会产生较大影响；而包商事件打破了银行体系的刚兑，短期是流动性风险，更长期看是信用的分层和金融资源的再分配，谨防对实体领域的信用收缩。

海外方面，2 季度全球经济继续走弱，全球制造业 PMI 下滑至 49.8，接近 2012 年水平低位。美国及欧日的制造业 PMI 指数持续走低，增长和通胀的不确定性上升。全球部分国家已经开启降息步伐，全球新一轮货币宽松周期启动。欧洲率先转向宽松，6 月美联储议息会议透露出降息可能性，市场预期美联储年内降息两次。

市场方面，上半年上证综指上涨 19.4%，上证 50 上涨 27.8%，沪深 300 上涨 27.1%；中小板上 涨 20.7%、创业板上涨 20.9%。整体市场两极分化，市场情绪快速回落，风险偏好快速下降，涨幅 居前的行业分别为食品饮料、非银行金融、农林牧渔、家电、计算机，分别上涨 60.9%、44.7%、43.3%、39.8%、33.0%；涨幅落后的行业分别为建筑、传媒、汽车、钢铁、纺织服装，分 别上涨 6.6%、8.0%、9.8%、10.2%、11.5%。

上半年，本基金基于对市场整体情绪的判断，保持较高仓位，在低碳经济领域，优选价值被低 估的受益于低碳科技及相关政策的细分子行业及其龙头公司。重点配置在公共应急安全、网络可视 化安全监控、物流、图像处理、电梯等相关领域。行业配置上，重点配置在机械设备、计算机、电子、 基础化工、交通运输等行业领域。

#### 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 18.95%，业绩比较基准收益率为 12.80%。

#### 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，全球流动性有宽松趋势。海外随着美国经济回落，美联储释放降息信号，全球 新一轮宽松即将开启，预计年内美联储降息 1-2 次。中美利差大幅走阔，人民币短期压力释放超 于震荡。

国内方面，1 季度以来在宽信用和财政前置的影响下，经济和金融数据表现出很强韧性，基建 房地产数据都好于预期；由于数据韧性，货币政策在 4 月后出现一些边际收紧，重提结构性去杠 杆。但 5 月贸易谈判出现了恶化，市场相对乐观的经济预期发生扭转，房地产的销售和投资的可 持续性存疑，贸易摩擦对经济的拖累尚未显现；5 月包商银行被接管，对金融生态链造成深远影 响。中期，金融体系向实体输送资金的路径在风险偏好下降过程中受到制约，信用环境收紧。下半 年经济下行压力加大。预计整体经济增长进一步回落，地产已经开始出现走弱，制造业和基建投 资依然较弱，消费受基数影响回升，但整体难有起色。政策面，下半年货币政策可能通过降准配 合地方债发行；直接降息存在一定制约，较大可能采用“利率两轨并一轨”模式，通过 LPR 利率

下行引导实体融资利率下行。下半年财政政策仍有空间，允许地方专项债用作部分项目的资本金，将对基建投资带来正面影响，但整体宏观杠杆率较高水平下，预计政策主要是对经济起到托底作用，整体经济延续弱势下行。

随着中美贸易摩擦的日益持久化，全球科技产业供应链的转移或呈现不可逆的趋势，中国就业压力将逐渐显现，通过科技创新提高全要素生产效率或迫在眉睫。自 2015 年以来的房地产扩张周期已经持续快 4 年了，房地产、基建产业的景气为食品饮料、家电行业的业绩提供了坚实的基础，两个板块也是过去 4 年以来涨的最好的板块；周期轮回，地产产业或正步入下行周期。在投资者结构的剧烈变化之下，大市值股票的估值节节攀升，中小市值的优质制造科技类公司的性价比优势将逐步凸显。随着 2014 年 6 月以来新上市的一批次新企业的财务状况、行业发展趋势及公司治理状况更加明晰，未来 2-3 年有望重新迎来中小股票的较好投资时期。通过自上而下基于行业生命周期和公司的产品周期来精选具备未来业绩增长确定性的公司有望取得超额收益。

对于行业走势，我们最为看好 5G 时代视频图像处理设备、网络可视化安全监控、公共应急安全、电梯等中游制造领域的投资机会。同时，我们也积极布局物流、军工传感器、新能源汽车动力电池材料等相关领域。

#### 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，未发现有关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：景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	18,157,474.18	8,575,656.47
结算备付金	97,721.06	106,358.16
存出保证金	119,146.25	116,599.16
交易性金融资产	106,430,166.90	103,426,356.84
其中：股票投资	106,430,166.90	103,426,356.84
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	2,826.23	1,796.70
应收股利	-	-
应收申购款	16,519.14	69,418.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	124,823,853.76	112,296,185.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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	3,437.00	-
应付赎回款	198,339.98	39,110.63
应付管理人报酬	149,605.05	149,551.01
应付托管费	24,934.17	24,925.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	192,854.25	159,571.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,866.90	364,533.03
负债合计	675,037.35	737,691.69
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	130,113,250.16	139,097,820.80

未分配利润	-5,964,433.75	-27,539,326.58
所有者权益合计	124,148,816.41	111,558,494.22
负债和所有者权益总计	124,823,853.76	112,296,185.91

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.954 元，基金份额总额 130,113,250.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金

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	23,383,328.11	1,221,074.54
1. 利息收入	96,738.99	82,590.08
其中：存款利息收入	70,554.27	82,590.08
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	26,184.72	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	10,819,665.92	12,421,465.42
其中：股票投资收益	10,012,431.45	11,511,882.00
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	807,234.47	909,583.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,419,617.31	-11,396,463.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	47,305.89	113,482.62
减：二、费用	1,911,368.57	2,667,497.03
1. 管理人报酬	930,509.59	1,116,298.95
2. 托管费	155,084.93	186,049.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	710,682.72	1,173,891.95
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	115,091.33	191,256.28

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	21,471,959.54	-1,446,422.49
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	21,471,959.54	-1,446,422.49

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金

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）	139,097,820.80	-27,539,326.58	111,558,494.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,471,959.54	21,471,959.54
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）	-8,984,570.64	102,933.29	-8,881,637.35
其中：1. 基金申购款	13,579,147.94	-693,714.75	12,885,433.19
2. 基金赎回款	-22,563,718.58	796,648.04	-21,767,070.54
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）	130,113,250.16	-5,964,433.75	124,148,816.41
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）	165,303,730.51	3,622,605.63	168,926,336.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,446,422.49	-1,446,422.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-31,141,021.63	-2,284,360.50	-33,425,382.13

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	25,580,019.96	1,052,565.20	26,632,585.16
2. 基金赎回款	-56,721,041.59	-3,336,925.70	-60,057,967.29
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）	134,162,708.88	-108,177.36	134,054,531.52

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

景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金（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[2015]2669号文《关于准予景顺长城低碳科技主题灵活配置混合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《景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于2016年2月18日至2016年3月9日向社会公开募集，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（2016）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2016年3月11日生效。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594,409,758.62元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币67,319.88元，以上实收基金（本息）合计为人民币594,477,078.50元，折合594,477,078.50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，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金

资产的 0%-95%。本基金投资于低碳科技主题相关上市公司证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约缴纳的保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### 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 日止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

本基金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一致。

#### 6.4.5 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、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行	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

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

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	-	-	72,380,547.20	9.56

##### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期和上年度可比期间均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	-	-	-	-
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	67,408.05	9.56	67,408.05	14.99

注：1、上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

2、该类席位租用协议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

务。

### 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	930,509.59	1,116,298.95
其中：支付销售机构的客户维护费	397,795.58	487,794.88

注：基金管理人的管理费每日计算，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 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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	155,084.93	186,049.85

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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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均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及上年度末均未持有本基金份额。

### 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		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		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
中国农业银行	18,157,474.18	65,817.19	13,009,652.12	77,332.74

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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 106,373,190.36 元，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（于 2018 年 12 月 31 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 103,426,356.84 元，无划分为第二层次和第三层次的余额）。

### 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	106,430,166.90	85.26
	其中：股票	106,430,166.90	85.26
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	18,255,195.24	14.62
8	其他各项资产	138,491.62	0.11
9	合计	124,823,853.76	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	3,836,128.25	3.09
C	制造业	73,706,958.31	59.37
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	6,432,024.00	5.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,398,079.80	18.04
J	金融业	33,869.94	0.03
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	0.02
S	综合	-	-
	合计	106,430,166.90	85.73

### 7.2.2 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

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	300523	辰安科技	212,240	11,431,246.40	9.21
2	002912	中新赛克	70,600	6,627,222.00	5.34
3	002352	顺丰控股	189,400	6,432,024.00	5.18
4	300114	中航电测	688,300	6,408,073.00	5.16
5	600835	上海机电	373,684	6,203,154.40	5.00
6	603516	淳中科技	242,800	6,150,124.00	4.95
7	603601	再升科技	758,810	6,040,127.60	4.87
8	603659	璞泰来	126,400	5,943,328.00	4.79
9	603678	火炬电子	291,300	5,869,695.00	4.73
10	300124	汇川技术	220,000	5,040,200.00	4.06

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	603516	淳中科技	9,557,367.70	8.57
2	603505	金石资源	7,620,586.35	6.83
3	002709	天赐材料	6,877,995.00	6.17
4	603659	璞泰来	6,877,628.00	6.17
5	300073	当升科技	6,873,100.00	6.16
6	603197	保隆科技	6,664,606.00	5.97
7	601233	桐昆股份	6,652,774.60	5.96
8	600835	上海机电	6,538,344.96	5.86
9	601111	中国国航	6,509,923.00	5.84
10	603788	宁波高发	6,502,608.40	5.83
11	300065	海兰信	6,483,386.74	5.81
12	603885	吉祥航空	6,474,501.40	5.80
13	300114	中航电测	6,429,048.14	5.76
14	002352	顺丰控股	6,172,726.33	5.53
15	002912	中新赛克	6,035,897.00	5.41
16	601139	深圳燃气	6,025,958.50	5.40
17	603678	火炬电子	5,831,595.34	5.23
18	600115	东方航空	5,821,280.00	5.22
19	300523	辰安科技	5,218,779.00	4.68
20	603601	再升科技	5,199,560.88	4.66
21	000887	中鼎股份	4,516,581.50	4.05
22	300575	中旗股份	4,378,498.09	3.92

23	002933	新兴装备	4,307,983.00	3.86
24	300604	长川科技	4,157,259.00	3.73
25	000039	中集集团	4,011,860.65	3.60
26	603085	天成自控	3,963,141.00	3.55
27	300578	会畅通讯	3,936,111.84	3.53
28	000301	东方盛虹	3,928,423.24	3.52
29	002664	长鹰信质	3,915,446.00	3.51
30	601966	玲珑轮胎	3,907,989.00	3.50
31	002111	威海广泰	3,902,464.99	3.50
32	000733	振华科技	3,847,562.00	3.45
33	002540	亚太科技	3,834,970.00	3.44
34	002876	三利谱	3,833,566.00	3.44
35	300470	日机密封	3,718,129.80	3.33
36	300416	苏试试验	3,678,767.00	3.30
37	601808	中海油服	3,598,691.00	3.23
38	600583	海油工程	3,577,301.43	3.21
39	002001	新和成	3,569,986.20	3.20
40	002466	天齐锂业	3,538,722.80	3.17
41	000852	石化机械	3,532,218.36	3.17
42	600339	中油工程	3,496,513.00	3.13

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	300699	光威复材	8,366,568.88	7.50
2	300065	海兰信	7,817,350.83	7.01
3	300114	中航电测	7,778,845.82	6.97
4	601233	桐昆股份	7,531,816.00	6.75
5	600038	中直股份	7,148,546.00	6.41
6	600115	东方航空	6,775,672.99	6.07
7	603788	宁波高发	6,720,650.20	6.02
8	603885	吉祥航空	6,599,306.00	5.92
9	601111	中国国航	6,596,890.00	5.91
10	601139	深圳燃气	6,369,844.20	5.71
11	601965	中国汽研	6,269,463.16	5.62
12	600760	中航沈飞	6,245,148.00	5.60
13	002025	航天电器	5,974,050.00	5.36
14	002734	利民股份	5,961,926.60	5.34
15	002179	中航光电	5,934,161.44	5.32
16	300073	当升科技	5,878,295.00	5.27
17	002013	中航机电	5,823,092.00	5.22

18	300568	星源材质	5,774,035.00	5.18
19	000768	中航飞机	5,716,627.00	5.12
20	300416	苏试试验	5,310,894.93	4.76
21	002709	天赐材料	5,293,928.20	4.75
22	603085	天成自控	4,666,441.00	4.18
23	603197	保隆科技	4,492,674.60	4.03
24	603505	金石资源	4,342,346.00	3.89
25	002441	众业达	4,295,016.00	3.85
26	601808	中海油服	4,160,637.00	3.73
27	000301	东方盛虹	4,154,529.30	3.72
28	000852	石化机械	4,105,541.20	3.68
29	002111	威海广泰	4,043,130.00	3.62
30	002878	元隆雅图	4,006,307.00	3.59
31	300600	瑞特股份	3,980,692.16	3.57
32	600583	海油工程	3,933,877.60	3.53
33	601966	玲珑轮胎	3,916,004.68	3.51
34	600984	建设机械	3,866,616.46	3.47
35	600339	中油工程	3,744,984.26	3.36
36	300609	汇纳科技	3,737,618.00	3.35
37	603516	淳中科技	3,714,984.00	3.33
38	600879	航天电子	3,701,000.00	3.32
39	600893	航发动力	3,634,144.00	3.26
40	002664	长鹰信质	3,561,181.00	3.19
41	002749	国光股份	3,551,044.19	3.18
42	002215	诺普信	3,376,226.78	3.03
43	000887	中鼎股份	3,362,402.00	3.01
44	000039	中集集团	3,287,859.85	2.95
45	002540	亚太科技	3,176,102.98	2.85
46	002466	天齐锂业	2,991,544.22	2.68
47	002777	久远银海	2,869,564.88	2.57
48	002056	横店东磁	2,239,433.00	2.01

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	221,353,790.25
卖出股票收入(成交)总额	240,782,028.95

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	119,146.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,826.23
5	应收申购款	16,519.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,491.62

**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 (%)
8,364	15,556.34	6,285,222.65	4.83	123,828,027.51	95.17

**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	4,542.47	0.00

**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 (2016 年 3 月 11 日) 基金份额总额	594,477,078.50
本报告期期初基金份额总额	139,097,820.80

本报告期基金总申购份额	13,579,147.94
减：本报告期基金总赎回份额	22,563,718.58
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	130,113,250.16

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	
华泰证券股份有限公司	1	104,855,392.22	22.76%	97,650.16	22.76%	-
国盛证券有限责任公司	1	97,136,379.08	21.09%	90,463.17	21.09%	-
申万宏源证券有限公司	1	54,037,864.52	11.73%	50,326.12	11.73%	-
兴业证券股份有限公司	1	29,908,785.26	6.49%	27,854.31	6.49%	-
国金证券股份有限公司	1	29,461,313.81	6.40%	27,437.39	6.40%	-
平安证券股份有限公司	2	26,505,109.49	5.75%	24,683.03	5.75%	-
川财证券有限责任公司	1	23,548,033.39	5.11%	21,930.20	5.11%	-
瑞银证券有限责任公司	1	21,360,873.74	4.64%	19,892.87	4.64%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	20,115,324.74	4.37%	18,733.52	4.37%	-
光大证券股份有限公司	2	14,411,805.88	3.13%	13,421.30	3.13%	-
中泰证券股份有限公司	2	10,730,324.43	2.33%	9,992.78	2.33%	-
长江证券股份有限公司	2	10,394,149.87	2.26%	9,679.43	2.26%	-
中国国际金融股份有限公司	2	8,677,341.11	1.88%	8,081.36	1.88%	-
天风证券股份有限公司	1	4,376,496.72	0.95%	4,075.79	0.95%	-
民生证券股份有限公司	1	3,928,423.24	0.85%	3,658.49	0.85%	-
招商证券股份有限公司	2	562,674.96	0.12%	524.02	0.12%	-
西南证券股份有限公司	1	446,902.75	0.10%	416.22	0.10%	本期新增
大同证券有限责任公司	2	95,089.60	0.02%	88.56	0.02%	-
东方证券股份有限公司	2	66,739.68	0.01%	62.15	0.01%	本期新增 1 个
方正证券股份有限公司	2	53,475.10	0.01%	49.81	0.01%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	本期新增 1 个
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增 1 个
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
上海华信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	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
华泰证券股份有限公司	-	-	10,000,000.00	16.67%	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

瑞银证券有限责任公司	-	-	50,000,000.00	83.33%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## §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