

景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资  
基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）起至 2017 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	481,437,999.35 份
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

	<p>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。</p> <p>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。</p> <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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年7月7日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	14,235,683.50
2. 本期利润	32,118,286.73

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0502
4. 期末基金资产净值	506,230,706.09
5. 期末基金份额净值	1.051

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

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

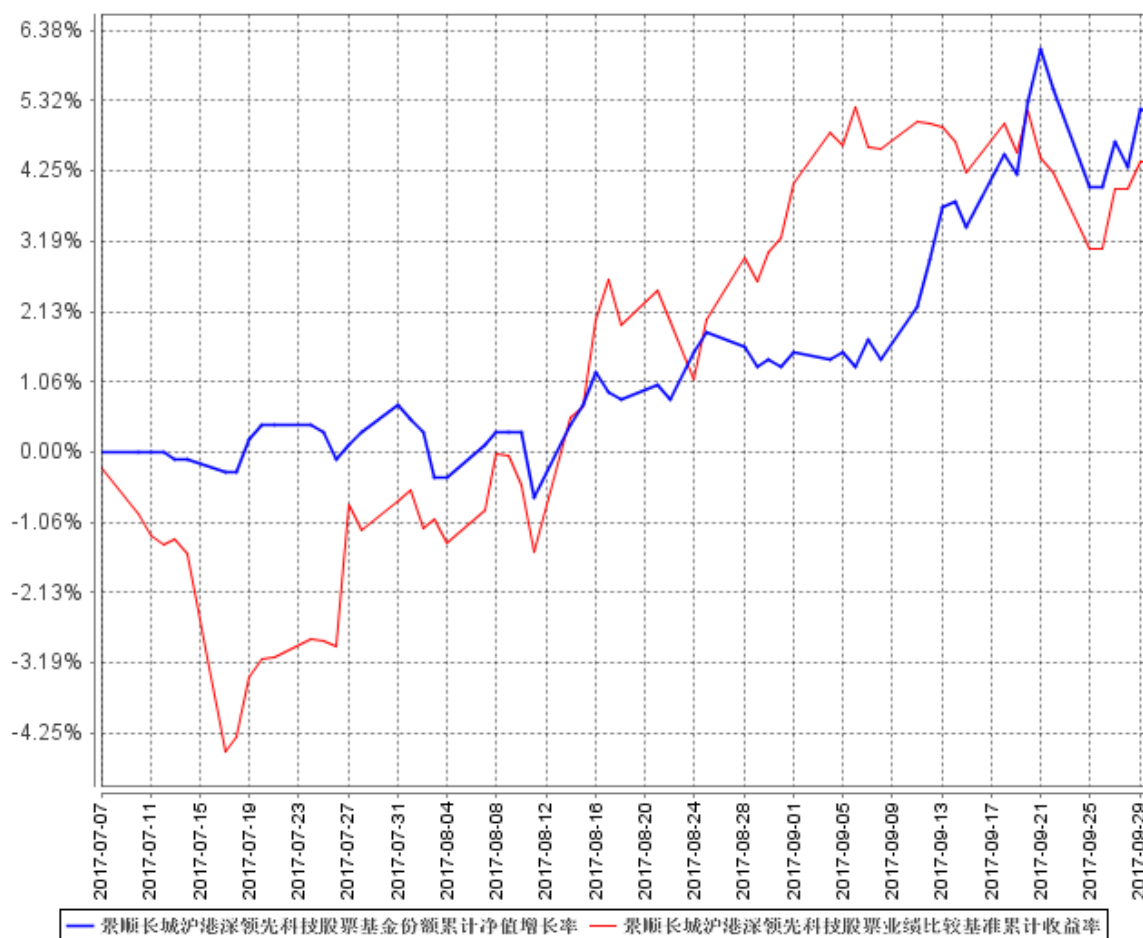
3、本基金基金合同生效日为 2017 年 7 月 7 日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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
过去三个月	5.10%	0.47%	4.38%	0.76%	0.72%	-0.29%

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



注：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%，其中权证资产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。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2017 年 7 月 7 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、量化及ETF投资部投资总监	2017年7月7日	-	14年	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月起担任基金经理。
詹成	本基金的基金经理	2017年7月7日	-	6年	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，担任研究员、投资经理等职务；自2015年12月起担任基金经理。

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”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指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 公平交易专项说明

#### 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 24 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，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。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为，但结合交易时机和交易价差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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

3 季度宏观经济展现出了较强的韧性，PPI 和 PMI 都出现了一定程度的回升，稳健的消费增长和较强的制造业投资对经济形成了较强的支撑，再加上海外主要经济体复苏，进一步刺激我们出口积极增长，经济稳健增长的态势依然没有改变，我们对往后一段时间的宏观也并不悲观。

央行实施定向降准，货币政策虽然将继续保持中性，但市场对货币政策从紧的恐慌情绪得到了一定的修复，股票市场的风险偏好也相应提升。

3 季度主要指数均出现了不同程度的上涨，沪深 300 指数上涨 4.6%，创业板指上涨 2.7%，受到经济回升预期影响，钢铁，有色和煤炭等周期性板块明显跑赢市场，本基金依然从产业发展趋势入手，精选顺应中国未来产业发展趋势的行业和个股进行配置，基金净值涨幅跑赢业绩基准。

展望 4 季度，宏观经济可能偏平略有下降，同时受制于美联储缩表，金融去杠杆等影响，A 股呈现区间震荡。操作策略上，我们依然会重点配置顺应中国未来产业发展趋势的行业和个股，以不变的产业趋势应对万变的市場，希望在中长期的维度持续为投资人获得净值增长。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 9 月 30 日，本基金份额净值增长率为 5.10%，业绩比较基准收益率为 4.38%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	405,467,703.66	78.29
	其中：股票	405,467,703.66	78.29
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	111,782,066.38	21.58
8	其他资产	655,195.60	0.13
9	合计	517,904,965.64	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资港股的金额 224,662,407.07 元，占基金净值比例 44.38%。



## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末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	7,718,828.00	1.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	141,787,127.61	28.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,030,148.00	2.77
F	批发和零售业	26,385.45	0.01
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	17,468.03	0.00
J	金融业	-	-
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	17,181,339.00	3.39
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	180,805,296.59	35.72

### 5.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
通讯	89,397,006.64	17.66
消费品，周期性	44,070,929.57	8.71
消费品，非周期性	23,488,714.75	4.64
工业	24,037,391.20	4.75
金融	43,668,364.91	8.63
合计	224,662,407.07	44.38

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	0285	比亚迪电子	1,555,500	30,530,025.60	6.03
2	300323	华灿光电	1,406,903	25,929,222.29	5.12
3	2238	广汽集团	1,632,000	25,070,543.77	4.95
4	0700	腾讯控股	77,100	22,024,053.85	4.35
5	2382	舜宇光学科技	185,000	19,522,637.82	3.86
6	1093	石药集团	1,650,000	18,337,362.12	3.62
7	601689	拓普集团	608,778	17,484,104.16	3.45
8	300015	爱尔眼科	678,300	17,181,339.00	3.39
9	300408	三环集团	696,100	17,117,099.00	3.38
10	603626	科森科技	379,058	16,333,609.22	3.23

**5.4 报告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。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资  
明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 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。

## 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1

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。

### 5.11.2

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。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	210,027.72
2	应收证券清算款	139,006.46
3	应收股利	270,967.85
4	应收利息	35,097.05
5	应收申购款	96.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	655,195.60

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告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。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§6 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	33,582,801.58
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	235,014,301.36
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）	-
报告期期末基金份额总额	481,437,999.35

注：本基金合同生效日为2017年7月7日。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

依据《深圳证监局关于参与港股通交易相关事项的通知》的要求，经与本基金基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，景顺长城基金管理有限公司决定对景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同、招募说明书相关条款进行修改，增加特别风险揭示。有关详细信息参见本基金管理人于 2017 年 7 月 18 日发布《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金增加特别风险揭示并相应修订基金合同和招募说明书相关内容的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金基金合同》；

- 3、《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

## 9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

## 9.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 10 月 25 日