

景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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 3 月 26 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 3 月 22 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

§2 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	463, 078, 716. 32 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	<p>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>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。</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</p>

	<p>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。

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@igwfm.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

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年	2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-64,937,854.29	35,934,970.19
本期利润	-94,328,352.96	41,335,576.36
加权平均基金份额本期利润	-0.2594	0.0879
本期基金份额净值增长率	-16.21%	5.50%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1156	0.0551
期末基金资产净值	409,559,668.83	247,580,339.67
期末基金份额净值	0.884	1.055

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。

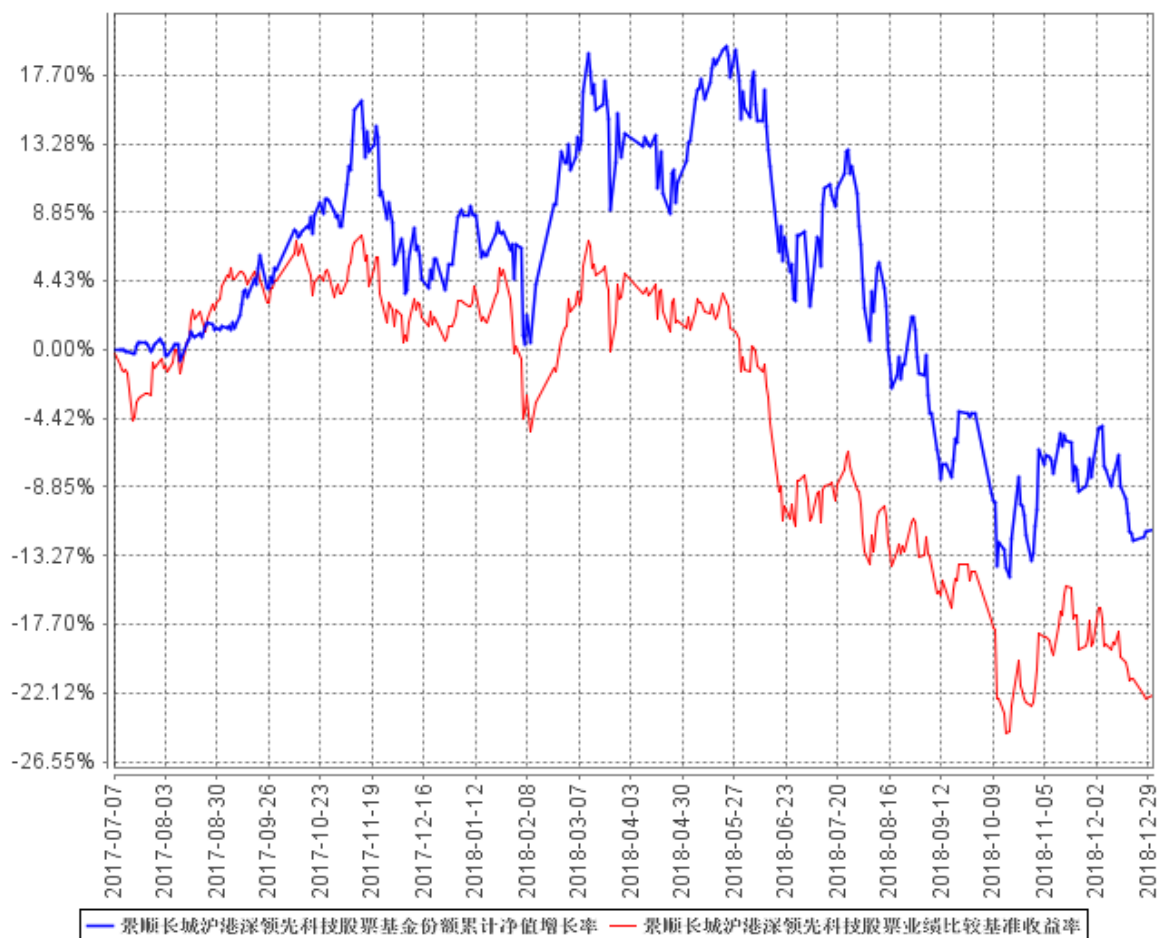
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

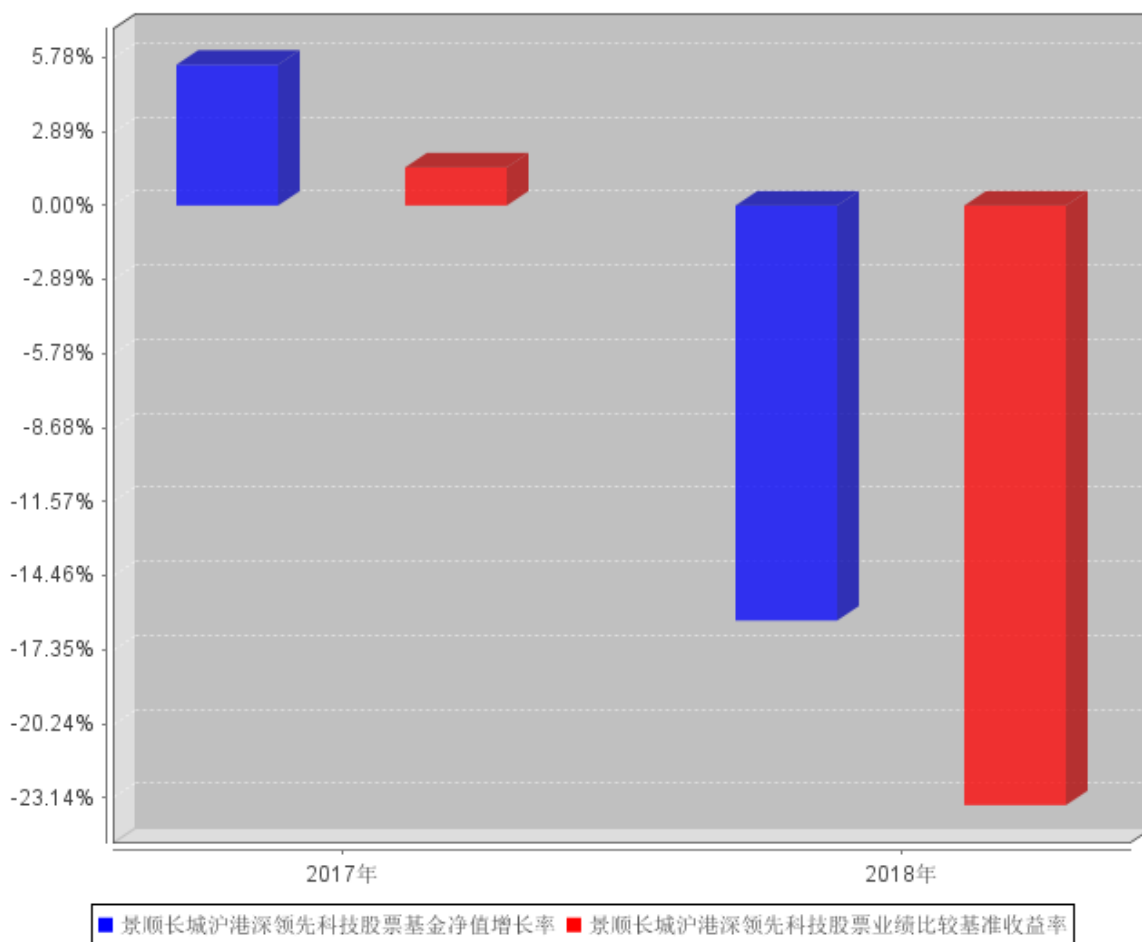
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-7.82%	1.73%	-9.27%	1.55%	1.45%	0.18%
过去六个月	-17.69%	1.62%	-15.08%	1.34%	-2.61%	0.28%
过去一年	-16.21%	1.64%	-23.42%	1.31%	7.21%	0.33%
自基金合同生效起至今	-11.60%	1.43%	-22.28%	1.16%	10.68%	0.27%

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。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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2017 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2017 年 7 月 7 日（基金合同生效日）至本期期末未进行利润分配。

§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2018年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理69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、景顺长城景瑞双利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。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	公司副总经理、量化及指数投资部投资总监、本基金的基金经理	2017 年 7 月 7 日	-	15 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	-	7 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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理及绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 132 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 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

2018 年对基金管理人而言是及其艰难的一年，中国金融条件收紧的过快，同时叠加中美经贸摩擦迅速升级打断了 2018 年年初投资人对中国经济周期性复苏可持续的乐观预期。投资人不断看到，社融增速大幅下滑，银行资产负债表扩张陷入停滞，基建投资增速急剧下降，地产交易量开始萎缩，消费增速明显放缓，增长预期的不断恶化也导致投资人信心出现崩塌，甚至在企业盈利还没有出现大幅下滑的情况下，投资人已经谈“股”色变，权益市场风险偏好急剧下降，Wind 全 A 估值跌至历史底部，从全球权益市场比较来看，2018 年中国经济肯定不是全球最差的国家，但 A 股却沦为股票估值最低的市场之一。

2018 年 A 股用“惨烈”来形容一点也不为过，全年下跌的幅度在近 10 年的时期里仅次于 2008 年，沪深 300，中小板和创业板指分别下跌 25.3%，37.7%和 28.6%，仅休闲服务和银行等防御性较强的板块下跌了 10.6%和 14.7%，其他板块跌幅均超过了 20%。报告期内，本基金依然坚持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，在科技创新和消费升级两大产业趋势下做了较多的布局，但全市场投资人信心的崩塌使得很多投资标的在盈利没有明显下修的情况下，估值却出现了超预期下跌，这一局面让我们措手不及，止损和降仓都做的并不是很坚决，导致基金净值出现明显回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年度，本基金份额净值增长率为-16.21%，业绩比较基准收益率为-23.42%。

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，我们比市场相对乐观一些，虽然中国经济增长还在降速，但我们应该可以看到财政政策，货币政策，甚至房地产政策都出现了一定程度的转向，逆周期调节的财政政策不断出台，货币政策有望持续保持宽松，市场利率有望显著下行，从严的房地产调控政策也在局部城市出现了放松。总的来说，中央已经意识到中国经济有失速的风险，在自身能力范围内，出台了一系列调节政策托底经济，虽然在宏观经济周期的影响下，2019 年中国经济会出现一定程度的降速，但我们认为不会出现市场预期的宏观经济断崖式下滑的情况。同时，税改对美国 GDP 增速

的提振作用也在逐步减弱，美国经济的增长动能也面临下降的压力，我们预计美联储加息节奏会放缓，也给中国央行货币政策进一步放松创造了外部条件。中美的贸易问题的确是一个长期矛盾，但中美双方在经济增长都有压力的情况下，应该会采用更温和的手段来解决双方的争端，我们预计双方都会做出一定程度的退让，中美贸易摩擦将出现一定程度的缓解。

虽然 2019 年中国经济依然会面临“内忧外患”的困局，但是我们也应该发现中国的经济结构正在发生积极的变化，虽然转型的速度受到了影响，但中国经济确实正在告别以投资，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，制造业长期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，在通信设备，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。

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，我们认为过度的悲观已经没有太大的必要，毕竟很多的悲观预期已经充分反应在股价中，股票市场目前处于 10 年难得一遇的底部区域，上行风险显著高于下行风险，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，面对未来我们是非常积极乐观的，希望我们能够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，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。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

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关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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

本报告期内，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	71,852,055.76	34,866,997.62
结算备付金	754,648.59	281,002.27
存出保证金	150,590.11	90,904.36
交易性金融资产	340,283,673.45	215,073,998.47
其中：股票投资	340,283,673.45	215,073,998.47
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	-	83,993.96
应收利息	15,023.71	8,934.62
应收股利	1,093.50	-
应收申购款	-	591,427.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	413,057,085.12	250,997,258.42
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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	-	2,531,734.73
应付管理人报酬	535,064.04	321,972.30
应付托管费	89,177.37	53,662.06
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	473,492.49	439,338.06
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	364,500.00	70,211.60
负债合计	3,497,416.29	3,416,918.75
所有者权益：		
实收基金	463,078,716.32	234,641,816.43
未分配利润	-53,519,047.49	12,938,523.24
所有者权益合计	409,559,668.83	247,580,339.67
负债和所有者权益总计	413,057,085.12	250,997,258.42

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.884 元，基金份额总额 463,078,716.32 份。

7.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 7 月 7 日(基金合同生效 日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-83,396,041.82	47,644,134.31
1. 利息收入	467,756.02	1,095,678.08
其中：存款利息收入	467,756.02	900,567.72
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	-	195,110.36
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-54,931,744.31	39,343,664.13
其中：股票投资收益	-57,438,328.40	38,871,256.40
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	2,506,584.09	472,407.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-29,390,498.67	5,400,606.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	458,445.14	1,804,185.93

减：二、费用	10,932,311.14	6,308,557.95
1. 管理人报酬	5,531,463.08	3,523,539.65
2. 托管费	921,910.57	587,256.57
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,092,772.36	1,998,789.73
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	386,165.13	198,972.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-94,328,352.96	41,335,576.36
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-94,328,352.96	41,335,576.36

7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	-	-94,328,352.96	-94,328,352.96
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）	228,436,899.89	27,870,782.23	256,307,682.12
其中：1. 基金申购款	439,061,869.32	43,939,970.49	483,001,839.81
2. 基金赎回款	-210,624,969.43	-16,069,188.26	-226,694,157.69
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）	463,078,716.32	-53,519,047.49	409,559,668.83

项目	上年度可比期间 2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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)	682,869,499.13	-	682,869,499.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	41,335,576.36	41,335,576.36
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)	-448,227,682.70	-28,397,053.12	-476,624,735.82
其中: 1. 基金申购款	85,883,831.32	6,312,779.96	92,196,611.28
2. 基金赎回款	-534,111,514.02	-34,709,833.08	-568,821,347.10
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)	234,641,816.43	12,938,523.24	247,580,339.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年 12月31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	65,139,429.36	2.63%	-	-

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	58,536.80	2.69%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年7月7日(基金合同生效日)至2017年12月31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	-	-	-	-

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年7月7日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,531,463.08	3,523,539.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,244,921.16	2,153,691.25

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	921,910.57	587,256.57

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 7 月 7 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	71,852,055.76	400,582.90	34,866,997.62	626,882.71

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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 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属于第一层次的余额为 340,283,673.45 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 215,011,093.45 元，第二层次 62,905.02 元，无第三层次)。

(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 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	340,283,673.45	82.38
	其中：股票	340,283,673.45	82.38
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	72,606,704.35	17.58
8	其他各项资产	166,707.32	0.04
9	合计	413,057,085.12	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资港股的金额 86,071,579.36 元，占基金净值比例 21.02%。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	189,128,376.52	46.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,102,416.00	2.22
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	18,296,882.00	4.47
J	金融业	18,709,350.00	4.57

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	18,975,069.57	4.63
S	综合	-	-
	合计	254,212,094.09	62.07

8.2.2 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（%）
工业	11,389,110.46	2.78
公用事业	9,078,553.54	2.22
能源	3,874,556.40	0.95
科技	6,769,118.15	1.65
通讯	20,030,212.38	4.89
消费品，非周期性	29,488,055.37	7.20
消费品，周期性	5,441,973.06	1.33
合计	86,071,579.36	21.02

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	333,500	18,709,350.00	4.57
2	00700	腾讯控股	60,200	16,562,633.36	4.04
3	002821	凯莱英	206,209	13,991,280.65	3.42
4	300203	聚光科技	478,200	12,265,830.00	2.99
5	002841	视源股份	213,680	12,158,392.00	2.97
6	03898	中车时代电气	299,500	11,389,110.46	2.78
7	002382	蓝帆医疗	760,700	11,304,002.00	2.76
8	300413	芒果超媒	287,207	10,629,531.07	2.60
9	300482	万孚生物	410,467	10,429,966.47	2.55
10	002223	鱼跃医疗	508,548	9,972,626.28	2.43

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	00839	中教控股	35,298,439.53	14.26
2	01530	三生制药	28,713,521.74	11.60
3	06169	宇华教育	26,504,511.09	10.71
4	002384	东山精密	26,194,587.55	10.58
5	00006	电能实业	25,636,186.16	10.35
6	300482	万孚生物	25,436,613.87	10.27
7	00700	腾讯控股	25,172,759.11	10.17
8	300308	中际旭创	23,862,458.82	9.64
9	00966	中国太平	23,301,351.66	9.41
10	002217	合力泰	22,359,475.37	9.03
11	300383	光环新网	22,339,579.80	9.02
12	300203	聚光科技	22,189,803.04	8.96
13	300323	华灿光电	21,951,597.12	8.87
14	601318	中国平安	20,661,724.00	8.35
15	01093	石药集团	20,654,979.17	8.34
16	300285	国瓷材料	17,825,763.00	7.20
17	000636	风华高科	16,886,924.98	6.82
18	002223	鱼跃医疗	15,663,166.40	6.33
19	300207	欣旺达	15,519,844.00	6.27
20	02001	新高教集团	15,378,033.60	6.21
21	300413	芒果超媒	15,202,393.00	6.14
22	002341	新纶科技	14,963,683.80	6.04
23	01288	农业银行	14,837,017.39	5.99
24	02869	绿城服务	14,702,949.49	5.94
25	00268	金蝶国际	14,534,838.39	5.87
26	002027	分众传媒	14,474,598.20	5.85
27	002382	蓝帆医疗	14,358,540.50	5.80
28	300476	胜宏科技	14,324,114.39	5.79
29	002273	水晶光电	13,906,882.46	5.62
30	01177	中国生物制药	13,885,315.68	5.61

31	002821	凯莱英	13,863,389.58	5.60
32	600900	长江电力	13,587,653.18	5.49
33	300365	恒华科技	13,419,101.00	5.42
34	03898	中车时代电气	13,258,374.51	5.36
35	00753	中国国航	13,091,846.35	5.29
36	000418	小天鹅A	12,983,459.75	5.24
37	300097	智云股份	12,942,230.68	5.23
38	600867	通化东宝	12,762,807.68	5.16
39	01038	长江基建集团	12,343,541.02	4.99
40	002531	天顺风能	12,290,631.25	4.96
41	002841	视源股份	12,149,730.80	4.91
42	00958	华能新能源	12,068,051.16	4.87
43	002466	天齐锂业	11,851,713.85	4.79
44	01317	枫叶教育	11,454,980.52	4.63
45	00941	中国移动	11,371,209.92	4.59
46	002430	杭氧股份	11,189,265.32	4.52
47	00354	中国软件国际	10,908,548.18	4.41
48	300296	利亚德	10,887,134.57	4.40
49	02269	药明生物	10,409,749.77	4.20
50	603678	火炬电子	10,359,121.00	4.18
51	002236	大华股份	10,049,342.50	4.06
52	001979	招商蛇口	9,723,310.20	3.93
53	002376	新北洋	9,517,006.91	3.84
54	02208	金风科技	9,390,861.98	3.79
55	002179	中航光电	9,372,887.85	3.79
56	002303	美盈森	9,261,988.06	3.74
57	002396	星网锐捷	9,189,404.21	3.71
58	002088	鲁阳节能	9,113,119.22	3.68
59	01138	中远海能	9,007,156.79	3.64
60	002383	合众思壮	8,999,048.00	3.63
61	002192	融捷股份	8,946,764.00	3.61
62	600529	山东药玻	8,697,080.50	3.51
63	002741	光华科技	8,687,248.28	3.51
64	600036	招商银行	8,593,027.00	3.47
65	300481	濮阳惠成	8,564,453.00	3.46
66	000963	华东医药	8,406,547.00	3.40

67	300122	智飞生物	8,342,109.00	3.37
68	300351	永贵电器	8,187,314.29	3.31
69	00836	华润电力	8,069,837.01	3.26
70	02601	中国太保	8,052,616.72	3.25
71	300760	迈瑞医疗	7,984,348.60	3.22
72	603839	安正时尚	7,834,013.60	3.16
73	002475	立讯精密	7,620,518.00	3.08
74	600438	通威股份	7,600,560.65	3.07
75	01208	五矿资源	7,514,144.34	3.04
76	300671	富满电子	7,465,850.67	3.02
77	00998	中信银行	7,370,040.91	2.98
78	00763	中兴通讯	7,367,917.35	2.98
79	002460	赣锋锂业	7,361,068.00	2.97
80	01766	中国中车	7,272,956.10	2.94
81	002262	恩华药业	7,230,948.05	2.92
82	300232	洲明科技	7,001,145.23	2.83
83	300373	扬杰科技	6,813,328.00	2.75
84	002912	中新赛克	6,702,030.58	2.71
85	300724	捷佳伟创	6,569,918.24	2.65
86	002439	启明星辰	6,511,987.00	2.63
87	01970	IMAX CHINA	6,511,674.07	2.63
88	603197	保隆科技	6,508,516.80	2.63
89	002632	道明光学	6,504,760.00	2.63
90	000538	云南白药	6,489,917.00	2.62
91	02382	舜宇光学科技	6,465,620.88	2.61
92	00981	中芯国际	6,385,666.09	2.58
93	600406	国电南瑞	6,345,725.82	2.56
94	002415	海康威视	6,295,788.69	2.54
95	300073	当升科技	6,271,317.00	2.53
96	002916	深南电路	6,267,988.58	2.53
97	300750	宁德时代	6,182,816.54	2.50
98	01347	华虹半导体	6,181,671.79	2.50
99	002751	易尚展示	6,135,641.22	2.48
100	002739	万达电影	6,107,591.50	2.47
101	02005	石四药集团	6,072,857.97	2.45
102	000681	视觉中国	5,731,014.00	2.31

103	00670	中国东方航空股份	5,713,999.93	2.31
104	603595	东尼电子	5,462,272.58	2.21
105	603885	吉祥航空	5,363,245.00	2.17
106	01579	颐海国际	5,266,730.60	2.13
107	002463	沪电股份	5,205,883.00	2.10

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。

8.4.2 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	01093	石药集团	33,810,005.21	13.66
2	00839	中教控股	30,251,477.09	12.22
3	00966	中国太平	27,871,551.19	11.26
4	00006	电能实业	25,298,208.17	10.22
5	300308	中际旭创	21,811,087.15	8.81
6	00753	中国国航	21,385,761.12	8.64
7	00700	腾讯控股	20,286,913.01	8.19
8	02001	新高教集团	20,033,328.70	8.09
9	300383	光环新网	18,454,925.07	7.45
10	00268	金蝶国际	17,770,644.56	7.18
11	300476	胜宏科技	17,266,070.47	6.97
12	02601	中国太保	17,017,739.35	6.87
13	01530	三生制药	16,753,228.77	6.77
14	06169	宇华教育	16,744,361.10	6.76
15	00958	华能新能源	16,526,975.21	6.68
16	000636	风华高科	15,641,794.00	6.32
17	02208	金风科技	15,531,651.70	6.27
18	002217	合力泰	15,428,744.00	6.23
19	300323	华灿光电	15,210,620.42	6.14
20	01288	农业银行	15,176,211.88	6.13
21	01177	中国生物制药	14,661,232.03	5.92
22	002384	东山精密	14,399,156.30	5.82
23	300207	欣旺达	14,269,741.15	5.76
24	600438	通威股份	13,427,918.76	5.42
25	02869	绿城服务	12,842,464.27	5.19
26	300413	芒果超媒	12,688,759.02	5.13
27	01317	枫叶教育	12,186,874.45	4.92

28	01038	长江基建集团	12,176,185.81	4.92
29	002027	分众传媒	11,887,008.58	4.80
30	02018	瑞声科技	11,871,909.64	4.80
31	002236	大华股份	11,711,398.85	4.73
32	000418	小天鹅 A	11,495,648.11	4.64
33	002456	欧菲科技	11,393,065.47	4.60
34	002273	水晶光电	11,360,298.34	4.59
35	01336	新华保险	11,086,450.98	4.48
36	00941	中国移动	11,016,581.50	4.45
37	300285	国瓷材料	10,930,462.00	4.41
38	002341	新纶科技	10,899,900.01	4.40
39	02238	广汽集团	10,730,413.91	4.33
40	00215	和记电讯香港	10,657,521.09	4.30
41	002466	天齐锂业	10,622,938.75	4.29
42	300296	利亚德	10,223,044.85	4.13
43	00762	中国联通	10,088,427.45	4.07
44	600529	山东药玻	9,817,370.96	3.97
45	300482	万孚生物	9,601,146.70	3.88
46	300203	聚光科技	9,514,563.00	3.84
47	300365	恒华科技	9,507,120.79	3.84
48	002088	鲁阳节能	9,359,301.42	3.78
49	001979	招商蛇口	9,227,972.05	3.73
50	002396	星网锐捷	9,050,897.16	3.66
51	01208	五矿资源	9,004,512.55	3.64
52	002430	杭氧股份	8,984,222.90	3.63
53	600036	招商银行	8,797,241.37	3.55
54	603678	火炬电子	8,739,624.00	3.53
55	300408	三环集团	8,728,183.36	3.53
56	300351	永贵电器	8,595,420.40	3.47
57	02382	舜宇光学科技	8,034,682.19	3.25
58	002383	合众思壮	7,865,339.00	3.18
59	01347	华虹半导体	7,848,682.44	3.17
60	002600	领益智造	7,712,185.00	3.12
61	01138	中远海能	7,626,640.18	3.08
62	002303	美盈森	7,620,059.00	3.08
63	300122	智飞生物	7,582,808.46	3.06
64	002531	天顺风能	7,558,880.80	3.05
65	002475	立讯精密	7,549,144.73	3.05

66	002460	赣锋锂业	7,386,412.00	2.98
67	00998	中信银行	7,357,949.50	2.97
68	01114	BRILLIANCE CHI	7,320,134.28	2.96
69	300232	洲明科技	7,222,526.50	2.92
70	603799	华友钴业	7,091,499.30	2.86
71	300015	爱尔眼科	7,053,909.52	2.85
72	603839	安正时尚	6,953,449.20	2.81
73	01766	中国中车	6,934,995.31	2.80
74	002912	中新赛克	6,892,684.00	2.78
75	002632	道明光学	6,863,679.00	2.77
76	000963	华东医药	6,691,468.50	2.70
77	02005	石四药集团	6,670,419.62	2.69
78	000967	盈峰环境	6,516,245.46	2.63
79	000681	视觉中国	6,443,077.00	2.60
80	002555	三七互娱	6,287,323.24	2.54
81	01579	颐海国际	6,276,939.71	2.54
82	600703	三安光电	6,273,534.91	2.53
83	603885	吉祥航空	6,102,983.47	2.47
84	002262	恩华药业	6,023,401.00	2.43
85	603595	东尼电子	5,787,631.00	2.34
86	002192	融捷股份	5,693,978.00	2.30
87	300671	富满电子	5,633,214.84	2.28
88	300373	扬杰科技	5,562,234.00	2.25
89	00895	东江环保	5,520,820.84	2.23
90	002815	崇达技术	5,444,514.73	2.20
91	00670	中国东方航空股份	5,432,446.46	2.19
92	00981	中芯国际	5,333,986.31	2.15

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。

8.4.3 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	1,345,649,035.35
卖出股票收入（成交）总额	1,133,610,533.30

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	150,590.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,093.50
4	应收利息	15,023.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,707.32

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
5,298	87,406.33	334,690,275.08	72.28%	128,388,441.24	27.72%

9.2 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	124,254.64	0.03%

9.3 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的情况

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。

§10 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	234,641,816.43
本报告期基金总申购份额	439,061,869.32
减:本报告期基金总赎回份额	210,624,969.43
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	463,078,716.32

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

- 1、本基金管理人于 2017 年 12 月 29 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意许义明先生辞去本公司总经理一职，聘任康乐先生担任本公司总经理。
- 2、本基金管理人于 2018 年 2 月 14 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任赵代中先生担任本公司副总经理。
- 3、本基金管理人于 2018 年 5 月 31 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任黎海威先生担任本公司副总经理。
- 4、本基金管理人于 2018 年 6 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意刘奇伟先生辞去本公司副总经理一职。
- 5、本基金管理人于 2018 年 9 月 28 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意周伟达先生辞去本公司副总经理一职。
- 6、本基金管理人于 2018 年 11 月 15 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任 CHEN WENYU（陈文宇）先生担任本公司副总经理。
- 7、本基金管理人于 2018 年 9 月 15 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意杨光裕先生辞去本公司董事长一职，由康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2018 年 11 月 14 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任丁益女士担任本公司董事长。本基金管理人于 2018 年 12 月 5 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为丁益女士。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)第2年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 60,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	670,669,107.12	27.07%	583,508.54	26.79%	-
光大证券股份有限公司	2	501,034,579.28	20.22%	440,096.41	20.20%	-
中信建投证券股份有限公司	1	331,706,084.23	13.39%	287,665.78	13.21%	-
长江证券股份有限公司	1	275,590,118.00	11.12%	242,540.38	11.13%	本期新增
中泰证券股份有限公司	3	185,022,789.82	7.47%	167,642.92	7.70%	本期新增 2个
中信证券股份有限公司	2	146,027,289.79	5.89%	125,729.68	5.77%	-
国信证券股份有限公司	2	75,500,850.44	3.05%	66,213.37	3.04%	-

长城证券股份有限公司	2	65,139,429.36	2.63%	58,536.80	2.69%	本期新增
方正证券股份有限公司	1	62,184,209.82	2.51%	57,680.41	2.65%	本期新增
天风证券股份有限公司	1	53,207,330.50	2.15%	49,551.04	2.27%	本期新增
中银国际证券有限责任公司	1	50,731,218.89	2.05%	42,929.98	1.97%	-
华创证券有限责任公司	1	37,202,472.66	1.50%	34,646.57	1.59%	本期新增
西部证券股份有限公司	2	16,231,424.88	0.66%	14,530.28	0.67%	本期新增
招商证券股份有限公司	1	7,439,267.24	0.30%	6,928.03	0.32%	-
西藏东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
渤海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期新增
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增

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。

11.7.2 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20180328--20181231	-	152,820,293.98	12,995,696.71	139,824,597.27	30.19%
	2	20180619--20180711	44,168,727.92	42,462,711.63	4,001,464.95	82,629,974.60	17.84%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性新规》”）的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 62 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议进行修改。并按照法规要求

对适用基金持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入该基金的基金财产。修改后的基金合同、托管协议及赎回费相关规则调整等事宜已于 2018 年 3 月 31 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2018 年 3 月 23 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的公告》。

景顺长城基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日