
景顺长城动力平衡证券投资基金 2019 年 半年 年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 日

§1 重要提示及目录

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。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	35
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.....	35
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.....	35
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	35
7.12 投资组合报告附注.....	35
§ 8 基金份额持有人信息.....	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
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.....	36
§ 9 开放式基金份额变动.....	36
§ 10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	39
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	40
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.....	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
§ 12 备查文件目录.....	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城动力平衡证券投资基金
基金简称	景顺长城动力平衡混合
场内简称	无
基金主代码	260103
交易代码	260103
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金
系列其他子基金名称	景顺长城优选混合(260101)、景顺长城货币(260102)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月24日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,129,256,042.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本系列基金运用专业化的投资管理，为基金持有人提供长期稳定并可持续的资本增值，动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾，争取为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	通过在股票、债券和现金之间动态的资产配置来获得资本保全，并获得稳定的回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×45%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金是一种具有中等风险的投资工具，除了结合景顺长城股票及债券投资的风险管理程序以外，为达到平稳回报的目的，该基金还将独立地对风险来源进行评估，并设立额外的风险控制管理手段。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	518048	100818

法定代表人	丁益	刘连舸
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路1号 嘉里建设广场第一座21层

§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	34,307,031.53
本期利润	391,919,189.18
加权平均基金份额本期利润	0.3276
本期加权平均净值利润率	29.66%
本期基金份额净值增长率	35.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	277,970,137.61
期末可供分配基金份额利润	0.2462
期末基金资产净值	1,407,226,179.73
期末基金份额净值	1.2462
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	494.62%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

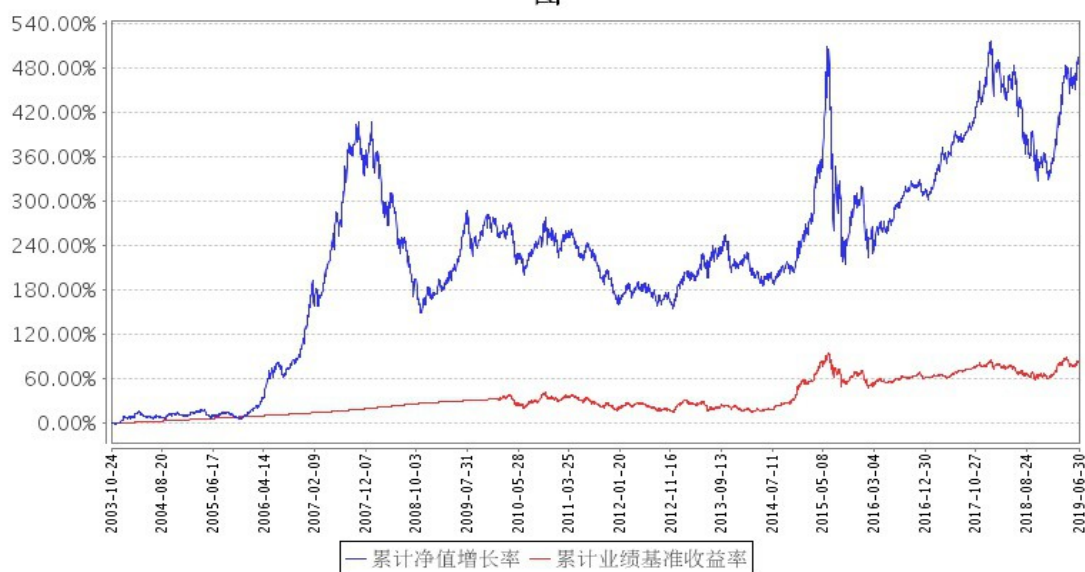
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.00%	1.09%	2.99%	0.57%	2.01%	0.52%

过去三个月	6.18%	1.36%	-0.24%	0.75%	6.42%	0.61%
过去六个月	35.02%	1.31%	13.93%	0.76%	21.09%	0.55%
过去一年	9.24%	1.38%	8.01%	0.75%	1.23%	0.63%
过去三年	55.43%	1.06%	16.39%	0.55%	39.04%	0.51%
自基金合同生效起至今	494.62%	1.29%	83.39%	0.57%	411.23%	0.72%

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

景顺长城动力平衡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：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的 20%至 80%；债券投资的比例为基金资产净值的 20%至 80%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自 2003 年 10 月 24 日合同生效日起至 2004 年 1 月 23 日为建仓期。本基金于 2007 年 9 月 10 日实施分红，此后基金资产规模持续增长，根据基金部函[2007]91 号《关于实施基金份额拆分后调整基金建仓期有关问题的复函》的有关规定，本基金证券投资比例的调整期限延长至 2007 年 10 月 9 日止。建仓期结束时，本基金投资组合均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		
刘苏	本基金的基金经理、股票投资部研究副总监	2015 年 9 月 29 日		14	理学硕士。曾担任深圳国际信托投资有限公司（现华润深国投信托）信托经理，鹏华基金高级研究员、基金经理助理、基金经理职务。2015 年 5 月加入本公司，自 2015 年 9 月起担任股票投资部基金经理，现任股票投资部研究副总监兼基金经理职务。

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、《景顺长城景系列开放式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

相比去年下半年，本报告期内，国内货币政策回归中性，社会融资规模增长速度有所回升，中美贸易摩擦有阶段性的反复，但是市场情绪明显有所修复。从结果上看，A 股市场 1 季度整体上涨，之后大致呈现震荡走势。相对而言，竞争力更强、业绩更好的消费品如食品饮料、餐饮旅游以及业绩相对稳定的金融和家电板块表现较好。报告期内，考虑到市场估值比较有吸引力，本基金的权益仓位始终保持较高水平，同时我们依然坚持以竞争优势、成长性和估值水平为最重要的选股要素，采取了坚守优质龙头公司的策略，取得了较好的效果。

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 35.02%，业绩比较基准收益率为 13.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过年初以来的反弹，A 股市场估值水平已经从显著低估回归到基本合理状态。未来一段时间，市场流动性大概率以稳为主，既难以看到去年去杠杆导致的资金面紧张，又难以看到大水漫灌，市场整体估值扩张的过程应告一段落。上市公司整体的业绩增长仍在探底过程中，前期贸易

冲突的影响或许在 3 季度中开始显现。综合上面三点，我们认为未来一段时间 A 股没有系统性的机会，仍要精选个股，靠所投资企业的利润增长来推动股价上升。

中长期来看，外资进入国内市场是大趋势。从海外资金全球配置的角度去思考，我们认为，通常一个国家的长期牛股都与该国的比较优势是一致的。对应到中国的特色优势，一是存在庞大的内需市场，能够孕育强大的品牌消费品和服务企业，二是完备的制造业企业，能够产生一些具备国际竞争力的制造业龙头企业。而这两类公司，也将是我们相当长时期内的核心持仓。短期来看，随着部分消费品公司和服务类公司估值大幅上涨后，性价比下降，我们更多关注一些在制造业或公用事业等领域中具备竞争力且预期不高的品种。

我们将坚持把控制风险收益比作为首要前提，选择“好行业、好企业、好时机”三因素结合的投资机会，更积极关注一些未来业绩增长确定性强的细分子行业或行业集中度在快速提升的行业，从中选出具备竞争力和成长性且估值合理的品种，通过陪伴优秀企业、分享企业利润增长来实现资产的增长。

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。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城动力平衡证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：景顺长城动力平衡证券投资基金

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	43,858,730.69	138,889,658.49
结算备付金		1,463,200.06	719,382.69

存出保证金		160,863.27	206,340.25
交易性金融资产	6.4.7.2	1,364,236,661.43	1,023,196,701.28
其中：股票投资		1,069,520,753.38	773,010,701.28
基金投资		-	-
债券投资		294,715,908.05	250,186,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,187,368.91	7,977,732.52
应收股利		-	-
应收申购款		213,008.07	82,480.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,414,119,832.43	1,171,072,295.30
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2019年6月30日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	2,183.06
应付赎回款		3,569,880.02	917,737.17
应付管理人报酬		1,686,891.86	1,524,179.44
应付托管费		281,148.61	254,029.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	644,883.49	512,582.15
应交税费		489,386.81	489,361.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	221,461.91	240,661.36
负债合计		6,893,652.70	3,940,734.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,129,256,042.12	1,264,539,100.00
未分配利润	6.4.7.10	277,970,137.61	-97,407,539.42
所有者权益合计		1,407,226,179.73	1,167,131,560.58
负债和所有者权益总计		1,414,119,832.43	1,171,072,295.30

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2462 元，基金份额总额 1,129,256,042.12 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城动力平衡证券投资基金

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	附注号	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		405,491,446.25	-43,133,995.50
1. 利息收入		4,640,594.94	7,232,205.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	270,695.69	341,739.78
债券利息收入		4,369,899.25	6,890,465.74
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）		43,161,236.39	89,101,230.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,480,846.32	70,208,094.34
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	56,258.57	762,000.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	13,624,131.50	18,131,136.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	357,612,157.65	-139,859,608.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	77,457.27	392,176.03
减：二、费用		13,572,257.07	19,177,629.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,807,769.65	13,593,487.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,634,628.21	2,265,581.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,015,449.55	3,175,441.78
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8.51	-
7. 其他费用	6.4.7.19	114,401.15	143,118.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		391,919,189.18	-62,311,624.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		391,919,189.18	-62,311,624.59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城动力平衡证券投资基金

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）	1,264,539,100.00	-97,407,539.42	1,167,131,560.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	391,919,189.18	391,919,189.18
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）	-135,283,057.88	-16,541,512.15	-151,824,570.03
其中：1. 基金申购款	38,038,335.81	5,201,362.63	43,239,698.44
2. 基金赎回款	-173,321,393.69	-21,742,874.78	-195,064,268.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,129,256,042.12	277,970,137.61	1,407,226,179.73
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）	1,476,732,497.91	282,131,109.73	1,758,863,607.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-62,311,624.59	-62,311,624.59
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）	-66,298,550.25	-5,472,392.88	-71,770,943.13
其中：1. 基金申购款	449,129,013.32	94,316,391.04	543,445,404.36
2. 基金赎回款	-515,427,563.57	-99,788,783.92	-615,216,347.49
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	-	-15,797,599.71	-15,797,599.71

填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,410,433,947.66	198,549,492.55	1,608,983,440.21

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

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第96号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于2003年10月24日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为景顺长城动力平衡证券投资基金(以下简称“本基金”)、景顺长城优选股票证券投资基金和景顺长城货币市场证券投资基金(2005年7月15日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金)。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,835,000,215.28元,其中包括本基金人民币540,701,410.62元、景顺长城优选股票证券投资基金人民币820,829,988.03元和景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币473,468,816.63元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2003)第144号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币782,418.90元在基金募集期结束时计入投资者认购账户,折合成782,418.90份基金份额,其中本基金261,168.43份基金份额、景顺长城优选股票证券投资基金262,508.27份基金份额、景顺长城恒丰债券证券投资基金258,742.20份基金份额,归投资者所有。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《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的A股;债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转债等。在正常情况下,本基金的资产配置比例为:股票投资占基金资产净值的20%-80%,债券投资占基金资产净值的20%-80%。本基金的原业绩比较基准为:一年期银行定期存款年利率的2倍,根据本基金的基金管理人发布的《景顺长城动力平衡证券投资基金变更业绩比较基

准及修改相关基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2010 年 1 月 29 日起变更为：沪深 300 指数收益率 X50%+中国债券总指数收益率 X45%+银行同业存款收益率 X5%。

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》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 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、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]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	43,858,730.69
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	43,858,730.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	836,141,792.53	1,069,520,753.38	233,378,960.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,006,908.05	366,408.05
	银行间市场	290,709,000.00	170,090.00
	合计	294,715,908.05	536,498.05
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,130,321,202.53	1,364,236,661.43	233,915,458.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	6,799.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	644.49
应收债券利息	4,179,859.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	65.16
合计	4,187,368.91

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	644,708.49

银行间市场应付交易费用	175.00
合计	644,883.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,928.50
预提费用	95,813.41
其他	123,720.00
合计	221,461.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,264,539,100.00	1,264,539,100.00
本期申购	38,038,335.81	38,038,335.81
本期赎回（以“-”号填列）	-173,321,393.69	-173,321,393.69
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,129,256,042.12	1,129,256,042.12

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	390,498,000.54	-487,905,539.96	-97,407,539.42
本期利润	34,307,031.53	357,612,157.65	391,919,189.18
本期基金份额交易产生的变动数	-39,846,386.66	23,304,874.51	-16,541,512.15
其中：基金申购款	11,171,019.89	-5,969,657.26	5,201,362.63
基金赎回款	-51,017,406.55	29,274,531.77	-21,742,874.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	384,958,645.41	-106,988,507.80	277,970,137.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	260,215.79

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,715.70
其他	1,764.20
合计	270,695.69

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	720,805,710.38
减：卖出股票成本总额	691,324,864.06
买卖股票差价收入	29,480,846.32

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	179,239,800.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	172,123,100.00
减：应收利息总额	7,060,442.23
买卖债券差价收入	56,258.57

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,624,131.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,624,131.50

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	357,612,157.65
股票投资	357,679,939.60
债券投资	-67,781.95
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-

权证投资	
3. 其他	
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	
合计	357,612,157.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	65,971.23
基金转换费收入	11,486.04
合计	77,457.27

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,014,024.55
银行间市场交易费用	1,425.00
合计	2,015,449.55

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	22,348.45
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	8,987.74
合计	114,401.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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	29,267,886.85	2.26	70,374,290.65	3.42

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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	27,256.97	2.26	24,876.93	3.86
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	65,539.65	3.42	65,539.65	7.75

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后的净额列示。

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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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	9,807,769.65	13,593,487.71
其中：支付销售机构的客户维护费	2,483,145.12	3,061,051.28

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,634,628.21	2,265,581.29

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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
中国银行	43,858,730.69	260,215.79	98,262,881.40	319,054.66

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人員对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资

进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.28%（上年末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,858,730.69	-	-	-	-	-	43,858,730.69
结算备付金	1,463,200.06	-	-	-	-	-	1,463,200.06
存出保证金	160,863.27	-	-	-	-	-	160,863.27
交易性金融资产	50,015,000.00	-	119,940,000.00	120,754,000.00	4,006,908.05	1,069,520,753.38	1,364,236,661.43

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,187,368.91	4,187,368.91
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	213,008.07	213,008.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	95,497,794.02	-	119,940,000.00	120,754,000.00	4,006,908.05	1,073,921,130.36	1,414,119,832.43
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,569,880.02	3,569,880.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,686,891.86	1,686,891.86
应付托管费	-	-	-	-	-	281,148.61	281,148.61
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	644,883.49	644,883.49
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	489,386.81	489,386.81
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	221,461.91	221,461.91
负债总计	-	-	-	-	-	6,893,652.70	6,893,652.70
利率敏感度缺口	95,497,794.02	-	119,940,000.00	120,754,000.00	4,006,908.05	-	-
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	138,889,658.49	-	-	-	-	-	138,889,658.49
结算备付金	719,382.69	-	-	-	-	-	719,382.69
存出保证金	206,340.25	-	-	-	-	-	206,340.25
交易性金融资产	90,036,000.00	80,200,000.00	50,160,000.00	29,790,000.00	-	773,010,701.28	1,023,196,701.28
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	7,977,732.52	7,977,732.52
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	82,480.07	82,480.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	229,851,381.43	80,200,000.00	50,160,000.00	29,790,000.00	-	781,070,913.87	1,171,072,295.30
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	917,737.17	917,737.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,524,179.44	1,524,179.44
应付托管费	-	-	-	-	-	254,029.94	254,029.94
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,183.06	2,183.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	512,582.15	512,582.15

应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	489,361.60	489,361.60
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	240,661.36	240,661.36
负债总计	-	-	-	-	-	3,940,734.72	3,940,734.72
利率敏感度缺口	229,851,381.43	30,200,000.00	50,160,000.00	29,790,000.00	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-661,304.51	-265,517.54
	市场利率下降 25 个基点	665,010.50	266,880.29

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,069,520,753.38	76.00	773,010,701.28	66.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	1,069,520,753.38	76.00	773,010,701.28	66.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	54,592,529.19	53,948,496.51
	沪深 300 指数下降 5%	-54,592,529.19	-53,948,496.51

6.4.14 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 1,073,470,684.89 元，属于第二层次的余额为 290,765,976.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 772,960,555.48 元，第二层次 250,236,145.80 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 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	1,069,520,753.38	75.63
	其中：股票	1,069,520,753.38	75.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	294,715,908.05	20.84
	其中：债券	294,715,908.05	20.84
	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	45,321,930.75	3.20
8	其他各项资产	4,561,240.25	0.32
9	合计	1,414,119,832.43	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	48,668,869.26	3.46
B	采矿业	363,431.25	0.03
C	制造业	617,035,580.61	43.85

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	84,832,051.92	6.03
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	29,287,031.76	2.08
J	金融业	183,178,634.98	13.02
K	房地产业	89,775,531.00	6.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,356,516.00	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,069,520,753.38	76.00

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所有股票投资明细

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	000568	泸州老窖	1,655,487	133,813,014.21	9.51
2	600519	贵州茅台	115,531	113,682,504.00	8.08
3	601318	中国平安	1,278,996	113,331,835.56	8.05
4	601155	新城控股	2,255,100	89,775,531.00	6.38
5	002727	一心堂	2,977,608	84,832,051.92	6.03
6	002304	洋河股份	609,758	74,122,182.48	5.27
7	600036	招商银行	1,940,326	69,812,929.48	4.96
8	000651	格力电器	1,008,485	55,466,675.00	3.94
9	300498	温氏股份	1,357,191	48,668,869.26	3.46
10	603899	晨光文具	1,036,240	45,563,472.80	3.24
11	300760	迈瑞医疗	216,169	35,278,780.80	2.51
12	603444	吉比特	139,300	29,247,428.00	2.08
13	000333	美的集团	498,948	25,875,443.28	1.84
14	601100	恒立液压	812,021	25,481,218.98	1.81
15	300408	三环集团	1,303,900	25,360,855.00	1.80

16	002616	长青集团	3,282,045	23,794,826.25	1.69
17	600563	法拉电子	544,362	22,411,383.54	1.59
18	002311	海大集团	550,600	17,013,540.00	1.21
19	603259	药明康德	188,700	16,356,516.00	1.16
20	002415	海康威视	417,380	11,511,340.40	0.82
21	600298	安琪酵母	236,593	7,483,436.59	0.53
22	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.03
23	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
24	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
25	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
26	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
27	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
28	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
29	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

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	002727	一心堂	68,896,545.40	5.90
2	600036	招商银行	65,556,809.80	5.62
3	300498	温氏股份	56,442,175.30	4.84
4	000651	格力电器	46,295,163.46	3.97
5	601601	中国太保	35,829,911.76	3.07
6	000961	中南建设	34,557,395.11	2.96
7	601155	新城控股	31,302,242.33	2.68
8	603444	吉比特	28,228,511.90	2.42
9	000333	美的集团	26,588,938.92	2.28
10	601318	中国平安	26,358,557.91	2.26
11	300408	三环集团	25,967,505.67	2.22
12	600563	法拉电子	24,061,921.94	2.06
13	601100	恒立液压	23,505,453.25	2.01
14	603708	家家悦	18,273,173.60	1.57
15	002311	海大集团	15,297,025.36	1.31
16	603259	药明康德	14,990,681.00	1.28
17	601939	建设银行	14,008,240.35	1.20
18	300770	新媒股份	13,244,877.37	1.13
19	002415	海康威视	6,914,635.39	0.59
20	300015	爱尔眼科	5,948,620.00	0.51

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	300207	欣旺达	57,712,619.21	4.94
2	002303	美盈森	53,505,211.55	4.58
3	600340	华夏幸福	48,801,985.30	4.18
4	603899	晨光文具	47,987,780.69	4.11
5	000596	古井贡酒	45,811,274.52	3.93
6	601601	中国太保	40,883,297.00	3.50
7	000961	中南建设	36,811,620.76	3.15
8	300482	万孚生物	33,629,691.81	2.88
9	002572	索菲亚	33,563,939.41	2.88
10	000418	小天鹅A	33,123,401.92	2.84
11	603788	宁波高发	30,224,088.89	2.59
12	000568	泸州老窖	26,468,186.35	2.27
13	002415	海康威视	25,016,577.17	2.14
14	603708	家家悦	20,519,422.28	1.76
15	000651	格力电器	19,298,344.06	1.65
16	002027	分众传媒	19,093,350.00	1.64
17	002616	长青集团	18,468,021.26	1.58
18	002304	洋河股份	15,077,950.68	1.29
19	600298	安琪酵母	14,912,534.00	1.28
20	601939	建设银行	12,888,974.40	1.10

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	630,154,976.56
卖出股票收入(成交)总额	720,805,710.38

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	290,709,000.00	20.66
	其中:政策性金融债	290,709,000.00	20.66
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)	4,006,908.05	0.28
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	294,715,908.05	20.94

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	190201	19 国开 01	1,100,000	109,956,000.00	7.81
2	160206	16 国开 06	700,000	69,874,000.00	4.97
3	180208	18 国开 08	500,000	50,880,000.00	3.62
4	180209	18 国开 09	500,000	50,015,000.00	3.55
5	190301	19 进出 01	100,000	9,984,000.00	0.71

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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	160,863.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,187,368.91
5	应收申购款	213,008.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,561,240.25

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不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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 (%)
134,531	8,394.02	83,753,644.42	7.42	1,045,502,397.70	92.58

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	1,270.74	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、基金投资和研发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 (2003 年 10 月 24 日) 基金份额总额	540,962,579.05
-----------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	1,264,539,100.00
本报告期基金总申购份额	38,038,335.81
减：本报告期基金总赎回份额	173,321,393.69
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	1,129,256,042.12

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5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
西南证券股份有限公司	1	459,389,177.23	35.45%	427,827.99	35.51%	-
东方证券股份有限公司	1	181,415,681.08	14.00%	168,953.37	14.02%	-
东吴证券股份有限公司	1	180,819,395.04	13.95%	168,398.16	13.98%	-
中国银河证券股份有限公司	2	122,186,123.38	9.43%	113,792.68	9.44%	-
广发证券股份有限公司	2	102,817,542.36	7.93%	95,755.19	7.95%	-
北京高华证券有限责任公司	1	94,564,192.78	7.30%	88,067.52	7.31%	-
海通证券股份有限公司	2	52,636,929.31	4.06%	49,020.79	4.07%	-
中信建投证券股份有限公司	1	37,367,269.55	2.88%	34,800.31	2.89%	-
长城证券股份有限公司	1	29,267,886.85	2.26%	27,256.97	2.26%	-
中信证券股份有限公司	2	16,800,088.84	1.30%	13,645.90	1.13%	-
浙商证券股份有限公司	1	12,427,245.31	0.96%	11,573.65	0.96%	-
招商证券股份有限公司	1	6,147,023.00	0.47%	5,724.73	0.48%	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金本期租用交易单元未发生变化。

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
西南证券股份有限公司	503,358.50	23.09%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	136,105.20	6.24%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	702,814.50	32.24%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	837,522.60	38.42%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城动力平衡证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报	2019-01-21
2	景顺长城基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报	2019-01-30
3	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-02-01
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-02-23
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳盈信基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	证券时报	2019-02-27
6	景顺长城动力平衡证券投资基金 2018 年年度报告	证券时报	2019-03-26

7	景顺长城动力平衡证券投资基金 2018 年年度报告摘要	证券时报	2019-03-26
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-01
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-01
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-03
11	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-04
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-04
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	证券时报	2019-04-04
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-08
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-11
16	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-16
17	景顺长城动力平衡证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-20
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-09
19	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	证券时报	2019-05-13
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-05-16
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-20
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-06-04
23	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	证券时报	2019-06-06
24	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	证券时报	2019-06-06
25	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报	2019-06-15
26	景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同	证券时报	2019-06-15
27	景顺长城景系列开放式证券投资基金托管协议	证券时报	2019-06-15
28	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书	证券时报	2019-06-15
29	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2019 年第 2 号更新招募说明书摘要	证券时报	2019-06-15
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证券时报	2019-06-21
31	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-06-25

32	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	证券时报	2019-06-26
33	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-06-27

§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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城景系列开放式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城景系列开放式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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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

2019 年 8 月 23 日