景顺长城智能生活混合型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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01月31日(基金合同生效日)起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城智能生活混合
场内简称	无
基金主代码	005914
交易代码	005914
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,073,172.32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,重点投资于智能生活主题相关证券,力争获取超越业绩比较基准的投资回报,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	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,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2.股票投资策略 本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略,自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的符合智能生活主题的股票构建投资组合。 3.债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率*50%+恒生指数收益率*30%+中国债券总指数收益率*20%
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。 本基金还可投资港股通标的的股票,除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	贺倩
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	tgxxpl@abchina.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.igwfmc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月31日(基金合同生效日)-2019年6月30日)
本期已实现收益	2,459,737.20
本期利润	5,034,281.78
加权平均基金份额本期利润	0.0095
本期基金份额净值增长率	-0.65%
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	-0.0106
期末基金资产净值	165,002,767.48
期末基金份额净值	0.9935

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四位,小数点后第五位舍去,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。

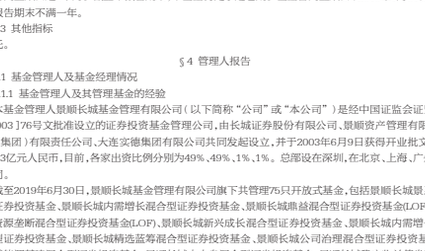
5.本基金基金合同生效日为2019年1月31日。

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	3.42%	0.87%	4.12%	0.83%	-0.70%	0.04%
过去三个月	-1.32%	1.15%	-2.11%	1.01%	0.79%	0.14%
自基金合同生效起至今	-0.65%	0.90%	11.09%	1.05%	-11.74%	-0.15%

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:基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,其中投资于本基金界定的“智能生活”主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%,投资于港股通标的股票比例不超过股票资产的50%;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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自2019年1月31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(2019年1月31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、景顺长城内需增长灵活配置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、景顺长城鑫月新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、景顺长城景益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证500行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城MSCI中国A股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证500指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
詹成	本基金的基金经理	2019年1月31日	-	8	通信电子工程博士,曾担任英国诺基亚研发中心研究员。2011年7月加入本公司,历任研究部研究员、专户投资部投资经理。自2015年12月起担任股票投资部基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,“任职日期”为根据公司决定聘任后的公告日期,“离任日期”为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城智能生活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

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

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

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日,本基金份额净值增长率为-0.65%,业绩比较基准收益率为11.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策,基金估值委员会在遵守法律法规的前提下,通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式,谨慎合理地制定高效可行的估值方法,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31日(基金合同生效日)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:景顺长城智能生活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
资 产:	
银行存款	60,554,486.18
结算备付金	260,030.62
存出保证金	108,412.04
交易性金融资产	104,826,593.58
其中:股票投资	104,559,101.83
基金投资	-
债券投资	267,491.75
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	24,685.29
应收股利	46,394.07
应收申购款	15,472.11
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	165,836,073.89
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30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	5.96
应付赎回款	282,253.11
应付管理人报酬	199,823.00
应付托管费	33,303.78
应付销售服务费	-
应付交易费用	213,828.12
应交税费	1.69
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	104,090.75
负债合计	833,306.41
所有者权益:	
实收基金	166,073,172.32
未分配利润	-1,070,404.84
所有者权益合计	165,002,767.48
负债和所有者权益总计	165,836,073.89

注:1.报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9935元,基金份额总额166,073,172.32份。

2.本时务报表的实际编制期间为2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年06月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体:景顺长城智能生活混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	9,808,392.95
1.利息收入	4,068,661.34
其中:存款利息收入	3,469,335.88
债券利息收入	110.73
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	599,214.73
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,708,149.72
其中:股票投资收益	-3,015,188.42
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	307,038.70
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	5,274,544.58
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	5,873,336.75
减:二、费用	4,774,111.17
1. 管理人报酬	3,349,895.00
2. 托管费	558,315.77
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	749,594.65
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	0.45
7. 其他费用	116,305.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	5,034,281.78
减:所得税费用	-
四、净利润(亏损以“-”号填列)	5,034,281.78

6.3 所有权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城智能生活混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月31日(基金合同生效日)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)	1,527,198,576.84	-	1,527,198,576.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,034,281.78	5,034,281.78
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)	-1,361,125,404.52	-6,104,686.62	-1,367,230,091.14
其中:1.基金申购款	77,131,223.41	252,435.50	77,383,658.91
2.基金赎回款	-1,438,256,627.93	-6,357,122.12	-1,444,613,750.05
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)	166,073,172.32	-1,070,404.84	165,002,767.48

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

景顺长城智能生活混合型证券投资基金(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[2018]952号《关于准予景顺长城智能生活混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2018]2495号《关于景顺长城智能生活混合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《景顺长城智能生活混合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1,526,861,886.96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(2019)第0081号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城智能生活混合型证券投资基金基金合同》于2019年1月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,527,198,576.84份基金份额,其中认购资金利息折合336,689.88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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城智能生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括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、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、同业存单、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:股票资产占基金资产的比例范围为60%-95%,其中投资于本基金界定的“智能生活”主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的80%,投资于港股通标的股票比例不超过股票资产的50%;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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的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。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自2019年1月31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(2019年1月31日)起至本报告期末不满一年。

6.4.2 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》、《景顺长城智能生活混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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

本基金2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的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31日(基金合同生效日)至2019年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月31日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末金额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组