

景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 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 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)起至 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.....	6
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.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城沪港深精选股票
场内简称	无
基金主代码	000979
交易代码	000979
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,011,594,420.63 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过对行业发展趋势、企业的基本面、经营状况进行深入研究,选择出质地优秀、成长性良好的公司进行投资,寻求基金资产的长期稳健增值,力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势,同时强调金融市场投资者行为分析,关注资本市场资金供求关系变化等因素,在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略:本基金将根据以下几方面指标,在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例及投资策略:1)宏观因素(GDP/CPI 等)、估值因素(PE/Earnings Growth 等)、政治因素--判断两地市场基本面趋势。2)估值/资金利差等指标--判断两地市场吸引力。</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>
业绩比较基准	沪深 300 指数 × 45% + 恒生指数 × 45% + 中证全债指数 × 10%
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型基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨崑阳	蒋松云
	联系电话	0755-82370388	010-66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	010-66105798
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55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55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		赵如冰	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、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(2015年4月15日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	-139,471,880.84
本期利润	-653,531,813.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0593
本期加权平均净值利润率	-5.76%
本期基金份额净值增长率	-5.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	-653,531,813.85
期末可供分配基金份额利润	-0.0593

期末基金资产净值	10,358,062,606.78
期末基金份额净值	0.941
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.90%

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。

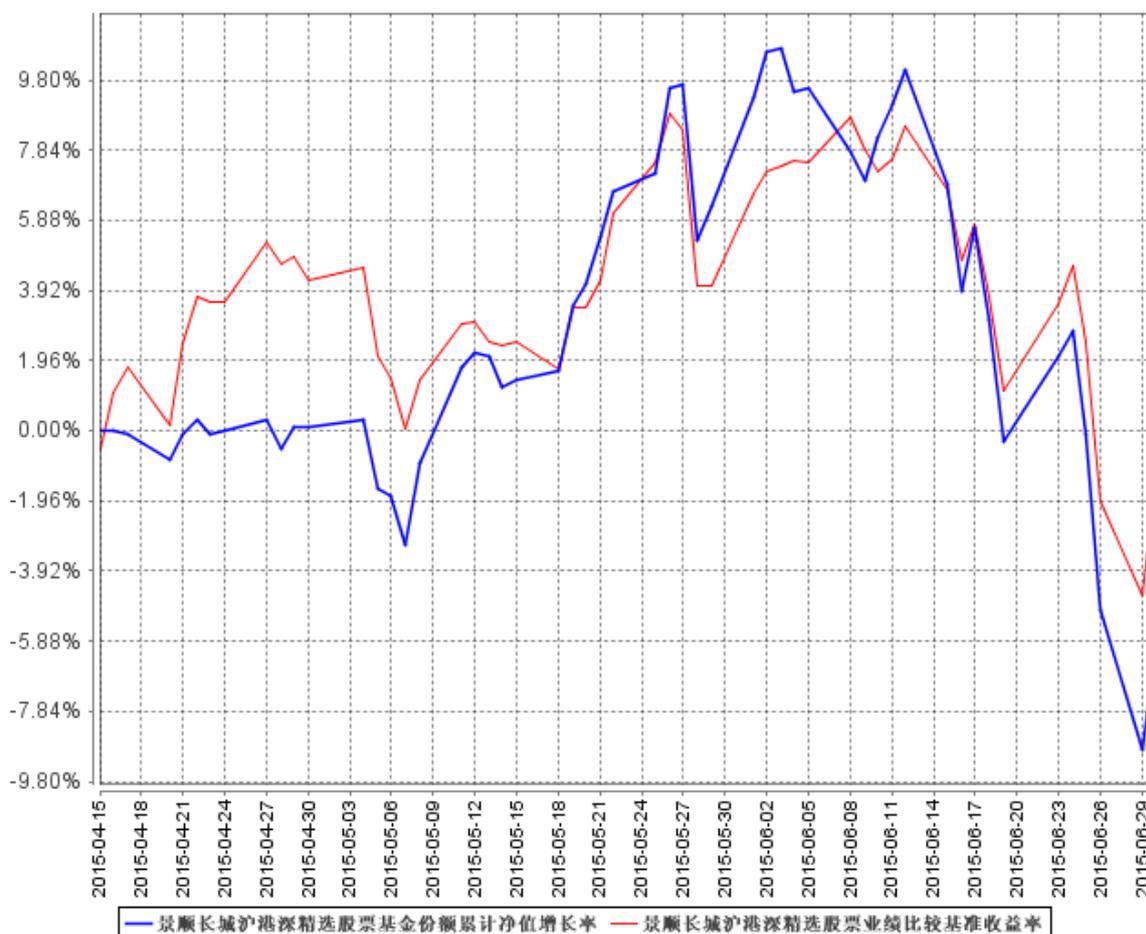
5、本基金基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日。

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	-11.48%	2.37%	-5.10%	1.94%	-6.38%	0.43%
自基金合同生效起至今	-5.90%	1.80%	-1.24%	1.59%	-4.66%	0.21%

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：本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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%。本基金的建仓期为自 2015 年 4 月 15 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（2015 年 4 月 15 日）起至本报告期末不满一年。

§ 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。

截止2015年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理46只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、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、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、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、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、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800食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生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。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股票证券投资基金、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		
谢天翎	景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	14	商学硕士，CFA。曾任台湾保诚证券投资信托股份有限公司股票投资暨研究部海外组副理和基金经理。2008 年 4 月加入本公司，担任国际投资部高级经理职务；自 2011 年 9 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、《景顺长城沪港深精选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

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

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 1 次，为公司旗下景顺长城量化精选股票

型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

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

2 季度香港地区和中国市场上涨，中国一连串降息降准的刺激政策推升股市，其中香港地区上涨 5.42%，中国上涨 14.12%。2 季度全球经济前景不明，主要经济数据时好时坏，全球面临明显的通缩环境。美国 ISM 指数上升，通胀数据下滑，就业保持稳定，工业增加值下滑，新屋销售有所回升。欧元区 PMI 指数回升，通胀数据变动不大，工业产值增速再度走跌。日本短观调查下降，通胀数据力争脱离通缩，工业订单增幅回升。中国 PMI 指数保持稳定，通胀数据持平，固定资产投资下滑。但中国陆续出台的降息降准政策为市场提供充裕的流动性，A 股市场 5 月大幅上涨，但 6 月出现去杠杆的暴跌。另外，证监会允许公募基金投资香港市场，连带推升了香港市场，不过香港市场主要在 4 月上涨，5 月以后香港市场流动性回落，恒生指数亦回挫。基金处于建仓期，在两地市场采取均衡配置，由于 5 月香港市场下跌及 6 月 A 股市场暴跌，皆拖累基金绩效表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日）至本期末，本基金份额净值增长率为-5.90%，低于业绩比较基准收益率 4.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观方面，受到希腊问题的干扰，市场亦对美联储加息有所担心，由于这是美国多年来的首次加息，投资者担心重现 2013 年下半年“缩减量宽恐慌”。不过目前大部分国家与 2013 年有所不同，多数实施刺激货币政策，同时通胀风险低、外债减少和外汇储备增长，另外，欧央行及日央行此次采取进取的政策，与美联储方向分歧，亦有助全球流动性。近期中国则积极置换地方融资平台债务，基本上缓和投资者对中国金融体系的忧虑，另一方面，也维持地方财政支出以稳定经济放缓的状况。长期来看，本轮景气周期仍将持续，主要由于经济增长数据及通胀数据偏低，各国都避免紧缩政策以延续周期扩张。A 股市场的核心驱动因素如资金利率下降、改革提升信心、增量资金入市、A 股对外开放等逻辑未变，惟短期信心不稳，因此波动性大，投资策略将以产业增长确定性高、公司相对经营稳定的公司为主，同时亦将关注流动性佳的公司。港股市场估值较 A 股便宜，与成熟市场亦有 10%的折价，因此估值仍较具优势。投资策略则选择具备核心技术、拥有品牌或行业地位稳固的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

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，基金托管人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小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资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、行业发展及个股状况等各方面因素，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小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资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小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组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，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，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，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同生效不满 3 个月，根据相关法律法规和基金合同的要求，无需进行利润分配。

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

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金 2015 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,197,190,001.24
结算备付金		202,872,927.92
存出保证金		1,386,475.75
交易性金融资产	6.4.7.2	7,843,410,355.91
其中：股票投资		7,843,410,355.91
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	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		97,528,675.34
应收利息	6.4.7.5	829,618.72
应收股利		43,158,658.16
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		10,386,376,713.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		14,193,724.23
应付托管费		2,365,620.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	11,657,408.84
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	97,352.50
负债合计		28,314,106.26
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	11,011,594,420.63

未分配利润	6.4.7.10	-653,531,813.85
所有者权益合计		10,358,062,606.78
负债和所有者权益总计		10,386,376,713.04

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.941 元，基金份额总额 11,011,594,420.63 份。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 4 月 15 日。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-591,876,522.74
1.利息收入		13,899,468.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,899,468.09
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-91,716,057.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-164,254,250.27
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	72,538,192.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-514,059,933.01
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	-
减：二、费用		61,655,291.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	35,376,469.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,896,078.22
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	20,282,055.72
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	100,687.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-653,531,813.85
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-653,531,813.85
-------------------	--	-----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 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)	11,011,594,420.63	-	11,011,594,420.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-653,531,813.85	-653,531,813.85
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	11,011,594,420.63	-653,531,813.85	10,358,062,606.78

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：

_____ 许义明 _____

基金管理人负责人

_____ 吴建军 _____

主管会计工作负责人

_____ 邵媛媛 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1367号文《关于准予景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》作为发起人于2015年3

月 26 日至 2015 年 4 月 13 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2015)验字第 60467014_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 11,009,906,422.65 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 1,687,997.98 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 11,011,594,420.63 元，折合 11,011,594,420.63 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、资产支持证券、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）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金将基金资产的 80%–95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0–95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0–95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×45% +恒生指数×45% +中证全债指数×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日。

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

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债)，并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项

本基金目前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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值

作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对最近市场交易价格进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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，并于期末全额转入未分配利润/（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 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加

强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月24日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红

利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,097,190,001.24
定期存款	1,100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期间 1 个月以内	1,100,000,000.00
其他存款	-
合计：	2,197,190,001.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,357,470,288.92	7,843,410,355.91	-514,059,933.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	8,357,470,288.92	7,843,410,355.91	-514,059,933.01

注：股票投资中，上海证券交易所市场股票公允价值为 1,321,167,332.29 元，深圳证券交易所市场股票公允价值为 3,091,217,781.39 元，香港交易所市场股票公允价值为 3,431,025,242.23 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

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

本基金本期末的买入返售金融资产项目余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无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 2015年6月30日
应收活期存款利息	121,293.46
应收定期存款利息	684,444.44
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	23,319.31
应收债券利息	-
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	561.51
合计	829,618.72

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,657,408.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,657,408.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	97,352.50
合计	97,352.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	11,011,594,420.63	11,011,594,420.63
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,011,594,420.63	11,011,594,420.63

注：设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 11,009,906,422.65 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 1,687,997.98 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 11,011,594,420.63 元，折合 11,011,594,420.63 份基金份额。截止本报告期末，本基金尚未开放申购、赎回业务。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-139,471,880.84	-514,059,933.01	-653,531,813.85

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-139,471,880.84	-514,059,933.01	-653,531,813.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
活期存款利息收入	2,383,705.64
定期存款利息收入	11,248,055.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	101,294.34
其他	166,412.55
合计	13,899,468.09

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
卖出股票成交总额	2,464,569,544.21
减：卖出股票成本总额	2,628,823,794.48
买卖股票差价收入	-164,254,250.27

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期债券投资收益无发生额。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益发生额为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
----	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	72,538,192.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	72,538,192.45

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
1. 交易性金融资产	-514,059,933.01
——股票投资	-514,059,933.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-514,059,933.01

6.4.7.17 其他收入

本基金本期其他收入发生额为零。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
交易所市场交易费用	20,282,055.72
银行间市场交易费用	-
合计	20,282,055.72

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015 年6月30日
审计费用	38,352.16
信息披露费	57,528.24

债券托管账户维护费	1,472.10
银行划款手续费	2,935.17
证券账户开户费	400.00
合计	100,687.67

6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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。

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 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	2,026,707,420.57	15.07%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期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 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015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	1,688,435.34	14.48%	1,688,435.34	14.48%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

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 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	15,106,418.71

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。基金管理费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 6 月 30 日的应付基金管理费为人民币 14,193,724.23 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。基金托管费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 于 2015 年 6 月 30 日的应付基金托管费为人民币 2,365,620.69 元。

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

本基金本期末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

本基金基金管理人本期末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

本基金的其他关联方于本期末未持有本基金份额。

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 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	1,097,190,001.24	2,383,705.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2015 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

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	重大事项	50.16	2015 年 7 月 3 日	52.77	2,499,267	132,240,028.16	125,363,232.72	-
600643	爱建股份	2015 年 6 月 30 日	重大事项	16.73	-	-	7,046,861	105,348,155.50	117,893,984.53	-

000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事件	30.82	-	-	846,200	22,016,081.58	26,079,884.00	-
002303	美盈森	2015年6月9日	重大事件	37.78	2015年7月13日	21.43	3,379,151	91,956,544.61	127,664,324.78	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事件	37.76	2015年7月13日	34.65	5,935,367	186,145,956.17	224,119,457.92	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 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。

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、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四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，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员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，债券发行人信用评级降低等导致基金资产损失和收益变化的风险。

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%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，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

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。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公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	2,197,190,001.24	-	-	-	-	-	2,197,190,001.24
结算备付金	202,872,927.92	-	-	-	-	-	202,872,927.92
存出保证金	1,386,475.75	-	-	-	-	-	1,386,475.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,843,410,355.91	7,843,410,355.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	97,528,675.34	97,528,675.34

应收利息	-	-	-	-	829,618.72	829,618.72
应收股利	-	-	-	-	43,158,658.16	43,158,658.16
资产总计	2,401,449,404.91	-	-	-	7,984,927,308.13	10,386,376,713.04
负债	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	14,193,724.23	14,193,724.23
应付托管费	-	-	-	-	2,365,620.69	2,365,620.69
应付交易费用	-	-	-	-	11,657,408.84	11,657,408.84
其他负债	-	-	-	-	97,352.50	97,352.50
负债总计	-	-	-	-	28,314,106.26	28,314,106.26
利率敏感度缺口	2,401,449,404.91	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有港股通标的股票，故资产收益受港币汇率变动影响。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	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（2015年6月30日）
	港币相对人民币升值 5%	173,709,195.02
	港币相对人民币贬值 5%	-173,709,195.02

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素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股票和债券，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。

本基金的投资组合比例范围为：本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%），权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，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%。

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 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	7,843,410,355.91	75.72
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	7,843,410,355.91	75.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。	
分析	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（2015 年 6 月 30 日）
	“沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%”上升 5%	433,366,320.28
	“沪深 300 指数×45%+恒生指数×45%”下降 5%	-433,366,320.28

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**6.4.14.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需作说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项**(1) 公允价值**

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 7,222,289,471.96 元，划分为第二层次的余额为人民币 621,120,883.95 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于特殊事项停牌的股票，本基金从进行估值调整之日起将相关股票公允价值所属层次从第一层次转入第二层次，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃的情况，本基金根据估值调整中输入值的可观察性和重要性以及对公允价值的影响程度，于本报告期内将相关债券的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。如上述影响因素消失，债券公允价值所属层次则从第二层次转入第一层次。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,843,410,355.91	75.52
	其中：股票	7,843,410,355.91	75.52
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,400,062,929.16	23.11
7	其他各项资产	142,903,427.97	1.38
8	合计	10,386,376,713.04	100.00

注：1、银行存款和结算备付金合计中包含定期存款人民币 1,100,000,000.00 元。

2、权益投资中：

上海证券交易所投资金额 1,321,167,332.29 元，占基金总资产比例 12.72%

深圳证券交易所投资金额 3,091,217,781.39 元，占基金总资产比例 29.76%

香港交易所投资金额 3,431,025,242.23 元，占基金总资产比例 33.03%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,400,610,434.13	23.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,205,994.45	0.55
E	建筑业	303,435,826.13	2.93
F	批发和零售业	205,343,275.20	1.98
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	455,253,174.38	4.40
J	金融业	328,439,775.57	3.17
K	房地产业	305,669,638.18	2.95
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	90,381,913.72	0.87
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	266,045,081.92	2.57
S	综合	3,431,025,242.23	33.12
	合计	7,843,410,355.91	75.72

注：上表按行业分类的股票投资组合 A 至 R 行中仅包括在上海证券交易所和深圳证券交易所上市交易的股票；表中的 S 行为本基金在香港交易所投资的股票。

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	占基金资产净值比例（%）
1	0700	腾讯控股	3,220,500	392,894,452.72	3.79
2	0939	建设银行	60,695,000	338,881,962.37	3.27
3	0388	香港交易所	1,477,200	318,726,131.73	3.08
4	3988	中国银行	70,773,000	281,293,969.47	2.72

5	002415	海康威视	5,977,929	267,811,219.20	2.59
6	0941	中国移动	3,121,000	244,279,242.14	2.36
7	1109	华润置地	11,452,000	227,133,717.26	2.19
8	300291	华录百纳	5,935,367	224,119,457.92	2.16
9	002081	金螳螂	7,937,127	223,747,610.13	2.16
10	002285	世联行	10,245,798	219,669,909.12	2.12
11	601318	中国平安	2,569,241	210,523,607.54	2.03
12	002251	步步高	8,415,708	205,343,275.20	1.98
13	002174	游族网络	2,117,735	196,441,098.60	1.90
14	0392	北京控股	4,148,500	190,894,859.93	1.84
15	2601	中国太保	6,362,000	186,637,489.70	1.80
16	300011	鼎汉技术	5,187,888	183,754,992.96	1.77
17	600100	同方股份	8,156,269	171,200,086.31	1.65
18	000977	浪潮信息	5,681,696	167,894,116.80	1.62
19	600276	恒瑞医药	3,681,792	163,987,015.68	1.58
20	600804	鹏博士	5,446,958	162,646,165.88	1.57
21	1044	恒安国际	2,122,500	154,159,257.17	1.49
22	600525	长园集团	7,464,669	153,548,241.33	1.48
23	002475	立讯精密	4,169,590	140,973,837.90	1.36
24	2628	中国人寿	5,004,000	133,184,399.85	1.29
25	300207	欣旺达	5,426,366	131,426,584.52	1.27
26	002303	美盈森	3,379,151	127,664,324.78	1.23
27	600587	新华医疗	2,499,267	125,363,232.72	1.21
28	002572	索菲亚	3,200,656	123,641,341.28	1.19
29	600643	爱建股份	7,046,861	117,893,984.53	1.14
30	002294	信立泰	3,805,891	108,848,482.60	1.05
31	0165	中国光大控股	4,702,000	99,746,389.52	0.96
32	6808	高鑫零售	17,984,500	98,995,640.68	0.96
33	2607	上海医药	5,761,000	98,132,735.74	0.95
34	0861	神州数码	10,958,000	90,391,014.45	0.87
35	300070	碧水源	1,852,468	90,381,913.72	0.87
36	0551	裕元集团	4,414,500	90,340,224.03	0.87
37	0425	敏实集团	6,604,000	90,306,380.83	0.87
38	300075	数字政通	2,322,906	87,550,327.14	0.85
39	1929	周大福	13,076,400	86,209,823.16	0.83
40	600240	华业地产	5,635,631	85,999,729.06	0.83
41	000090	天健集团	3,286,112	79,688,216.00	0.77
42	300032	金龙机电	2,287,847	78,518,909.04	0.76
43	1299	友邦保险	1,799,200	72,007,505.93	0.70

44	002470	金正大	3,296,755	71,572,551.05	0.69
45	300020	银江股份	2,540,421	69,861,577.50	0.67
46	0005	汇丰控股	1,100,000	60,853,090.65	0.59
47	000690	宝新能源	4,522,213	57,205,994.45	0.55
48	300170	汉得信息	2,350,878	57,102,826.62	0.55
49	000651	格力电器	862,685	55,125,571.50	0.53
50	1099	国药控股	2,006,400	54,509,101.73	0.53
51	002465	海格通信	1,688,460	54,351,527.40	0.52
52	600570	恒生电子	463,060	51,885,873.00	0.50
53	1999	敏华控股	7,949,600	47,708,110.17	0.46
54	600129	太极集团	1,549,652	42,181,527.44	0.41
55	300251	光线传媒	1,683,760	41,925,624.00	0.40
56	0001	长和	400,000	35,929,071.60	0.35
57	600177	雅戈尔	1,966,905	35,915,685.30	0.35
58	000917	电广传媒	846,200	26,079,884.00	0.25
59	1193	华润燃气	1,000,000	18,138,030.00	0.18
60	1113	长实地产	200,000	10,141,524.60	0.10
61	1828	大昌行集团	2,999,000	9,531,116.80	0.09
62	300486	东杰智能	16,092	207,104.04	0.00
63	300482	万孚生物	7,942	182,983.68	0.00
64	002771	真视通	6,251	126,520.24	0.00
65	601166	兴业银行	1,286	22,183.50	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	0700	腾讯控股	417,987,589.91	4.04
2	0939	建设银行	372,955,576.25	3.60
3	0388	香港交易所	347,057,460.37	3.35
4	3988	中国银行	306,698,420.68	2.96
5	0941	中国移动	282,427,326.69	2.73
6	002081	金螳螂	253,656,193.73	2.45
7	0392	北京控股	242,925,847.56	2.35
8	1109	华润置地	241,582,689.96	2.33

9	002285	世联行	238,051,404.92	2.30
10	601318	中国平安	229,682,001.75	2.22
11	2601	中国太保	215,133,782.17	2.08
12	002251	步步高	203,450,780.10	1.96
13	0728	中国电信	201,039,537.97	1.94
14	600804	鹏博士	199,601,472.59	1.93
15	0762	中国联通	198,438,694.42	1.92
16	002415	海康威视	194,070,060.96	1.87
17	000651	格力电器	191,219,466.31	1.85
18	002174	游族网络	190,108,938.43	1.84
19	300291	华录百纳	186,145,956.17	1.80
20	000977	浪潮信息	183,968,927.43	1.78

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	190,571,114.70	1.84
2	0762	中国联通	168,601,602.64	1.63
3	0728	中国电信	162,903,396.00	1.57
4	600837	海通证券	143,935,745.95	1.39
5	601166	兴业银行	137,567,604.95	1.33
6	2688	新奥能源	137,565,630.72	1.33
7	600104	上汽集团	121,688,397.17	1.17
8	000625	长安汽车	117,120,915.40	1.13
9	1193	华润燃气	116,378,810.81	1.12
10	000069	华侨城A	109,637,193.57	1.06
11	600535	天士力	103,224,069.22	1.00
12	600585	海螺水泥	102,847,186.34	0.99
13	600617	国新能源	100,824,265.00	0.97
14	000732	泰禾集团	97,662,183.50	0.94
15	600340	华夏幸福	83,909,125.63	0.81
16	601992	金隅股份	81,177,602.40	0.78
17	601668	中国建筑	79,353,117.39	0.77
18	300032	金龙机电	64,618,843.13	0.62
19	000333	美的集团	52,687,181.72	0.51

20	300170	汉得信息	51,244,631.24	0.49
----	--------	------	---------------	------

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	10,986,294,083.40
卖出股票收入（成交）总额	2,464,569,544.21

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

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。

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。

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。

合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,386,475.75
2	应收证券清算款	97,528,675.34
3	应收股利	43,158,658.16
4	应收利息	829,618.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,903,427.97

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300291	华录百纳	224,119,457.92	2.16	因重大事项停牌

§ 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
199,341	55,239.99	76,925,737.70	0.70%	10,934,668,682.93	99.30%

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	75,546.91	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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015年4月15日) 基金份额总额	11,011,594,420.63
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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)	-

本报告期末基金份额总额	11,011,594,420.63
-------------	-------------------

§ 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

1、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 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，同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。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。

2、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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

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

本基金本期未变更会计师事务所。

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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
国信证券股份 有限公司	1	1,504,678,641.07	11.19%	1,285,574.06	11.03%	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	1	809,824,720.23	6.02%	737,264.34	6.32%	-
兴业证券股份 有限公司	1	2,255,581,755.24	16.77%	2,053,482.86	17.62%	-
长城证券股份 有限公司	2	2,026,707,420.57	15.07%	1,688,435.34	14.48%	-
长江证券股份 有限公司	1	1,676,644,357.65	12.47%	1,482,237.85	12.71%	-
申银万国证券 股份有限公司	1	1,354,208,212.02	10.07%	1,172,427.78	10.06%	-
招商证券股份 有限公司	1	990,023,717.74	7.36%	901,318.31	7.73%	-
安信证券股份 有限公司	2	82,702,106.22	0.61%	75,291.68	0.65%	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	2,748,195,958.92	20.43%	2,261,376.62	19.40%	-

注：1、本基金与景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金共用交易单元。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
第一创业证券 股份有限公司						
中国国际金融 股份有限公司						
北京高华证券 有限责任公司						
广发证券股份 有限公司						
中信建投证券 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	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年1月23日
2	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年3月20日
3	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年3月20日
4	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年3月20日
5	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年3月20日
6	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年3月20日
7	关于景顺长城沪港深精选股票型证券	中国证券报, 上海	2015年3月25日

	投资基金新增中国建设银行为委托销售机构的公告	证券报, 证券时报, 基金管理人网站	
8	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金在直销网上平台实施认购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
9	关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金新增兴业证券为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 8 日
10	关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金新增中国农业银行为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 9 日
11	关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 16 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇付金融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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 8 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增川财证券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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券为销售机构并	中国证券报, 上海证券报, 证券时报,	2015 年 6 月 4 日

	开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	基金管理人网站	
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年6月12日
17	景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年6月30日
18	关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金2015年下半年主要投资市场节假日暂停申购赎回安排的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年6月30日
19	关于景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2015年6月30日

§ 11 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、中国证监会批准景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪港深精选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。

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
2015 年 8 月 29 日