

# 景顺长城量化新动力股票型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 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：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2017 年 8 月 24 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城量化新动力股票
场内简称	无
基金主代码	001974
交易代码	001974
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 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	321,941,280.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在有效控制风险的前提下，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	<p>1、资产配置策略：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略：本基金主要采用超额收益模型、风险模型、成本模型三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略：出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index) 收益率*95%+商业银行活期存款利率 (税后)*5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于较高预期风险、较高

	预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
--	-----------------------------------------------

### 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	杨皞阳	郭明
	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

### 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.igwfm.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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	8,068,455.40
本期利润	29,880,751.16
加权平均基金份额本期利润	0.1691
本期基金份额净值增长率	17.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1864
期末基金资产净值	404,120,723.81
期末基金份额净值	1.255

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

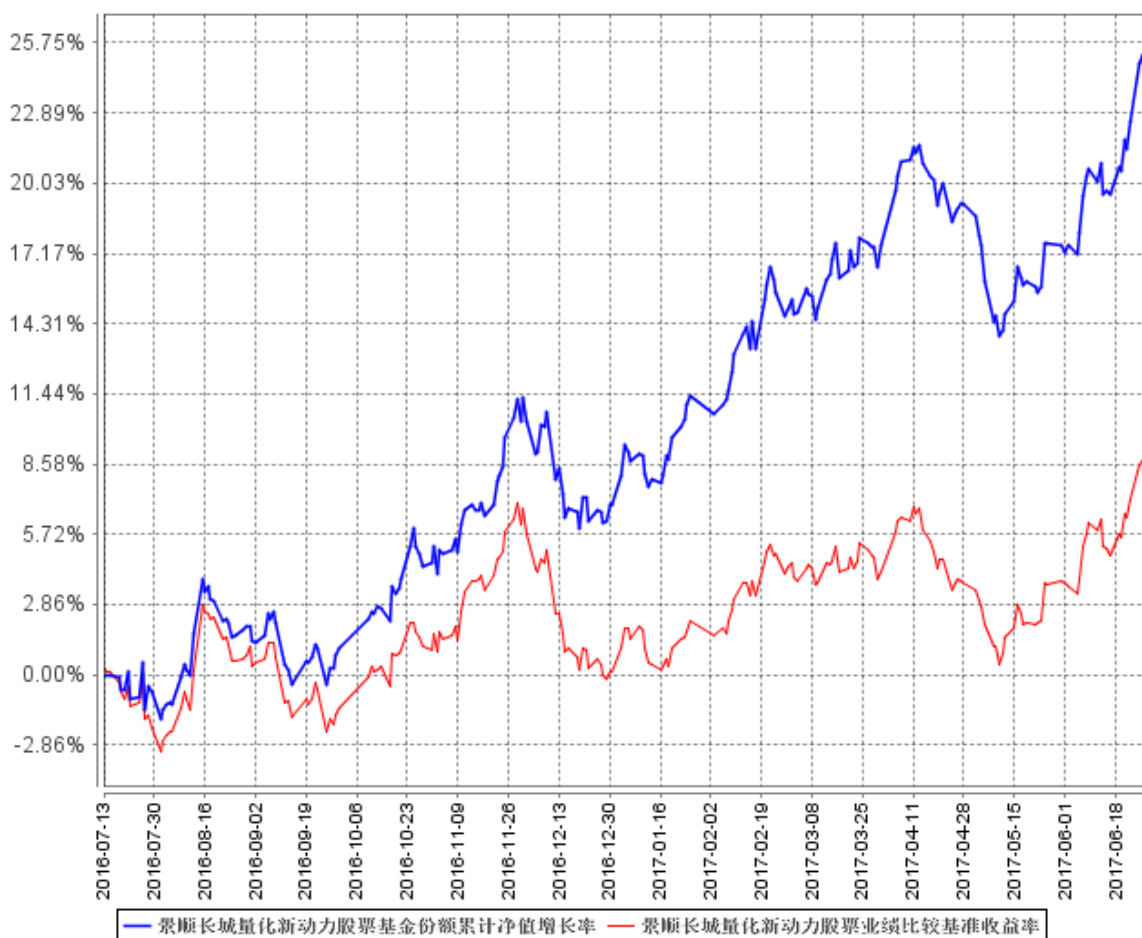
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.81%	0.69%	4.66%	0.59%	2.15%	0.10%
过去三个月	6.81%	0.70%	4.25%	0.58%	2.56%	0.12%
过去六个月	17.40%	0.65%	8.49%	0.54%	8.91%	0.11%
自基金合同生效起至今	25.50%	0.69%	8.65%	0.62%	16.85%	0.07%

### 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：股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，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 2016 年 7 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日（2016 年 7 月 13 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2017年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理67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、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、景顺长城交易型货币市场基金、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、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、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、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利定期开放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、景顺长城景盈汇利债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理、量化及ETF投资部投资总监	2016年7月13日	-	14年	经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，担任量化及ETF投资部投资总监；自2013年10月起担任基金经理。

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



2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化新动力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 5 次，为公司旗下三只指数基金因指数成份股调整而发生的反向交易以及量化基金、指数增强基金根据基金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。投资组合间临近交易日虽然存在同向交易和反向交易行为，但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现本基金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

2017 年上半年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 7.6%，增速维持稳定，经济整体呈现向好迹象。6 月份 PMI 指数 51.7，景气指数回落后有所反弹；PPI 同比上涨 5.5%，环比下降 0.2%，同比涨幅缩小；CPI 同比上涨 1.5%，涨幅略有上升，通胀预期维持平稳。货币政策基调防风险，市场流动性继续维持中性。6 月份 M2 增速回落至 9.4%，M1 增速也回落至 15%，货币供应继续保持较紧的状态；6 月末外汇储备 3.1 万亿美元，逐月都有所增加，汇率受到内外部环境因素影响稳

步上升。房地产行业今年以来出现分化。6 月末的 70 个大中城市新建住宅价格指数同比上涨 9.4%，环比上涨 0.7%，涨幅维持平稳略有回落；三四线城市地产销售景气度大幅好于一二线城市，截至 6 月的全国房地产销售面积累计同比上升 16.1%，销售额累计同比上升 21.5%。

2017 年上半年市场继续出现分化行情，沪深 300 指数继续大幅跑赢创业板指数，业绩稳定的蓝筹股和部分具备竞争优势的白马成长股持续受到市场关注，靠并购和外延增长的高估值股票继续表现不好。6 月份以后风格趋于平衡。

组合仍主要以选股作为主要的收益来源，在价值和成长之间保持平衡，重点关注估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹以及白马成长股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为 17.40%，业绩比较基准收益率为 8.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面方面，中国国内出口依然向好，消费平稳，投资边际有走弱尚在预计范围内，基本面 2 季度平稳过渡。从工业企业利润上看，经济复苏企业盈利改善依然有韧性，然而产成品库存已开始筑顶回落表明本轮补库存已经基本完成，工业生产有向下压力。叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升，预计至 4 季度经济将面临小幅的下行压力。

国际方面，美联储加息落地，缩表已在路上，整体预计依然为渐进式，对于金融市场的影响相对平缓。欧洲方面表达退出 QE 的可能性，至今年年底全球主要央行或均转为收缩。

展望下半年，A 股指数可能以波动为主，缺乏趋势性行情，但不排除阶段性上行的可能。风格上，大概率会从大盘龙头股逐渐扩散到估值和成长相对均衡的中盘股。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，关注经济小幅下行压力的传导，在股市波动中以自下而上选股为主以期获得长期投资回报。

#### 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、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，本基金托管人在对景顺长城量化新动力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，景顺长城量化新动力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量化新动力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。本报告期内，景顺长城量化新动力股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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量化新动力股票型证券投资基金 2017 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：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	27,052,682.84	6,682,617.57
结算备付金	1,259,269.07	321,807.17
存出保证金	95,863.43	79,049.54
交易性金融资产	382,641,845.61	88,958,511.47
其中：股票投资	382,641,845.61	88,958,511.47
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,319.53	1,393.70
应收股利	-	-
应收申购款	3,303,767.41	17,198.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	414,358,747.89	96,060,577.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
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	5,568,398.84	-
应付赎回款	3,335,630.24	585,561.43
应付管理人报酬	446,870.70	132,683.23
应付托管费	74,478.45	22,113.87
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	635,589.92	255,002.12

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	177,055.93	56,408.58
负债合计	10,238,024.08	1,051,769.23
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	321,941,280.70	88,863,611.59
未分配利润	82,179,443.11	6,145,196.75
所有者权益合计	404,120,723.81	95,008,808.34
负债和所有者权益总计	414,358,747.89	96,060,577.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.255 元，基金份额总额 321,941,280.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化新动力股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	32,939,460.29
1.利息收入	62,346.31
其中：存款利息收入	62,346.31
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）	10,711,463.94
其中：股票投资收益	8,027,259.76
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	2,684,204.18
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	21,812,295.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	353,354.28
<b>减：二、费用</b>	3,058,709.13
1. 管理人报酬	1,515,454.63
2. 托管费	252,575.84





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

景顺长城量化新动力股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 1537 号《关于准予景顺长城量化新动力股票型证券投资基金注册的批复》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《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 219,177,460.00 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(2016)第 891 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化新动力股票型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 219,324,726.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,266.66 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化新动力股票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国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持性证券、股指期货以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%。权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率 X 95%+商业银行活期存款利率(税后) X 5%。

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 2017 年 8 月 24 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》、《景顺长城量化新动力股票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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 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。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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、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

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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,515,454.63
其中：支付销售机构的客户维护费	570,088.13

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 1.5%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 X1.5%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	252,575.84

注：支付基金托管人中国工商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 X0.25%/当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末未投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	27,052,682.84	51,766.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

## 6.4.9.2 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 数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注	
601919	中远海控	2017 年 5 月	重大事项	5.41	2017 年 7 月 26 日	5.89	1,563,407	9,226,000.41	8,458,031.87	-

		月 17 日	停牌							
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大事项 停牌	16.28	2017 年 8 月 2 日	16.48	166,300	2,437,237.85	2,707,364.00	-

注：本基金截至 2017 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 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 371,352,766.64 元，属于第二层次的余额为 11,289,078.97 元，无属于第三层次的余额。（2016 年 12 月 31 日：本基金属于第一层次的余额为 87,758,180.03 元，属于第二层次的余额为 1,200,331.44 元，无属于第三层次的余额。）

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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 2017 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(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	382,641,845.61	92.35
	其中：股票	382,641,845.61	92.35
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	28,311,951.91	6.83
7	其他各项资产	3,404,950.37	0.82
8	合计	414,358,747.89	100.00

### 7.2 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	-	-
B	采矿业	23,872,338.00	5.91
C	制造业	172,612,109.32	42.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,238,311.00	3.03
E	建筑业	11,113,506.00	2.75
F	批发和零售业	10,799,759.40	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	23,539,679.87	5.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,581,099.02	1.88
J	金融业	87,037,408.20	21.54
K	房地产业	24,981,352.80	6.18
L	租赁和商务服务业	8,866,282.00	2.19
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-



P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	382,641,845.61	94.69

### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	357,200	17,720,692.00	4.38
2	601288	农业银行	3,803,400	13,387,968.00	3.31
3	000725	京东方 A	3,014,100	12,538,656.00	3.10
4	600900	长江电力	785,700	12,084,066.00	2.99
5	002142	宁波银行	608,400	11,742,120.00	2.91
6	000338	潍柴动力	861,822	11,376,050.40	2.82
7	600816	安信信托	831,100	11,294,649.00	2.79
8	600519	贵州茅台	23,605	11,138,019.25	2.76
9	600741	华域汽车	415,300	10,066,872.00	2.49
10	601899	紫金矿业	2,782,500	9,543,975.00	2.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 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	000725	京东方 A	13,645,497.00	14.36
2	601318	中国平安	13,005,535.44	13.69
3	601288	农业银行	12,929,128.00	13.61
4	600900	长江电力	10,925,779.35	11.50
5	600663	陆家嘴	10,547,873.28	11.10
6	000338	潍柴动力	10,488,361.31	11.04

7	600741	华域汽车	10,219,410.79	10.76
8	600519	贵州茅台	9,994,491.22	10.52
9	600312	平高电气	9,894,853.37	10.41
10	601899	紫金矿业	9,778,403.00	10.29
11	601328	交通银行	9,559,803.00	10.06
12	601919	中远海控	9,404,029.39	9.90
13	002142	宁波银行	9,286,507.55	9.77
14	600325	华发股份	9,194,625.26	9.68
15	601877	正泰电器	8,913,767.18	9.38
16	600377	宁沪高速	8,470,918.23	8.92
17	000415	渤海金控	8,442,234.87	8.89
18	600009	上海机场	8,390,841.25	8.83
19	600816	安信信托	8,309,048.62	8.75
20	000800	一汽轿车	8,196,038.85	8.63
21	600036	招商银行	8,031,331.45	8.45
22	601818	光大银行	7,503,873.00	7.90
23	601600	中国铝业	7,174,554.95	7.55
24	600690	青岛海尔	6,907,294.49	7.27
25	601898	中煤能源	6,738,784.71	7.09
26	000488	晨鸣纸业	6,238,436.22	6.57
27	600018	上港集团	6,220,329.00	6.55
28	600015	华夏银行	6,069,844.00	6.39
29	600383	金地集团	6,064,110.00	6.38
30	603993	洛阳钼业	5,931,531.00	6.24
31	600566	济川药业	5,853,139.96	6.16
32	600309	万华化学	5,612,593.75	5.91
33	603198	迎驾贡酒	5,345,545.52	5.63
34	000963	华东医药	5,344,873.17	5.63
35	002354	天神娱乐	4,939,671.36	5.20
36	601689	拓普集团	4,887,641.44	5.14
37	000528	柳工	4,792,857.69	5.04
38	600153	建发股份	4,768,911.17	5.02
39	601669	中国电建	4,757,481.00	5.01
40	000686	东北证券	4,738,198.80	4.99
41	000921	海信科龙	4,718,268.41	4.97
42	600166	福田汽车	4,473,841.00	4.71

43	002482	广田集团	4,462,670.26	4.70
44	601100	恒立液压	4,304,540.45	4.53
45	600188	兖州煤业	4,234,871.19	4.46
46	600808	马钢股份	4,171,638.46	4.39
47	601628	中国人寿	4,112,136.01	4.33
48	002601	龙蟠佰利	3,994,951.50	4.20
49	601225	陕西煤业	3,966,755.52	4.18
50	600565	迪马股份	3,906,180.00	4.11
51	600529	山东药玻	3,884,467.00	4.09
52	601009	南京银行	3,781,280.39	3.98
53	601939	建设银行	3,742,275.00	3.94
54	600031	三一重工	3,533,286.00	3.72
55	002032	苏泊尔	3,493,743.98	3.68
56	600183	生益科技	3,391,895.38	3.57
57	601186	中国铁建	3,325,262.92	3.50
58	601390	中国中铁	3,241,124.00	3.41
59	600098	广州发展	3,210,414.45	3.38
60	601636	旗滨集团	3,189,449.00	3.36
61	000776	广发证券	3,187,383.49	3.35
62	002558	巨人网络	3,157,614.80	3.32
63	600699	均胜电子	3,088,284.60	3.25
64	000418	小天鹅A	3,083,424.00	3.25
65	600409	三友化工	3,077,586.27	3.24
66	002543	万和电气	3,029,363.30	3.19
67	002146	荣盛发展	2,937,300.00	3.09
68	600160	巨化股份	2,935,383.33	3.09
69	600867	通化东宝	2,882,322.62	3.03
70	601231	环旭电子	2,856,574.96	3.01
71	000959	首钢股份	2,803,576.00	2.95
72	300324	旋极信息	2,693,528.52	2.84
73	000910	大亚圣象	2,651,533.00	2.79
74	600282	南钢股份	2,644,142.00	2.78
75	002508	老板电器	2,625,154.24	2.76
76	002589	瑞康医药	2,587,176.56	2.72
77	600643	爱建集团	2,553,817.81	2.69
78	601699	潞安环能	2,456,111.46	2.59

79	600507	方大特钢	2,356,751.33	2.48
80	600438	通威股份	2,290,447.96	2.41
81	601800	中国交建	2,185,627.00	2.30
82	600258	首旅酒店	2,135,965.14	2.25
83	601088	中国神华	2,133,430.72	2.25
84	002244	滨江集团	2,123,385.00	2.24
85	300316	晶盛机电	2,088,384.41	2.20
86	002180	纳思达	2,035,711.31	2.14
87	603883	老百姓	1,982,661.76	2.09
88	600516	方大炭素	1,975,198.79	2.08
89	600061	国投安信	1,937,240.00	2.04
90	601233	桐昆股份	1,916,949.26	2.02

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	600309	万华化学	8,593,527.84	9.05
2	601898	中煤能源	8,084,266.20	8.51
3	600377	宁沪高速	7,916,307.08	8.33
4	601600	中国铝业	7,414,190.19	7.80
5	600663	陆家嘴	6,915,666.95	7.28
6	601009	南京银行	5,486,641.00	5.78
7	601225	陕西煤业	5,116,987.00	5.39
8	000776	广发证券	4,847,741.14	5.10
9	600015	华夏银行	4,807,959.33	5.06
10	600036	招商银行	4,801,643.00	5.05
11	601689	拓普集团	4,778,316.31	5.03
12	002508	老板电器	4,726,734.17	4.98
13	600153	建发股份	4,645,549.27	4.89
14	002146	荣盛发展	4,387,883.00	4.62
15	600056	中国医药	4,369,561.05	4.60
16	002482	广田集团	4,178,718.50	4.40
17	000921	海信科龙	4,014,647.98	4.23
18	600166	福田汽车	3,987,116.00	4.20
19	000686	东北证券	3,919,473.59	4.13

20	600019	宝钢股份	3,881,548.08	4.09
21	600900	长江电力	3,871,012.00	4.07
22	600699	均胜电子	3,867,393.65	4.07
23	601318	中国平安	3,544,217.00	3.73
24	601390	中国中铁	3,393,444.00	3.57
25	601939	建设银行	3,362,716.30	3.54
26	600104	上汽集团	3,334,915.42	3.51
27	601988	中国银行	3,306,011.00	3.48
28	600312	平高电气	3,025,980.00	3.19
29	600098	广州发展	2,909,942.00	3.06
30	000651	格力电器	2,831,111.00	2.98
31	000725	京东方 A	2,778,394.72	2.92
32	600867	通化东宝	2,768,464.24	2.91
33	000910	大亚圣象	2,642,452.97	2.78
34	601088	中国神华	2,626,732.25	2.76
35	600064	南京高科	2,602,335.00	2.74
36	600061	国投安信	2,531,419.00	2.66
37	300324	旋极信息	2,473,079.89	2.60
38	000709	河钢股份	2,276,684.00	2.40
39	002493	荣盛石化	2,264,297.18	2.38
40	601877	正泰电器	2,247,683.07	2.37
41	601998	中信银行	2,195,202.03	2.31
42	300267	尔康制药	2,161,202.98	2.27
43	002244	滨江集团	2,142,936.68	2.26
44	600438	通威股份	2,115,809.04	2.23
45	600236	桂冠电力	2,090,637.66	2.20
46	002050	三花智控	2,074,509.06	2.18
47	000401	冀东水泥	2,071,891.34	2.18
48	000898	鞍钢股份	2,043,833.00	2.15
49	600258	首旅酒店	2,022,993.48	2.13

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	543,534,833.86
卖出股票收入（成交）总额	279,691,055.24

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率和交易成本。

## 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	95,863.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,319.53
5	应收申购款	3,303,767.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,404,950.37

**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中不存在流通受限的情况。

## § 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
14,033	22,941.73	136,230,252.01	42.32%	185,711,028.69	57.68%

### 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	794,798.17	0.25%

### 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（2016年7月13日）基金份额总额	219,324,726.66
本报告期期初基金份额总额	88,863,611.59
本报告期基金总申购份额	315,371,052.16
减：本报告期基金总赎回份额	82,293,383.05
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	321,941,280.70

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

在本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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	
方正证券股	2	260,301,704.18	31.72%	242,417.94	31.72%	新增1个

份有限公司						
国金证券股 份有限公司	1	167,635,917.61	20.42%	156,123.51	20.43%	-
恒泰证券股 份有限公司	1	149,533,483.83	18.22%	139,260.07	18.22%	新增
民生证券股 份有限公司	1	103,261,974.61	12.58%	96,168.05	12.58%	-
海通证券股 份有限公司	1	48,737,158.07	5.94%	45,388.14	5.94%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	32,008,376.89	3.90%	29,809.36	3.90%	-
平安证券股 份有限公司	1	27,567,792.16	3.36%	25,673.93	3.36%	-
招商证券股 份有限公司	1	19,775,753.03	2.41%	18,417.51	2.41%	-
兴业证券股 份有限公司	1	11,564,585.12	1.41%	10,770.20	1.41%	-
天风证券股 份有限公司	1	356,330.00	0.04%	331.83	0.04%	-
瑞信方正证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	新增
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	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	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 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
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信方正证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

## § 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。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日