

景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资 基金 2017 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 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。

基金托管人中国农业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。

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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城中小板创业板精选股票
场内简称	无
基金主代码	000586
交易代码	000586
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	402,151,216.05 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选中小板及创业板市场中具备高成长特性的股票，充分把握经济结构转型格局下新兴行业高速增长带来的收益，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置: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。</p> <p>2、股票投资策略:本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，通过景顺长城“股票研究数据库（SRD）”中的标准分析模板对中小板及创业板中上市公司的基本面和估值水平进行鉴别，制定股票买入名单。</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	创业板综合指数 × 45%+中小板综合指数× 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。
--	-------------------

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	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		杨光裕	周慕冰

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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-35,817,295.77
本期利润	-47,886,700.97
加权平均基金份额本期利润	-0.1187
本期加权平均净值利润率	-7.23%
本期基金份额净值增长率	-7.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-38,313,850.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0953
期末基金资产净值	633,815,542.44
期末基金份额净值	1.576
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	57.60%

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。

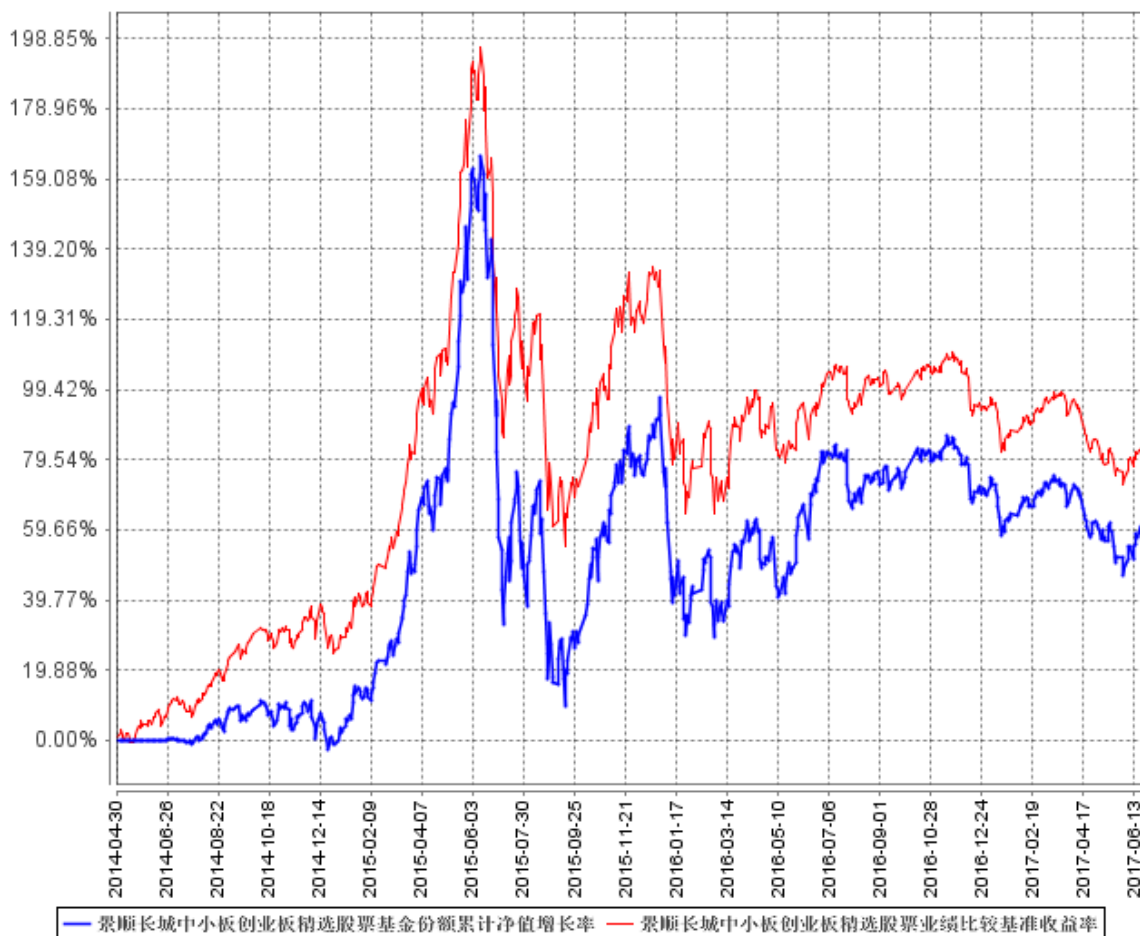
3.2 基金净值表现

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	3.75%	1.49%	3.70%	0.92%	0.05%	0.57%
过去三个月	-5.85%	1.33%	-5.11%	0.93%	-0.74%	0.40%
过去六个月	-7.24%	1.17%	-5.69%	0.88%	-1.55%	0.29%

过去一年	-13.02%	1.18%	-9.15%	0.91%	-3.87%	0.27%
过去三年	56.97%	2.47%	65.78%	1.92%	-8.81%	0.55%
自基金合同生效起至今	57.60%	2.40%	82.88%	1.88%	-25.28%	0.52%

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，其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%，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，本基金保留的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 2014 年 4 月 30 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		
李孟海	本基金的基金经理	2015 年 3 月 3 日	-	9 年	工学硕士。曾任职于天相投资顾问公司投资分析部，担任小组主管。2010 年 8 月加入本公司，担任研究员职务；自 2015 年 3 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、《景顺长城中小板创业板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

上半年，经济数据好于市场预期，GDP 同比增速达到 6.9%，经济 L 型的韧性较强，主要原因是海外经济弱复苏带动出口好转，制造业投资增速企稳回升，以及地产投资增速超预期，CPI 维持低位，PPI 同比高位回落。海外方面，美国经济增速小幅低于预期，特朗普效应有所消退，但仍处于复苏通道，欧洲经济则持续好转。

为配合金融去杠杆，上半年货币政策中性并阶段性偏紧，资金面波动较大，资金成本整体上行，银行间回购 7 天加权平均利率由 2016 年 4 季度的 2.81% 上升至 2017 年上半年的 3.22%，期间汇率保持稳定。海外方面，美联储上半年进行两次加息，并提出缩表计划，欧洲则逐步退出刺激政策，海外央行的货币政策整体以收紧或逐步退出宽松为主。

2017 年上半年，上证综指上涨 2.9%，上证 50、沪深 300 分别上涨 11.5%、10.8%；中小板上涨 7.3%、创业板下跌 7.3%。股票市场呈现结构性行情，具有涨价预期的家电、食品饮料等涨幅较

大，分别上涨 29.7%、19.1%；农林牧渔、纺织服装仍处于下跌态势，分别下跌 15.4%、13.5%。

上半年，本基金保持较高仓位，尽管承受着风格转换的压力，但仍坚定看好未来的中小优质成长股。重点配置在新能源汽车、消费升级、OLED、进口替代等相关领域；行业配置方面，重点配置在计算机、电子、化工、汽车等行业。在新能源汽车领域，重点看好锂电池模组上游零部件、充电站运营、电机控制系统等细分子领域。

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-7.24%，业绩比较基准收益率为-5.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新一轮财政整顿以及加强金融监管成为常态，我们预计下半年经济可能面临回落压力，但韧性较强。下半年 PPI 涨幅料将会回落，对工业企业利润的增长形成一定的压制，考虑到工业行业产能出清，全球需求回暖，PPI 涨幅回落会比较缓慢。因此，我们预计下半年工业企业利润增速会有所回落，但回落的幅度也相对有限。海外货币政策收紧趋势较明显，美国缩表欧洲宽松退出，这将一定程度上制约国内货币政策放松的空间。

金融监管常态化，经济增长平稳、汇率保持稳定，股票市场调整压力不大，值得关注的是 2016 年启动的供给侧结构性改革和行政化去产能加速了国企占比高的行业产能出清，传统行业竞争格局优化，集中度提升，利润向龙头企业集中的趋势日益明显，各行业竞争力提升的龙头公司将持续受到关注。

上半年，大市值消费股、各行业大市值龙头股表现强势。进入下半年，金融去杠杆带来的极度恐慌情绪有望边际上修复，从而更加有利于中小市值优质成长股的表现。

对于行业走势，我们最为看好新能源汽车、OLED、消费升级等领域的投资机会。同时，我们也积极布局公共安全、智能汽车等具备长期成长性的相关领域。

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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有关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：景顺长城中小板创业板精选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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	40,635,412.83	62,695,909.94
结算备付金		188,609.85	1,114,622.83
存出保证金		237,843.85	340,770.66
交易性金融资产	6.4.7.2	600,253,509.01	615,894,793.55
其中：股票投资		600,253,509.01	615,894,793.55
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,540.82	11,623.97
应收股利		-	-
应收申购款		846,265.98	771,718.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		642,170,182.34	680,829,439.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付赎回款		6,393,353.87	4,354,815.36
应付管理人报酬		773,805.01	948,228.44
应付托管费		128,967.52	158,038.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	768,057.44	863,523.45

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	290,456.06	180,595.82
负债合计		8,354,639.90	6,505,201.17
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	402,151,216.05	396,871,514.63
未分配利润	6.4.7.10	231,664,326.39	277,452,723.45
所有者权益合计		633,815,542.44	674,324,238.08
负债和所有者权益总计		642,170,182.34	680,829,439.25

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.576 元，基金份额总额 402,151,216.05 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中小板创业板精选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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-40,065,519.28	-11,043,379.88
1.利息收入		236,575.01	115,853.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	236,575.01	115,853.89
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）		-29,003,717.70	1,304,931.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-31,362,754.56	76,160.92
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	2,359,036.86	1,228,770.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,069,405.20	-14,381,067.01
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	771,028.61	1,916,902.02
减：二、费用		7,821,181.69	4,722,364.16

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,926,572.38	3,206,840.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	821,095.40	534,473.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,886,820.51	796,929.16
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	186,693.40	184,121.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,886,700.97	-15,765,744.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,886,700.97	-15,765,744.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中小板创业板精选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		
	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）	396,871,514.63	277,452,723.45	674,324,238.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-47,886,700.97	-47,886,700.97
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）	5,279,701.42	2,098,303.91	7,378,005.33
其中：1.基金申购款	146,242,533.27	93,393,116.07	239,635,649.34
2.基金赎回款	-140,962,831.85	-91,294,812.16	-232,257,644.01
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）	402,151,216.05	231,664,326.39	633,815,542.44
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	246,377,467.50	228,653,424.59	475,030,892.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,765,744.04	-15,765,744.04
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)	104,836,697.91	72,127,713.03	176,964,410.94
其中：1.基金申购款	329,054,214.13	195,181,945.76	524,236,159.89
2.基金赎回款	-224,217,516.22	-123,054,232.73	-347,271,748.95
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)	351,214,165.41	285,015,393.58	636,229,558.99

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	_____ 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

景顺长城中小板创业板精选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[2014]245号《关于核准景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城中小板创业板精选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281,467,138.67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(2014)第192号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金合同》于2014年4月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为281,574,294.37

份,其中认购资金利息折合 107,155.70 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《景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 80%-95%投资于股票资产,其中投资于中小板及创业板的上市公司股票不低于非现金基金资产的 80%,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,本基金保留的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创业板综合指数 X 45% + 中小板综合指数 X 45% + 中证全债指数 X 10%。

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》、《景顺长城中小板创业板精选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相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 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 6 月 30 日止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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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[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) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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。自 2016 年 5 月 1 日起，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 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	40,635,412.83
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	40,635,412.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	654,537,193.80	600,253,509.01	-54,283,684.79
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	654,537,193.80	600,253,509.01	-54,283,684.79

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 2017年6月30日
应收活期存款利息	8,367.56
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	76.41
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.55
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	96.30
合计	8,540.82

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	768,057.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	768,057.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,978.17
预提费用	283,477.89
合计	290,456.06

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	396,871,514.63	396,871,514.63
本期申购	146,242,533.27	146,242,533.27
本期赎回(以“-”号填列)	-140,962,831.85	-140,962,831.85
- 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	402,151,216.05	402,151,216.05

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	-1,953,603.36	279,406,326.81	277,452,723.45
本期利润	-35,817,295.77	-12,069,405.20	-47,886,700.97
本期基金份额交易产生的变动数	-542,951.00	2,641,254.91	2,098,303.91
其中：基金申购款	-8,453,251.51	101,846,367.58	93,393,116.07
基金赎回款	7,910,300.51	-99,205,112.67	-91,294,812.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,313,850.13	269,978,176.52	231,664,326.39

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	活期存款利息收入
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	8,672.11
其他	3,375.76
合计	236,575.01

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	612,546,803.15
减：卖出股票成本总额	643,909,557.71
买卖股票差价收入	-31,362,754.56

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期的债券投资收益项目发生额为零。

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,359,036.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,359,036.86

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	-12,069,405.20
——股票投资	-12,069,405.20
——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	-12,069,405.20
----	----------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	661,101.79
基金转换费收入	109,926.82
合计	771,028.61

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

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，其中赎回费部分中归入转出基金资产的比例按持有期间递减，且不低于赎回费总额的 25%。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,886,820.51
银行间市场交易费用	-
合计	1,886,820.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,765.71
债券托管账户维护费	200.00
银行划款手续费	2,915.51
其他费用	100.00
合计	186,693.40

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，本基金无需要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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和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

本基金本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,926,572.38	3,206,840.15
其中：支付销售机构的客户维护费	2,001,496.80	1,293,126.45

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	821,095.40	534,473.33

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/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

本基金本期及上年度可比期间均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

本基金基金管理人本期和上年度可比期间均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和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	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国农业银行	40,635,412.83	224,527.14	46,826,058.22	107,040.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017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
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	-
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	-
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	-

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
002766	索菱股份	2017年5月15日	重大事项停牌	35.57	2017年8月15日	16.75	905,788	32,064,238.48	32,218,879.16	-

002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事项停牌	23.63	2017 年 7 月 4 日	22.46	610,000	15,869,976.90	14,414,300.00	-
--------	------	-----------------	--------	-------	----------------	-------	---------	---------------	---------------	---

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。

6.4.12.3 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，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末，本基金未持有债券投资。（上期末：同）

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理岗设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	40,635,412.83	-	-	-	-	-	40,635,412.83
结算备付金	188,609.85	-	-	-	-	-	188,609.85
存出保证金	237,843.85	-	-	-	-	-	237,843.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	600,253,509.01	600,253,509.01
应收利息	-	-	-	-	-	8,540.82	8,540.82
应收申购款	9.94	-	-	-	-	846,256.04	846,265.98
资产总计	41,061,876.47	-	-	-	-	601,108,305.87	642,170,182.34
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,393,353.87	6,393,353.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	773,805.01	773,805.01
应付托管费	-	-	-	-	-	128,967.52	128,967.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	768,057.44	768,057.44
其他负债	-	-	-	-	-	290,456.06	290,456.06
负债总计	-	-	-	-	-	8,354,639.90	8,354,639.90
利率敏感度缺口	41,061,876.47	-	-	-	-	-	-
上年度末 2016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	62,695,909.94	-	-	-	-	62,695,909.94
结算备付金	1,114,622.83	-	-	-	-	1,114,622.83
存出保证金	340,770.66	-	-	-	-	340,770.66
交易性金融资产	-	-	-	-	615,894,793.55	615,894,793.55
应收利息	-	-	-	-	11,623.97	11,623.97
应收申购款	-	-	-	-	771,718.30	771,718.30
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	64,151,303.43	-	-	-	616,678,135.82	680,829,439.25
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	4,354,815.36	4,354,815.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	948,228.44	948,228.44
应付托管费	-	-	-	-	158,038.10	158,038.10
应付交易费用	-	-	-	-	863,523.45	863,523.45
其他负债	-	-	-	-	180,595.82	180,595.82
负债总计	-	-	-	-	6,505,201.17	6,505,201.17
利率敏感度缺口	64,151,303.43	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券投资，因此市场利率的变动对于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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进

行跟踪和控制。

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	600,253,509.01	94.70	615,894,793.55	91.34
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	600,253,509.01	94.70	615,894,793.55	91.34

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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深300指数上升5%	28,896,680.35	46,538,001.59
	沪深300指数下降5%	-28,896,680.35	-46,538,001.59

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 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 553,546,220.54 元，属于第二层次的余额为 46,707,288.47 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 470,510,852.88 元，第二层次 145,383,940.67 元，无第三层次)。

(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：未持有)。

(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、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	600,253,509.01	93.47
	其中：股票	600,253,509.01	93.47
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	40,824,022.68	6.36
7	其他各项资产	1,092,650.65	0.17
8	合计	642,170,182.34	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	-	-
C	制造业	486,421,633.68	76.74
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	-	-
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	113,831,875.33	17.96
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	600,253,509.01	94.70

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	占基金资产净值比例（%）
1	600884	杉杉股份	2,849,837	46,936,815.39	7.41
2	300124	汇川技术	1,679,934	42,905,514.36	6.77
3	002126	银轮股份	3,320,415	33,403,374.90	5.27
4	002850	科达利	356,001	32,321,330.79	5.10
5	002766	索菱股份	905,788	32,218,879.16	5.08
6	300567	精测电子	401,077	32,058,084.61	5.06
7	300568	星源材质	752,849	31,958,440.05	5.04
8	002643	万润股份	2,159,950	31,880,862.00	5.03
9	300473	德尔股份	656,901	31,268,487.60	4.93
10	300616	尚品宅配	229,954	31,172,564.24	4.92
11	300033	同花顺	500,000	31,105,000.00	4.91
12	300429	强力新材	1,199,861	29,888,537.51	4.72
13	300523	辰安科技	741,744	29,669,760.00	4.68
14	300025	华星创业	3,400,513	26,762,037.31	4.22
15	300436	广生堂	707,774	26,619,380.14	4.20
16	002690	美亚光电	999,907	19,178,216.26	3.03
17	002223	鱼跃医疗	700,093	16,578,202.24	2.62
18	002025	航天电器	610,000	14,414,300.00	2.27
19	300047	天源迪科	1,060,000	13,366,600.00	2.11
20	300552	万集科技	393,928	12,920,838.40	2.04
21	002371	北方华创	499,905	11,957,727.60	1.89
22	300236	上海新阳	423,183	11,925,296.94	1.88
23	300362	天翔环境	562,372	9,588,442.60	1.51
24	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01

25	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
26	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
27	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
28	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
29	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
30	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
31	300671	富满电子	942	7,639.62	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	300429	强力新材	42,939,279.97	6.37
2	300473	德尔股份	41,267,372.10	6.12
3	300523	辰安科技	38,148,659.28	5.66
4	300567	精测电子	35,300,336.93	5.23
5	002544	杰赛科技	33,786,072.34	5.01
6	300568	星源材质	33,784,871.50	5.01
7	300033	同花顺	33,776,521.32	5.01
8	002850	科达利	33,533,538.39	4.97
9	002766	索菱股份	32,064,238.48	4.76
10	002126	银轮股份	31,861,296.21	4.72
11	002643	万润股份	31,625,263.40	4.69
12	300616	尚品宅配	31,599,824.70	4.69
13	300436	广生堂	27,787,526.54	4.12
14	000901	航天科技	25,393,310.51	3.77
15	600038	中直股份	22,256,947.00	3.30
16	002690	美亚光电	19,976,140.79	2.96
17	300463	迈克生物	18,255,148.18	2.71
18	300552	万集科技	16,525,356.82	2.45
19	002077	大港股份	15,877,791.12	2.35
20	002223	鱼跃医疗	15,476,903.42	2.30
21	002371	北方华创	14,189,558.80	2.10
22	300236	上海新阳	13,705,243.30	2.03

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	002664	信质电机	45,397,947.24	6.73
2	002547	春兴精工	44,050,913.59	6.53
3	300068	南都电源	38,967,752.33	5.78
4	002491	通鼎互联	38,237,966.88	5.67
5	002214	大立科技	36,505,746.89	5.41
6	002519	银河电子	36,292,009.05	5.38
7	300425	环能科技	34,732,068.62	5.15
8	300407	凯发电气	30,645,568.59	4.54
9	002544	杰赛科技	26,101,683.67	3.87
10	002686	亿利达	24,052,396.47	3.57
11	300496	中科创达	23,899,966.69	3.54
12	600038	中直股份	23,652,962.91	3.51
13	000901	航天科技	23,103,837.23	3.43
14	300424	航新科技	22,393,691.30	3.32
15	002580	圣阳股份	22,387,100.32	3.32
16	300433	蓝思科技	22,299,586.80	3.31
17	300463	迈克生物	19,242,517.00	2.85
18	002195	二三四五	16,848,931.57	2.50
19	300190	维尔利	14,989,659.94	2.22
20	002077	大港股份	13,896,023.68	2.06

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	640,337,678.37
卖出股票收入（成交）总额	612,546,803.15

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作为交易标的。

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	237,843.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,540.82
5	应收申购款	846,265.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,092,650.65

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	002766	索菱股份	32,218,879.16	5.08	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
32,310	12,446.65	14,751,272.29	3.67%	387,399,943.76	96.33%

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	37,624.91	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（2014年4月30日）基金份额总额	281,574,294.37
本报告期期初基金份额总额	396,871,514.63
本报告期基金总申购份额	146,242,533.27
减：本报告期基金总赎回份额	140,962,831.85
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	402,151,216.05

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	364,143,599.73	29.15%	339,128.03	29.15%	-

份有限公司						
恒泰证券股 份有限公司	1	307,683,338.02	24.63%	286,545.69	24.63%	-
兴业证券股 份有限公司	1	205,667,130.98	16.46%	191,537.69	16.46%	-
光大证券股 份有限公司	2	140,667,276.46	11.26%	131,005.09	11.26%	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	50,744,694.83	4.06%	47,258.25	4.06%	-
海通证券股 份有限公司	1	49,991,761.80	4.00%	46,557.55	4.00%	-
东方证券股 份有限公司	1	39,989,959.24	3.20%	37,243.26	3.20%	-
民生证券股 份有限公司	1	31,886,175.57	2.55%	29,695.38	2.55%	-
东兴证券股 份有限公司	1	25,167,811.03	2.01%	23,439.17	2.01%	-
国信证券股 份有限公司	1	17,148,290.36	1.37%	15,970.45	1.37%	-
中泰证券股 份有限公司	1	15,344,498.29	1.23%	14,290.33	1.23%	-
招商证券股 份有限公司	2	848,980.86	0.07%	790.68	0.07%	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 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更。

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	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

公司						
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 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	景顺长城中小板创业板精选股票 型证券投资基金 2016 年第 4 季度 报告	中国证券报, 上海证 券报, 证券时报, 基 金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增北京肯特瑞财 富投资管理有限公司为销售机构 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	2017 年 1 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金参加北京肯特瑞财 富投资管理有限公司基金申购及 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	2017 年 1 月 20 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于 旗下部分基金新增上海朝阳永续 基金销售有限公司为销售机构并	中国证券报, 上海证 券报, 证券时报, 基 金管理人网站	2017 年 1 月 20 日

	开通基金转换业务和参加基金申购费率优惠活动的公告		
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易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	2017年2月3日
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易“精明i定投”PE区间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年2月6日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉兴银行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	2017年2月17日
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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年2月23日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广州农商行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	2017年2月23日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司基金转换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	2017年2月24日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金“定期定额投资业务”并参加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	2017年3月2日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金通过好买基金开通基金“定期定额投资业务”并参加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	2017年3月10日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司基金申购及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	2017年3月22日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月22日

	金转换业务的公告		
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 24 日
16	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
17	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇丰银行为代理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	2017 年 3 月 30 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券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	2017 年 4 月 10 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中银国际证券有限责任公司开通基金“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	2017 年 4 月 17 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海云湾投资管理有限公司基金申购及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	2017 年 4 月 17 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海云湾投资管理有限公司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	2017 年 4 月 17 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司基金转换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	2017 年 4 月 17 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 17 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财金融信息服务有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日

	公告		
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财金融信息服务有限公司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	2017年4月21日
27	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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年4月22日
28	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年4月24日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加武汉市伯嘉基金销售有限公司基金申购及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	2017年4月26日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江南农商行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	2017年4月27日
31	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统建行直联渠道(含建行网银、建行快捷)基金交易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	2017年5月4日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳秋实惠智财富投资管理有限公司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	2017年5月11日
33	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳秋实惠智财富投资管理有限公司基金申购及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	2017年5月11日
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广州农商行基金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	2017年5月25日
35	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在深圳市金斧子基金销售有限公司定期定额申	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年5月31日

	购起点金额的公告		
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司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	2017年6月2日
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大河财富基金销售有限公司基金申购及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	2017年6月2日
38	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年6月9日
39	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年6月14日
40	景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年6月14日
41	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年6月30日

§ 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中小板创业板精选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中小板创业板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

2017年8月26日