

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 3 月 3 日（基金合同生效日）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.....	12
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56

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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数
场内简称	无
基金主代码	003318
交易代码	003318
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 3 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	135,524,048.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证 500 行业中性低波动指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨崑阳	朱萍
	联系电话	0755-82370388	021-61618888
	电子邮箱	investor@igwfm.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4008888606	95528
传真		0755-22381339	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		518048	200120
法定代表人		杨光裕	高国富

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3月3日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	925,124.33
本期利润	-1,794,805.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0094
本期加权平均净值利润率	-0.96%
本期基金份额净值增长率	-0.11%
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	-139,202.85
期末可供分配基金份额利润	-0.0010
期末基金资产净值	135,384,845.57
期末基金份额净值	0.9989
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	-0.11%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

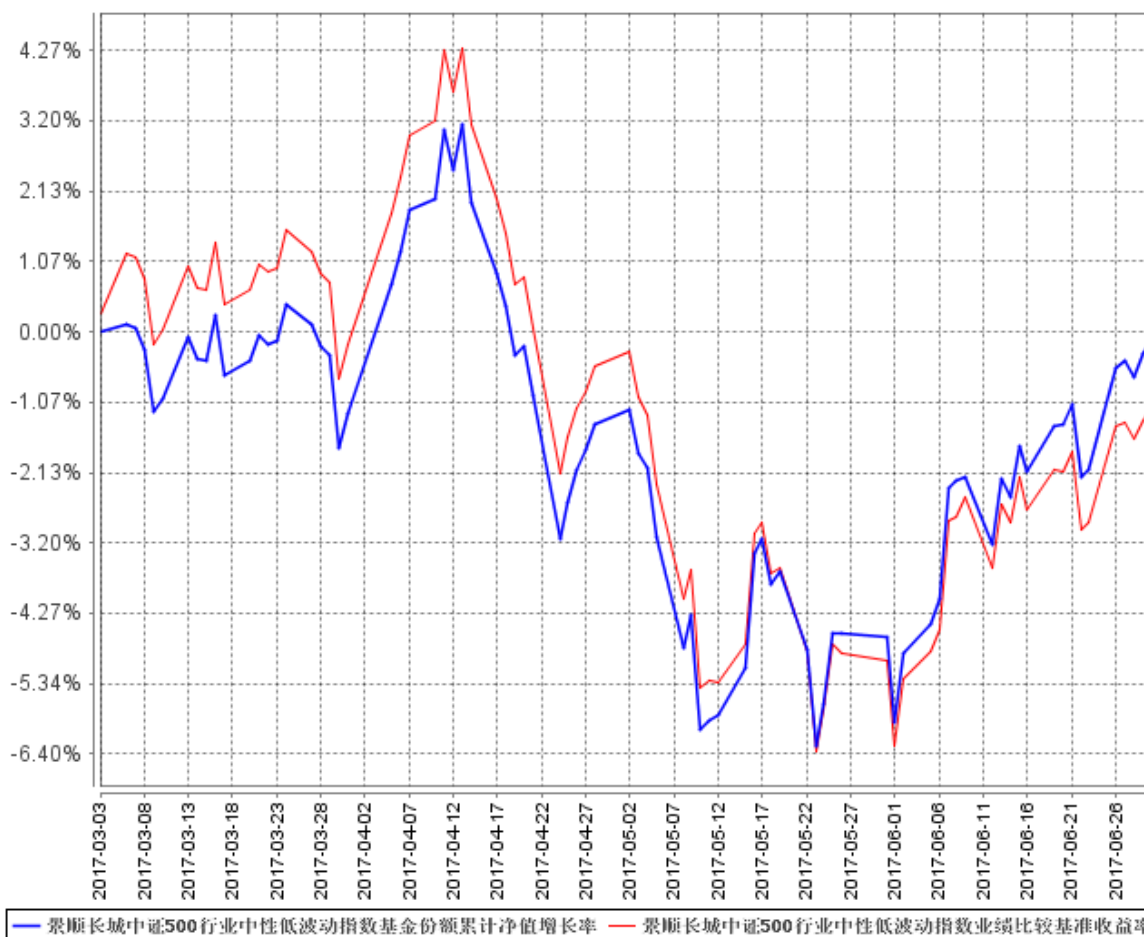
5、本基金基金合同生效日为 2017 年 03 月 03 日。

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	4.75%	0.79%	4.07%	0.79%	0.68%	0.00%
过去三个月	1.15%	0.91%	-0.95%	0.91%	2.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.11%	0.83%	-1.12%	0.84%	1.01%	-0.01%

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：本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2017 年 3 月 3 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（2017 年 3 月 3 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		
徐喻军	本基金的 基金经理	2017年3月3日	-	7年	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员职务；自2014年4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、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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。6 月制造业 PMI 指数 51.7，在出口的拉动下出现短期回升；6 月 PPI 同比上涨 5.5%，环比下降 0.2%，同比涨幅缩小；6 月 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。2017 年上半年市场出现分化行情，沪深 300 指数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表现不好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至本报告期末，本基金份额净值增长率为-0.11%，业绩比较基准收益率为-1.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面仍可能延续企稳态势，国内出口依然向好，消费平稳，经济复苏，企业盈利依然有改善的空间，但随着本轮补库存的完成，叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升，预计经济将面临小幅的下行压力。

本基金采用完全复制中证 500 行业中性低波动指数的方法进行组合管理。报告期内，本基金根据申赎情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

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。风险管理人員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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	8,887,505.55
结算备付金		59,243.95
存出保证金		100,940.20
交易性金融资产	6.4.7.2	127,947,882.00
其中：股票投资		127,947,882.00
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	5,973.91
应收股利		-
应收申购款		13,250.24
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		137,014,795.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 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		1,130,397.90
应付赎回款		42,770.92
应付管理人报酬		69,300.82
应付托管费		13,860.16
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	211,530.26

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	162,090.22
负债合计		1,629,950.28
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	135,524,048.42
未分配利润	6.4.7.10	-139,202.85
所有者权益合计		135,384,845.57
负债和所有者权益总计		137,014,795.85

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9989 元，基金份额总额 135,524,048.42 份。

2、本基金基金合同生效日为 2017 年 03 月 03 日。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-686,774.57
1.利息收入		156,468.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	156,468.26
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）		1,789,335.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	537,041.93
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	1,252,293.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,719,930.03
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	87,351.61

减：二、费用		1,108,031.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	307,419.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,483.86
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	559,808.44
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	179,319.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,794,805.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,794,805.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)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）	200,250,263.71	-	200,250,263.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,794,805.70	-1,794,805.70
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）	-64,726,215.29	1,655,602.85	-63,070,612.44
其中：1.基金申购款	6,958,968.75	-148,301.51	6,810,667.24
2.基金赎回款	-71,685,184.04	1,803,904.36	-69,881,279.68
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）	135,524,048.42	-139,202.85	135,384,845.57

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：

<u>许义明</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
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

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金(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[2016]1781 号文《关于准予景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2017 年 2 月 6 日至 2017 年 2 月 28 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(2017)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 2017 年 3 月 3 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为人民币 200,182,368.91 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,894.80 元,以上实收基金合计为人民币 200,250,263.71 元,折合 200,250,263.71 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“上海浦东发展银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为中证 500 行业中性低波动指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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 3 月 3 日(基金合同生效日)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 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 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 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、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(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其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按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；应收款项和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，以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时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其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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，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现在是可执行的；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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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，其中场外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，场内基金

份额持有人只能选择现金分红。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场外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。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《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》的规定，自2015年3月24日起，本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

6.4.6 税项

印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）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，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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，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；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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。

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。

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，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。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,887,505.55
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,887,505.55

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	130,667,812.03	127,947,882.00	-2,719,930.03
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	130,667,812.03	127,947,882.00	-2,719,930.03

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告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	5,909.02
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	24.03
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	40.86
合计	5,973.91

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告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	211,530.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	211,530.26

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	161.20
预提费用	111,929.02
应付指数使用费	50,000.00
合计	162,090.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	200,250,263.71	200,250,263.71
本期申购	6,958,968.75	6,958,968.75
本期赎回(以“-”号填列)	-71,685,184.04	-71,685,184.04
- 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	135,524,048.42	135,524,048.42

注：1、本期申购份额包含基金转入份额；本期赎回份额包含基金转出份额；

2、本基金合同于 2017 年 3 月 3 日生效。设立时募集的扣除认购费用后的实收基金为人民币 200,182,368.91 元，在募集期间产生的利息为人民币 67,894.80 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,250,263.71 元，折合成 200,250,263.71 份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	925,124.33	-2,719,930.03	-1,794,805.70
本期基金份额交易产生的变动数	-508,826.56	2,164,429.41	1,655,602.85
其中：基金申购款	14,282.16	-162,583.67	-148,301.51

基金赎回款	-523,108.72	2,327,013.08	1,803,904.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,297.77	-555,500.62	-139,202.85

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	154,077.61
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	1,987.70
其他	402.95
合计	156,468.26

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	140,998,730.37
减：卖出股票成本总额	140,461,688.44
买卖股票差价收入	537,041.93

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,252,293.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,252,293.66

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 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,719,930.03
——股票投资	-2,719,930.03
——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	-2,719,930.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	87,103.55
基金转换费收入	248.06
合计	87,351.61

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 3 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	559,808.44

银行间市场交易费用	-
合计	559,808.44

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017 年6月30日
审计费用	23,564.38
信息披露费	88,364.64
指数使用费	66,111.11
银行划款手续费	879.43
其他费用	400.00
合计	179,319.56

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，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其他需要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、注册登记人、基金销售机构
上海浦东发展银行	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
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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**

本基金于本报告期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

本基金本报告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

本基金本报告期末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
	2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	307,419.27
其中：支付销售机构的客户维护费	1,887.43

注：基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	61,483.86

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金于本报告期与关联方未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期末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

本基金的其他关联方于本报告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 2017年3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	8,887,505.55	154,077.61

注：本基金的活期银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，并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

本基金于本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

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

本基金于本报告期末未进行利润分配。

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	-
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	-

6.4.12.2 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
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	96,700	1,369,978.00	1,574,276.00	-
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事项停牌	20.69	-	-	72,000	1,512,664.48	1,489,680.00	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事项停牌	7.55	-	-	191,500	1,639,133.47	1,445,825.00	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事项停牌	8.14	2017 年 8 月 14 日	9.57	129,900	1,180,292.00	1,057,386.00	-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.04	-	-	73,200	664,695.47	661,728.00	-

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涉及的财务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%。

于本期末，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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，并按照合同约定的到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	8,887,505.55	-	-	-	-	-	8,887,505.55
结算备付金	59,243.95	-	-	-	-	-	59,243.95
存出保证金	100,940.20	-	-	-	-	-	100,940.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	127,947,882.00	127,947,882.00
应收利息	-	-	-	-	-	5,973.91	5,973.91
应收申购款	-	-	-	-	-	13,250.24	13,250.24
资产总计	9,047,689.70	-	-	-	-	127,967,106.15	137,014,795.85
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,130,397.90	1,130,397.90
应付赎回款	-	-	-	-	-	42,770.92	42,770.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	69,300.82	69,300.82
应付托管费	-	-	-	-	-	13,860.16	13,860.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	211,530.26	211,530.26
其他负债	-	-	-	-	-	162,090.22	162,090.22
负债总计	-	-	-	-	-	1,629,950.28	1,629,950.28
利率敏感度缺口	9,047,689.70	-	-	-	-	-	-

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

本基金于本期末均未持有债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对期末基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	127,947,882.00	94.51
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	127,947,882.00	94.51

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）
	沪深300指数上升5%	5,236,737.81
	沪深300指数下降5%	-5,236,737.81

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人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划分为第一层次的余额为人民币 121,595,303.90 元，划分为第二层次的余额为人民币 6,352,578.10 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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(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。

财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 24 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	127,947,882.00	93.38
	其中：股票	127,947,882.00	93.38
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	8,946,749.50	6.53
7	其他各项资产	120,164.35	0.09
8	合计	137,014,795.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	1,470,480.00	1.09
B	采矿业	2,333,853.00	1.72
C	制造业	80,348,161.10	59.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,134,465.00	3.05
E	建筑业	4,047,053.00	2.99
F	批发和零售业	6,017,991.00	4.45
G	交通运输、仓储和邮政业	3,378,094.00	2.50
H	住宿和餐饮业	609,750.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,666,097.00	5.66
J	金融业	1,574,276.00	1.16
K	房地产业	7,684,056.00	5.68
L	租赁和商务服务业	2,372,226.90	1.75
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	873,180.00	0.64
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	1,393,138.00	1.03
S	综合	884,205.00	0.65
	合计	124,787,026.00	92.17

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	1,860,456.38	1.37
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	1,300,399.62	0.96
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	3,160,856.00	2.33

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	002583	海能达	126,900	2,041,821.00	1.51

2	600776	东方通信	267,000	1,810,260.00	1.34
3	600643	爱建集团	96,700	1,574,276.00	1.16
4	601717	郑煤机	191,500	1,445,825.00	1.07
5	600642	申能股份	182,100	1,147,230.00	0.85
6	600143	金发科技	186,800	1,126,404.00	0.83
7	002004	华邦健康	141,900	1,111,077.00	0.82
8	600572	康恩贝	159,300	1,102,356.00	0.81
9	002422	科伦药业	66,500	1,098,580.00	0.81
10	002254	泰和新材	80,900	1,075,970.00	0.79
11	002128	露天煤业	129,900	1,057,386.00	0.78
12	600835	上海机电	49,600	1,048,544.00	0.77
13	600329	中新药业	57,200	1,035,892.00	0.77
14	000979	中弘股份	394,200	1,032,804.00	0.76
15	000830	鲁西化工	149,400	1,030,860.00	0.76
16	603077	和邦生物	201,500	1,025,635.00	0.76
17	600282	南钢股份	270,600	1,003,926.00	0.74
18	600201	生物股份	28,100	999,517.00	0.74
19	600811	东方集团	152,500	994,300.00	0.73
20	002179	中航光电	31,830	992,777.70	0.73
21	600894	广日股份	83,700	991,008.00	0.73
22	600586	金晶科技	197,900	967,731.00	0.71
23	600422	昆药集团	85,300	967,302.00	0.71
24	600808	马钢股份	272,900	966,066.00	0.71
25	300146	汤臣倍健	70,200	964,548.00	0.71
26	600600	青岛啤酒	27,300	958,230.00	0.71
27	002250	联化科技	66,600	952,380.00	0.70
28	600064	南京高科	62,300	940,730.00	0.69
29	002588	史丹利	121,500	934,335.00	0.69
30	000988	华工科技	63,600	927,924.00	0.69
31	600664	哈药股份	159,700	927,857.00	0.69
32	000999	华润三九	29,100	923,925.00	0.68
33	002308	威创股份	70,700	922,635.00	0.68
34	600176	中国巨石	84,020	922,539.60	0.68
35	600284	浦东建设	85,200	913,344.00	0.67
36	002244	滨江集团	131,700	911,364.00	0.67
37	600582	天地科技	198,500	911,115.00	0.67
38	002002	鸿达兴业	116,200	909,846.00	0.67
39	000028	国药一致	11,100	897,990.00	0.66
40	002701	奥瑞金	140,400	897,156.00	0.66

41	000513	丽珠集团	13,100	892,110.00	0.66
42	600022	山东钢铁	431,840	889,590.40	0.66
43	002093	国脉科技	100,700	886,160.00	0.65
44	600805	悦达投资	120,300	884,205.00	0.65
45	600312	平高电气	64,200	882,108.00	0.65
46	002366	台海核电	18,800	881,908.00	0.65
47	600388	龙净环保	56,600	878,998.00	0.65
48	600017	日照港	194,900	877,050.00	0.65
49	002690	美亚光电	45,700	876,526.00	0.65
50	002317	众生药业	70,500	875,610.00	0.65
51	600557	康缘药业	52,600	873,686.00	0.65
52	600292	远达环保	81,000	873,180.00	0.64
53	601012	隆基股份	50,900	870,390.00	0.64
54	000816	智慧农业	116,700	868,248.00	0.64
55	300147	香雪制药	84,400	866,788.00	0.64
56	002261	拓维信息	73,800	864,198.00	0.64
57	300039	上海凯宝	118,400	860,768.00	0.64
58	000732	泰禾集团	51,500	859,020.00	0.63
59	600736	苏州高新	121,300	857,591.00	0.63
60	600171	上海贝岭	84,100	855,297.00	0.63
61	000089	深圳机场	91,100	851,785.00	0.63
62	002603	以岭药业	48,700	850,302.00	0.63
63	600026	中远海能	127,700	846,651.00	0.63
64	300297	蓝盾股份	76,600	838,770.00	0.62
65	600580	卧龙电气	122,800	837,496.00	0.62
66	600563	法拉电子	16,900	835,029.00	0.62
67	600219	南山铝业	244,100	827,499.00	0.61
68	600307	酒钢宏兴	289,700	825,645.00	0.61
69	000729	燕京啤酒	122,600	823,872.00	0.61
70	002064	华峰氨纶	170,800	823,256.00	0.61
71	600587	新华医疗	46,300	823,214.00	0.61
72	000039	中集集团	45,600	822,168.00	0.61
73	002463	沪电股份	179,800	818,090.00	0.60
74	603000	人民网	62,100	817,857.00	0.60
75	600039	四川路桥	196,600	817,856.00	0.60
76	601928	凤凰传媒	83,500	814,960.00	0.60
77	000488	晨鸣纸业	63,100	813,990.00	0.60
78	000528	柳工	94,100	813,024.00	0.60
79	002375	亚厦股份	91,100	811,701.00	0.60

80	000685	中山公用	74,000	810,300.00	0.60
81	000926	福星股份	66,200	807,640.00	0.60
82	002410	广联达	42,900	806,520.00	0.60
83	000078	海王生物	133,200	803,196.00	0.59
84	600611	大众交通	145,400	802,608.00	0.59
85	300043	星辉娱乐	97,700	802,117.00	0.59
86	300274	阳光电源	72,100	799,589.00	0.59
87	002063	远光软件	76,600	798,172.00	0.59
88	600316	洪都航空	49,200	790,644.00	0.58
89	002414	高德红外	43,200	790,560.00	0.58
90	300032	金龙机电	56,600	789,570.00	0.58
91	600859	王府井	48,800	788,120.00	0.58
92	600160	巨化股份	65,300	785,559.00	0.58
93	002439	启明星辰	42,200	784,920.00	0.58
94	600651	飞乐音响	91,500	775,005.00	0.57
95	002309	中利集团	61,700	771,867.00	0.57
96	002315	焦点科技	30,900	770,646.00	0.57
97	600881	亚泰集团	151,700	770,636.00	0.57
98	603188	亚邦股份	44,100	769,104.00	0.57
99	600108	亚盛集团	178,200	768,042.00	0.57
100	002572	索菲亚	18,700	766,700.00	0.57
101	000726	鲁泰 A	64,600	766,156.00	0.57
102	000667	美好置业	231,300	765,603.00	0.57
103	600496	精工钢构	157,400	760,242.00	0.56
104	600094	大名城	98,900	758,563.00	0.56
105	000031	中粮地产	99,700	750,741.00	0.55
106	002242	九阳股份	38,100	749,427.00	0.55
107	000581	威孚高科	28,800	745,920.00	0.55
108	300001	特锐德	44,500	745,820.00	0.55
109	002663	普邦股份	137,000	743,910.00	0.55
110	600059	古越龙山	79,400	734,450.00	0.54
111	002028	思源电气	46,000	733,240.00	0.54
112	000727	华东科技	258,600	731,838.00	0.54
113	002223	鱼跃医疗	30,900	731,712.00	0.54
114	000027	深圳能源	108,300	728,859.00	0.54
115	600426	华鲁恒升	61,960	727,410.40	0.54
116	600635	大众公用	133,400	727,030.00	0.54
117	600862	中航高科	75,000	726,750.00	0.54
118	600138	中青旅	34,500	726,570.00	0.54

119	000598	兴蓉环境	128,300	721,046.00	0.53
120	000021	深科技	84,000	720,720.00	0.53
121	600978	宜华生活	71,500	718,575.00	0.53
122	600517	置信电气	93,600	708,552.00	0.52
123	000998	隆平高科	31,900	702,438.00	0.52
124	603001	奥康国际	37,200	698,988.00	0.52
125	600597	光明乳业	54,800	698,700.00	0.52
126	600418	江淮汽车	66,100	697,355.00	0.52
127	002489	浙江永强	107,700	687,126.00	0.51
128	600166	福田汽车	240,200	682,168.00	0.50
129	600220	江苏阳光	196,800	675,024.00	0.50
130	000587	金洲慈航	45,200	673,480.00	0.50
131	001696	宗申动力	88,700	671,459.00	0.50
132	000417	合肥百货	81,300	670,725.00	0.50
133	000061	农产品	73,200	661,728.00	0.49
134	000552	靖远煤电	185,300	661,521.00	0.49
135	000572	海马汽车	127,400	658,658.00	0.49
136	600694	大商股份	16,800	654,696.00	0.48
137	600648	外高桥	34,200	633,384.00	0.47
138	601929	吉视传媒	180,500	624,530.00	0.46
139	002011	盾安环境	54,900	623,115.00	0.46
140	600348	阳泉煤业	90,700	614,946.00	0.45
141	600754	锦江股份	22,500	609,750.00	0.45
142	002191	劲嘉股份	63,200	591,552.00	0.44
143	600757	长江传媒	77,400	578,178.00	0.43
144	600826	兰生股份	31,800	575,580.00	0.43
145	002018	华信国际	81,600	558,960.00	0.41
146	002344	海宁皮城	66,500	553,280.00	0.41
147	002268	卫士通	28,200	474,324.00	0.35
148	002400	省广股份	53,630	430,648.90	0.32

7.3.2 期末积极投资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	002399	海普瑞	72,000	1,489,680.00	1.10
2	002544	杰赛科技	56,700	1,292,760.00	0.95
3	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.04

4	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.03
5	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
6	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.02
7	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
8	002881	美格智能	989	22,608.54	0.02
9	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
10	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
11	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
12	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
13	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
14	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
15	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
16	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
17	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
18	603331	百达精工	999	9,620.37	0.01
19	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
20	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01

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	002583	海能达	2,837,728.88	2.10
2	600776	东方通信	2,658,790.99	1.96
3	300136	信维通信	2,168,964.79	1.60
4	600282	南钢股份	2,126,909.00	1.57
5	600522	中天科技	2,042,753.00	1.51
6	002595	豪迈科技	1,987,337.00	1.47
7	000028	国药一致	1,848,687.00	1.37
8	601717	郑煤机	1,830,016.00	1.35
9	600664	哈药股份	1,805,078.00	1.33
10	002004	华邦健康	1,796,279.01	1.33
11	000830	鲁西化工	1,766,704.31	1.30
12	002588	史丹利	1,747,443.32	1.29
13	002701	奥瑞金	1,718,683.98	1.27

14	002422	科伦药业	1,663,561.75	1.23
15	600894	广日股份	1,662,745.85	1.23
16	600426	华鲁恒升	1,656,361.00	1.22
17	600642	申能股份	1,652,874.10	1.22
18	600572	康恩贝	1,638,342.11	1.21
19	600600	青岛啤酒	1,635,392.44	1.21
20	002342	巨力索具	1,630,992.80	1.20

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	300136	信维通信	2,556,730.40	1.89
2	002342	巨力索具	2,462,936.00	1.82
3	600874	创业环保	2,308,567.00	1.71
4	600522	中天科技	2,109,600.13	1.56
5	002508	老板电器	1,994,215.29	1.47
6	601000	唐山港	1,908,068.00	1.41
7	600717	天津港	1,763,004.00	1.30
8	002595	豪迈科技	1,742,130.05	1.29
9	600056	中国医药	1,740,937.48	1.29
10	002635	安洁科技	1,737,559.85	1.28
11	000600	建投能源	1,664,184.00	1.23
12	600062	华润双鹤	1,577,181.00	1.16
13	601231	环旭电子	1,556,327.00	1.15
14	002573	清新环境	1,466,421.81	1.08
15	600809	山西汾酒	1,465,093.00	1.08
16	000418	小天鹅 A	1,441,406.13	1.06
17	300115	长盈精密	1,412,049.00	1.04
18	600970	中材国际	1,381,987.00	1.02
19	600266	北京城建	1,306,798.45	0.97
20	000825	太钢不锈	1,300,409.00	0.96

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	271,129,500.47
卖出股票收入（成交）总额	140,998,730.37

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	100,940.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,973.91
5	应收申购款	13,250.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,164.35

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

7.12.5.1 期末指数投资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	600643	爱建集团	1,574,276.00	1.16	重大事项停牌
2	601717	郑煤机	1,445,825.00	1.07	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五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	002399	海普瑞	1,489,680.00	1.10	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
679	199,593.59	130,660,683.70	96.41%	4,863,364.72	3.59%

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	9,989.05	0.0074%

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（2017 年 3 月 3 日）基金份额总额	200,250,263.71
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	6,958,968.75
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	71,685,184.04
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）	-
本报告期期末基金份额总额	135,524,048.42

注：1. 总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2. 本基金基金合同生效日为 2017 年 03 月 03 日。

§ 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	
招商证券股份有限公司		2410,591,154.21	100.00%	382,394.33	100.00%	-

注：1、本基金与景顺长城景颐盛利债券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
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	2017 年 1 月 24 日
2	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	2017 年 1 月 24 日
3	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	2017 年 1 月 24 日
4	景顺长城中证 500 行业中性低波动	中国证券报，上海证券报，	2017 年 1 月 24 日

	指数型证券投资基金招募说明书	证券时报, 基金管理人网站	
5	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	2017 年 1 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金在直销柜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	2017 年 1 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金参加部分代销机构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	2017 年 2 月 3 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金在直销网上交易系统部分渠道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	2017 年 2 月 3 日
9	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
10	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
11	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金新增上海利得基金销售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 2 月 9 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金新增北京肯特瑞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 2 月 13 日
13	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金提前结束募集的公告	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 28 日
14	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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	2017 年 3 月 4 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金在直销柜台实施申购和赎回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 17 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金在直销网上交易	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 17 日

	系统开展申购和转换费率优惠活动的公告		
17	关于景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金参加部分销售机构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 17 日
18	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金关于开放日常申购、赎回及转换业务的公告	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 17 日
19	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 14 日
20	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
21	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
22	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
23	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金关于开放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	2017 年 5 月 12 日
24	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170301—20170630	-	50,016,333.33	20,000,000.00	30,016,333.33	22.15%
	2	20170626—20170630	-	30,005,600.00	-	30,005,600.00	22.14%
	3	20170626—20170630	-	30,009,733.33	-	30,009,733.33	22.14%
	4	20170301—20170612	-	50,013,384.15	25,033,384.15	24,980,000.00	18.43%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

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证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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