

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强
场内简称	无
基金主代码	000311
交易代码	000311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 10 月 29 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	3,115,055,988.79 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	1、资产配置策略:本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—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。 2、股票投资策略:本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 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。 4、权证、股指期货投资策略: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、权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。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、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5、中小企业私募债券的投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	贺倩
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	545,645,694.33	1,140,230.58	246,317,367.50
本期利润	872,358,704.20	-8,700,715.73	187,635,499.64
加权平均基金份额本期利润	0.4948	-0.0338	0.5058
本期基金份额净值增长率	33.58%	-0.69%	18.98%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5936	0.6290	0.6317
期末基金资产净值	6,585,114,283.47	682,230,229.42	392,435,009.64
期末基金份额净值	2.114	1.861	1.874

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。

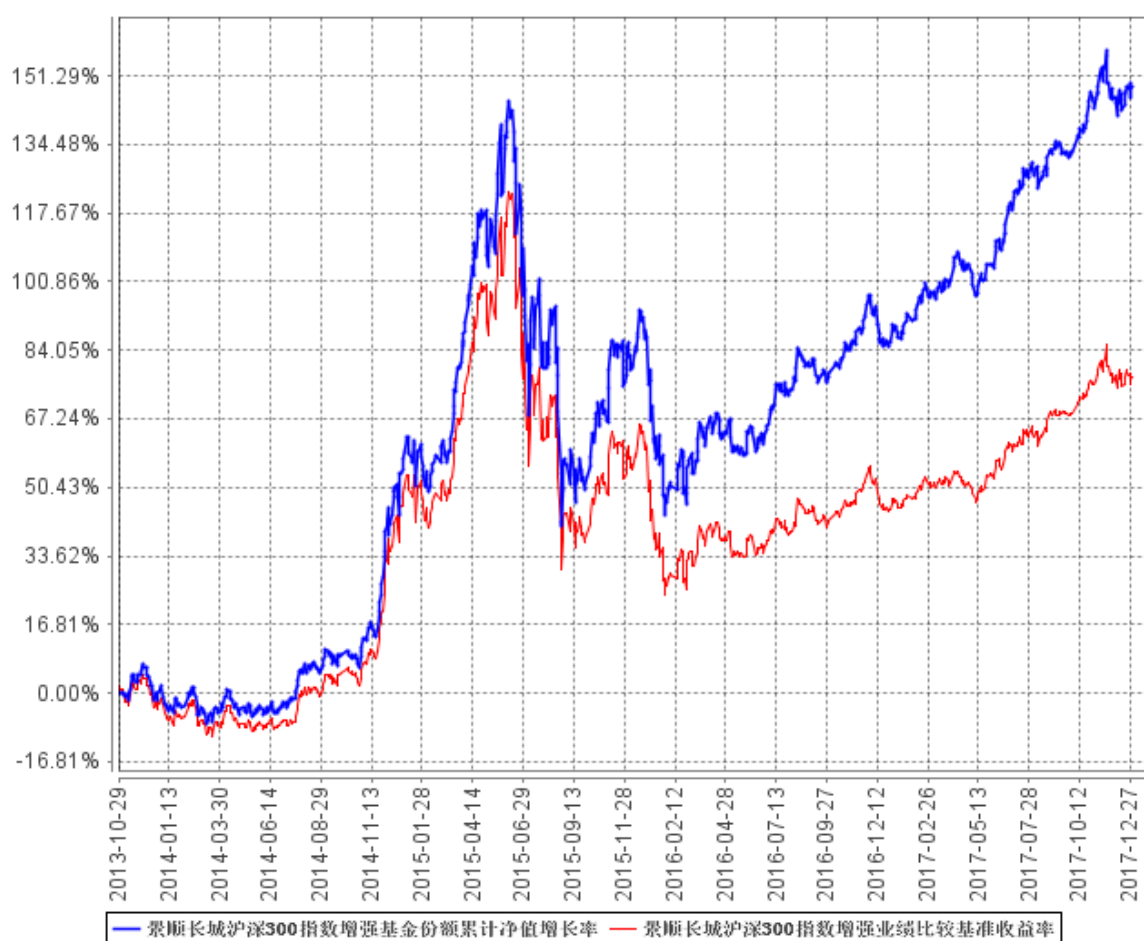
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

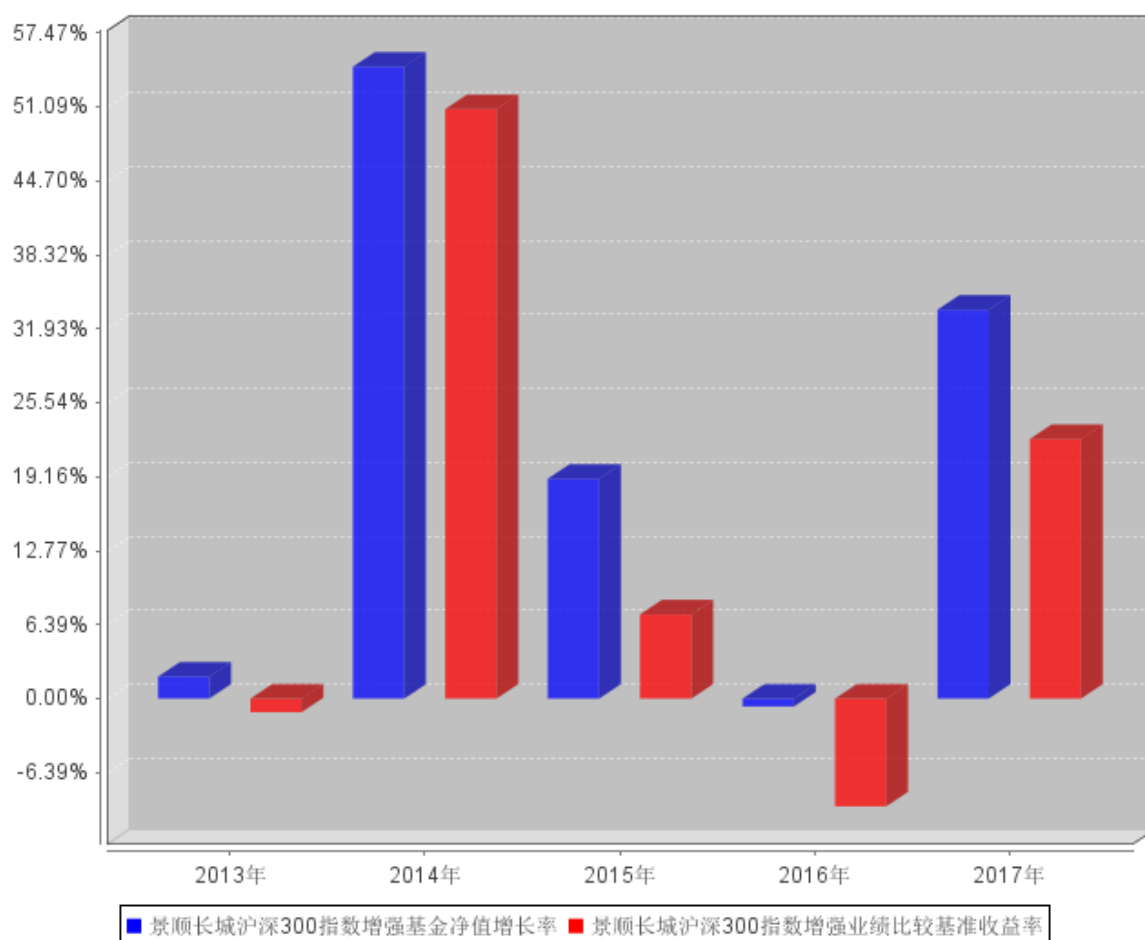
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	6.82%	0.81%	5.21%	0.76%	1.61%	0.05%
过去六个月	13.00%	0.70%	10.25%	0.66%	2.75%	0.04%
过去一年	33.58%	0.67%	22.42%	0.61%	11.16%	0.06%
过去三年	57.84%	1.73%	19.10%	1.60%	38.74%	0.13%
自基金合同生效起至今	148.60%	1.59%	77.60%	1.48%	71.00%	0.11%

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：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2013 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期为 2013 年 10 月 29 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	3.400	648,578,873.52	276,858,109.21	925,436,982.73	
2016	—	—	—	—	
2015	—	—	—	—	
合计	3.400	648,578,873.52	276,858,109.21	925,436,982.73	

§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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理72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（本基金的最后运作日为 2017 年 12 月 26 日，清算截止日为 2018 年 1 月 26 日）、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（本基金的最后运作日为 2017 年 11 月 13 日，清算截止日为 2017 年 12 月 8 日）、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金。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	2013 年 10 月 29 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、《景顺长城沪深 300 指数增强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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，

严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的交易指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 37 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易，从而与其他组合发生的反向交易。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为，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 年全年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 6.6%，增速维持稳定，经济整体呈现稳定迹象。12 月 PMI 指数 51.6，景气指数略有回落；12 月 PPI 同比上涨 4.9%，环比上涨 0.8%，同比涨幅回落；12 月 CPI 同比上涨 1.8%，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。12 月 M2 增速回落至 8.2%，M1 增速也回落至 11.8%，货币供应继续保持较紧的状态。12 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。12 月末的 70 个大中城市新建住宅价格指数同比上涨 5.6%，环比上涨 0.5%，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 12 月的全国房地产销售面积累计同比上升 7.7%，销售额累计同比上升 13.7%。

组合仍主要以基本面选股作为主要的收益来源，在价值和成长之间保持平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年度，本基金份额净值增长率为 33.58%，业绩比较基准收益率为 22.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年全年看经济企稳回升主要得益于出口回暖、房地产销售和投资链条。2018 年房地产销售周期回落、地方融资收紧将导致投资大概率继续走弱，但外需向好有望延续，基数提升明年出口增速略降，居民收入提升带动消费稳定增长，整体看经济增长动能略回落。

我们预计经济在积极财政政策支持下会继续保持平稳，但面临的内外部压力依然很大。通胀、汇率都有不确定性因素，房地产调控将对资本市场产生较大影响。中长期看整体流动性可能会持续紧缩。在防风险、抑制资产泡沫的中性货币政策基调下，以及金融监管不断强化的背景下，整个市场的估值体系有可能会持续修正。

展望 2018 年 1 季度，A 股指数可能以波动为主，缺乏大的趋势性行情，但不排除春季行情阶段性上行的可能。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以及细分行业的龙头股。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，在股市波动中以自下而上选股为主以期获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了两次利润分配。(1)截止 2017 年 7 月 28 日，本基金可供分配利润为 1,356,543,669.58 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 135,654,366.96 元，本基金的基金管理人已于 2017 年 8 月 4 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 1.9 元，详细信息请查阅相关分红公告。(2)截止 2017 年 8 月 8 日，本基金可供分配利润为 1,726,829,910.36 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 172,682,991.04 元，本基金的基金管理人已于 2017 年 8 月 15 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 1.5 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

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 12 月 31 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年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本报告期内，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	584,161,351.53	98,622,324.74
结算备付金	24,790,074.73	1,189,852.97
存出保证金	2,931,321.51	72,320.16
交易性金融资产	6,229,559,282.43	645,198,318.75
其中：股票投资	6,229,559,282.43	645,198,318.75
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	141,914,242.88	-
应收利息	95,941.11	10,443.85
应收股利	-	-
应收申购款	23,154,847.28	1,167,372.82
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,006,607,061.47	746,260,633.29
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	61,533,274.85
应付赎回款	405,749,409.21	763,156.97
应付管理人报酬	5,880,573.25	533,660.81
应付托管费	1,176,114.65	106,732.15
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,783,216.32	881,264.29
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,903,464.57	212,314.80
负债合计	421,492,778.00	64,030,403.87
所有者权益：		
实收基金	3,115,055,988.79	366,648,059.63
未分配利润	3,470,058,294.68	315,582,169.79
所有者权益合计	6,585,114,283.47	682,230,229.42
负债和所有者权益总计	7,006,607,061.47	746,260,633.29

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 2.114 元，基金份额总额 3,115,055,988.79 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	950,488,467.03	967,549.34
1.利息收入	2,106,406.11	235,737.06
其中：存款利息收入	2,106,406.11	235,737.06
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）	617,111,405.22	10,250,084.00
其中：股票投资收益	566,718,100.86	1,770,189.64
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	50,393,304.36	8,479,894.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	326,713,009.87	-9,840,946.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,557,645.83	322,674.59
减：二、费用	78,129,762.83	9,668,265.07
1. 管理人报酬	35,685,945.74	4,402,543.58

2. 托管费	7,137,189.07	880,508.72
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	34,287,880.70	3,817,832.56
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	1,018,747.32	567,380.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	872,358,704.20	-8,700,715.73
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	872,358,704.20	-8,700,715.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	366,648,059.63	315,582,169.79	682,230,229.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	872,358,704.20	872,358,704.20
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）	2,748,407,929.16	3,207,554,403.42	5,955,962,332.58
其中：1. 基金申购款	4,575,378,817.17	5,149,746,779.11	9,725,125,596.28
2. 基金赎回款	-1,826,970,888.01	-1,942,192,375.69	-3,769,163,263.70
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）	-	-925,436,982.73	-925,436,982.73
五、期末所有者权益（基金净值）	3,115,055,988.79	3,470,058,294.68	6,585,114,283.47
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	209,402,295.59	183,032,714.05	392,435,009.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,700,715.73	-8,700,715.73
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）	157,245,764.04	141,250,171.47	298,495,935.51
其中：1. 基金申购款	324,279,781.65	265,611,424.71	589,891,206.36
2. 基金赎回款	-167,034,017.61	-124,361,253.24	-291,395,270.85
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）	366,648,059.63	315,582,169.79	682,230,229.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金(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[2013]1028 号文《关于核准景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2013 年 9 月 23 日至 2013 年 10 月 25 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(2013)验字第 60467014_H04 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 2013 年 10 月 29 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 381,986,684.48 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 155,294.37 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 382,141,978.85 元,折合 382,141,978.85 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级

市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，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）。本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

7.4.2 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》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计变更参见 7.4.5.2。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发（2017）6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值业务指引（试行）》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 26 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生

的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

(3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

7.4.7 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
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
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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	35,685,945.74	4,402,543.58
其中：支付销售机构的客户维护费	6,178,923.64	1,489,618.74

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	7,137,189.07	880,508.72

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	584,161,351.53	1,745,177.10	98,622,324.74	211,604.54

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，并按银行间同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	重大事项停牌	31.76	2018 年 1 月 8 日	30.15	4,715,508	128,751,669.79	149,764,534.08	-
600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大事项停牌	37.68	-	-	2,144,555	75,114,586.96	80,806,832.40	-
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	15.51	2018 年 1 月 10 日	17.30	1,652,980	28,074,759.22	25,637,719.80	-
002507	涪陵榨菜	2017 年 12 月 4 日	重大事项停牌	17.94	-	-	1,306,500	17,753,177.37	23,438,610.00	-
601003	柳钢股份	2017 年 10 月 17 日	重大事项停牌	7.72	2018 年 1 月 18 日	7.50	525,200	4,190,556.47	4,054,544.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	40.93	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	33,603.53	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项停牌	35.69	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	29,301.49	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 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。

2. 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 12 月 31 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 5,945,708,689.94 元，划分为第二层次的余额为人民币 283,850,592.49 元，无划分为第三层次的余额（于 2016 年 12 月 31 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 639,667,366.13 元，划分为第二层次的余额为人民币 5,530,952.62 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。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	6,229,559,282.43	88.91
	其中：股票	6,229,559,282.43	88.91
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	608,951,426.26	8.69
8	其他各项资产	168,096,352.78	2.40
9	合计	7,006,607,061.47	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	250,194,614.89	3.80
C	制造业	2,679,508,005.86	40.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	110,111,016.24	1.67
E	建筑业	249,043,275.86	3.78
F	批发和零售业	107,043,971.88	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	182,623,110.92	2.77
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,542,974.72	1.37
J	金融业	1,921,109,983.47	29.17
K	房地产业	306,576,422.25	4.66
L	租赁和商务服务业	275,252,459.34	4.18
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,755,886.76	0.86
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,228,761,722.19	94.59

8.2.2 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	697,532.37	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,603.53	0.00
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	32,323.20	0.00
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	797,560.24	0.01

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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	6,920,492	484,296,030.16	7.35
2	600519	贵州茅台	534,660	372,920,003.40	5.66
3	000333	美的集团	4,871,123	270,006,347.89	4.10
4	601328	交通银行	39,989,002	248,331,702.42	3.77
5	601601	中国太保	5,488,408	227,329,859.36	3.45
6	601939	建设银行	24,898,321	191,219,105.28	2.90
7	000338	潍柴动力	22,434,405	187,102,937.70	2.84
8	601988	中国银行	45,577,900	180,944,263.00	2.75
9	601009	南京银行	22,764,200	176,194,908.00	2.68
10	601628	中国人寿	5,692,461	173,335,437.45	2.63

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年度报告正文。

8.3.2 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	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.00
2	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.00
3	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
4	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
5	300730	科创信息	821	33,603.53	0.00
6	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
7	300731	科创新源	808	30,914.08	0.00
8	002919	名臣健康	821	29,301.49	0.00
9	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
10	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00

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年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	487,210,169.58	71.41
2	600519	贵州茅台	413,802,561.92	60.65

3	601328	交通银行	318,484,334.16	46.68
4	000333	美的集团	284,038,906.63	41.63
5	601939	建设银行	284,026,738.41	41.63
6	601601	中国太保	252,296,318.64	36.98
7	601009	南京银行	248,981,580.83	36.50
8	000338	潍柴动力	242,729,414.55	35.58
9	000651	格力电器	239,641,685.38	35.13
10	000415	渤海金控	238,512,722.31	34.96
11	601628	中国人寿	238,453,902.05	34.95
12	601186	中国铁建	234,082,415.01	34.31
13	601398	工商银行	232,761,128.57	34.12
14	600383	金地集团	231,293,675.61	33.90
15	000725	京东方 A	225,650,274.43	33.08
16	601818	光大银行	212,069,525.56	31.08
17	600036	招商银行	202,220,867.82	29.64
18	601988	中国银行	199,643,470.70	29.26
19	600309	万华化学	195,294,150.88	28.63
20	601899	紫金矿业	192,716,528.81	28.25
21	601006	大秦铁路	190,958,642.60	27.99
22	000959	首钢股份	179,225,029.25	26.27
23	002146	荣盛发展	178,468,028.16	26.16
24	601390	中国中铁	177,467,107.86	26.01
25	000425	徐工机械	173,963,515.44	25.50
26	600188	兖州煤业	169,433,389.38	24.84
27	601997	贵阳银行	167,346,174.90	24.53
28	600010	包钢股份	162,148,982.34	23.77
29	601169	北京银行	159,612,898.46	23.40
30	601877	正泰电器	148,391,567.10	21.75
31	002195	二三四五	144,932,880.47	21.24
32	600900	长江电力	142,033,622.92	20.82
33	601669	中国电建	136,041,748.83	19.94
34	000800	一汽轿车	133,299,511.02	19.54
35	600741	华域汽车	132,163,448.64	19.37
36	600332	白云山	131,414,486.16	19.26
37	600585	海螺水泥	126,494,434.60	18.54
38	600061	国投资本	119,252,567.59	17.48

39	601088	中国神华	115,262,060.16	16.89
40	600926	杭州银行	114,293,256.05	16.75
41	600183	生益科技	113,282,621.85	16.60
42	000413	东旭光电	108,720,313.36	15.94
43	600958	东方证券	107,171,190.48	15.71
44	600009	上海机场	106,531,198.31	15.62
45	000709	河钢股份	106,231,006.34	15.57
46	601225	陕西煤业	104,785,727.48	15.36
47	600406	国电南瑞	101,893,476.99	14.94
48	601231	环旭电子	98,522,673.19	14.44
49	600816	安信信托	97,858,165.08	14.34
50	002142	宁波银行	97,656,070.64	14.31
51	600690	青岛海尔	96,819,224.90	14.19
52	600887	伊利股份	96,650,026.57	14.17
53	600703	三安光电	96,579,616.62	14.16
54	000963	华东医药	93,666,170.65	13.73
55	002310	东方园林	93,071,415.03	13.64
56	002027	分众传媒	88,332,125.32	12.95
57	000402	金融街	87,435,459.01	12.82
58	002315	焦点科技	83,543,319.81	12.25
59	600297	广汇汽车	82,313,327.47	12.07
60	002044	美年健康	81,901,441.17	12.00
61	603993	洛阳钼业	80,327,644.63	11.77
62	600704	物产中大	79,776,639.70	11.69
63	300357	我武生物	79,619,919.52	11.67
64	600566	济川药业	78,848,192.98	11.56
65	002448	中原内配	75,888,198.23	11.12
66	600325	华发股份	74,759,237.14	10.96
67	603025	大豪科技	74,072,166.09	10.86
68	600663	陆家嘴	73,155,068.17	10.72
69	002174	游族网络	71,579,058.34	10.49
70	600015	华夏银行	66,748,279.87	9.78
71	600018	上港集团	66,348,732.61	9.73
72	600409	三友化工	64,768,094.21	9.49
73	601919	中远海控	64,378,889.75	9.44
74	600153	建发股份	64,342,152.29	9.43

75	000488	晨鸣纸业	62,941,030.83	9.23
76	603858	步长制药	61,035,737.78	8.95
77	002472	双环传动	61,032,970.04	8.95
78	002088	鲁阳节能	60,173,603.12	8.82
79	600919	江苏银行	58,557,323.89	8.58
80	600310	桂东电力	56,864,746.91	8.34
81	600657	信达地产	55,244,598.34	8.10
82	002415	海康威视	54,314,164.62	7.96
83	601012	隆基股份	54,094,711.95	7.93
84	600507	方大特钢	53,958,878.69	7.91
85	002449	国星光电	53,658,893.15	7.87
86	002543	万和电气	52,292,255.11	7.66
87	002279	久其软件	51,317,258.92	7.52
88	000858	五 粮 液	50,069,979.28	7.34
89	600031	三一重工	50,016,921.60	7.33
90	601155	新城控股	46,927,203.48	6.88
91	300377	赢时胜	45,845,277.05	6.72
92	300122	智飞生物	44,919,520.03	6.58
93	601991	大唐发电	44,382,755.65	6.51
94	002587	奥拓电子	43,775,397.57	6.42
95	600516	方大炭素	43,423,240.87	6.36
96	300072	三聚环保	43,220,160.40	6.34
97	002354	天神娱乐	43,169,554.30	6.33
98	600373	中文传媒	42,840,963.71	6.28
99	002601	龙鳞佰利	42,613,661.11	6.25
100	601100	恒立液压	41,526,373.15	6.09
101	600256	广汇能源	40,928,172.00	6.00
102	000776	广发证券	40,454,873.60	5.93
103	000830	鲁西化工	39,915,212.80	5.85
104	002482	广田集团	39,453,727.82	5.78
105	600312	平高电气	39,347,252.54	5.77
106	600525	长园集团	38,137,975.25	5.59
107	000686	东北证券	37,544,811.05	5.50
108	600529	山东药玻	35,932,783.22	5.27
109	601928	凤凰传媒	34,821,108.55	5.10
110	600867	通化东宝	34,701,438.94	5.09

111	002714	牧原股份	33,614,230.87	4.93
112	002071	长城影视	32,818,979.89	4.81
113	300298	三诺生物	32,734,798.03	4.80
114	600068	葛洲坝	32,660,709.61	4.79
115	000426	兴业矿业	32,024,570.99	4.69
116	002093	国脉科技	31,636,903.44	4.64
117	603198	迎驾贡酒	30,908,686.74	4.53
118	600739	辽宁成大	30,062,435.95	4.41
119	600688	上海石化	29,004,773.68	4.25
120	600808	马钢股份	28,756,845.03	4.22
121	601600	中国铝业	28,274,705.77	4.14
122	000631	顺发恒业	28,230,303.35	4.14
123	601636	旗滨集团	27,363,180.34	4.01
124	002001	新 和 成	26,080,697.65	3.82
125	002456	欧菲科技	25,475,121.55	3.73
126	000568	泸州老窖	24,638,644.36	3.61
127	600995	文山电力	23,842,458.73	3.49
128	300316	晶盛机电	23,628,894.49	3.46
129	600549	厦门钨业	22,459,738.39	3.29
130	002507	涪陵榨菜	20,511,914.19	3.01
131	000728	国元证券	20,223,884.04	2.96
132	603288	海天味业	20,039,101.12	2.94
133	002475	立讯精密	19,947,577.26	2.92
134	600640	号百控股	19,871,331.82	2.91
135	601166	兴业银行	19,715,391.09	2.89
136	600755	厦门国贸	19,044,299.43	2.79
137	000060	中金岭南	17,483,774.20	2.56
138	600057	象屿股份	17,165,748.07	2.52
139	600308	华泰股份	17,148,908.88	2.51
140	002352	顺丰控股	16,858,413.68	2.47
141	600019	宝钢股份	16,208,656.43	2.38
142	300274	阳光电源	16,195,270.00	2.37
143	601999	出版传媒	15,345,705.35	2.25
144	600618	氯碱化工	15,066,364.91	2.21
145	000525	红 太 阳	15,050,995.80	2.21
146	002624	完美世界	15,024,444.74	2.20

147	002122	天马股份	14,942,296.68	2.19
148	600565	迪马股份	14,540,446.42	2.13
149	300071	华谊嘉信	14,404,707.02	2.11
150	002558	巨人网络	14,109,035.13	2.07
151	600588	用友网络	13,793,008.28	2.02
152	601668	中国建筑	13,790,603.40	2.02
153	600170	上海建工	13,788,639.00	2.02
154	600056	中国医药	13,741,174.35	2.01

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。

8.4.2 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	000725	京东方 A	335,082,788.01	49.12
2	601318	中国平安	244,083,585.87	35.78
3	600036	招商银行	223,729,245.81	32.79
4	601899	紫金矿业	211,697,242.46	31.03
5	601818	光大银行	211,263,450.00	30.97
6	000651	格力电器	189,943,138.46	27.84
7	601390	中国中铁	184,974,743.81	27.11
8	600741	华域汽车	181,832,927.28	26.65
9	601398	工商银行	178,676,206.55	26.19
10	600900	长江电力	170,036,339.15	24.92
11	600309	万华化学	166,791,905.31	24.45
12	600383	金地集团	166,389,616.90	24.39
13	601877	正泰电器	163,030,500.36	23.90
14	601169	北京银行	157,573,885.17	23.10
15	000800	一汽轿车	139,521,734.38	20.45
16	601939	建设银行	137,254,196.80	20.12
17	601669	中国电建	136,542,471.41	20.01
18	600519	贵州茅台	132,239,256.20	19.38
19	600816	安信信托	131,344,573.22	19.25
20	600183	生益科技	129,858,149.37	19.03
21	002142	宁波银行	129,255,702.77	18.95
22	600061	国投资本	128,962,467.68	18.90
23	002146	荣盛发展	114,886,028.05	16.84
24	600406	国电南瑞	113,977,188.15	16.71

25	600926	杭州银行	112,375,766.66	16.47
26	000338	潍柴动力	111,411,170.03	16.33
27	600188	兖州煤业	109,571,291.44	16.06
28	000963	华东医药	109,216,052.59	16.01
29	600009	上海机场	108,038,101.78	15.84
30	600703	三安光电	101,979,230.82	14.95
31	000709	河钢股份	101,757,574.27	14.92
32	600958	东方证券	99,986,443.98	14.66
33	600690	青岛海尔	96,442,601.88	14.14
34	300357	我武生物	91,569,716.10	13.42
35	600297	广汇汽车	89,401,826.29	13.10
36	603993	洛阳钼业	85,794,000.91	12.58
37	600663	陆家嘴	81,204,365.94	11.90
38	002315	焦点科技	81,009,605.20	11.87
39	000402	金 融 街	80,958,238.77	11.87
40	600566	济川药业	80,552,262.07	11.81
41	601186	中国铁建	79,318,532.82	11.63
42	601009	南京银行	77,510,582.97	11.36
43	600018	上港集团	72,590,130.52	10.64
44	300377	赢时胜	72,148,794.63	10.58
45	601328	交通银行	69,736,661.46	10.22
46	600015	华夏银行	68,723,390.63	10.07
47	600409	三友化工	68,051,585.75	9.97
48	601601	中国太保	65,525,994.52	9.60
49	600585	海螺水泥	64,971,004.26	9.52
50	002174	游族网络	64,180,727.96	9.41
51	601628	中国人寿	63,380,364.78	9.29
52	601919	中远海控	62,667,163.26	9.19
53	002195	二三四五	60,756,227.03	8.91
54	601225	陕西煤业	60,125,600.78	8.81
55	600919	江苏银行	58,041,574.63	8.51
56	000425	徐工机械	57,911,357.39	8.49
57	600507	方大特钢	55,087,590.52	8.07
58	002088	鲁阳节能	54,152,032.02	7.94
59	600031	三一重工	53,335,005.45	7.82
60	000776	广发证券	51,512,183.30	7.55
61	601231	环旭电子	50,984,213.12	7.47
62	002279	久其软件	47,517,525.88	6.97

63	000415	渤海金控	46,491,052.38	6.81
64	000568	泸州老窖	45,689,682.08	6.70
65	000686	东北证券	45,598,340.54	6.68
66	601100	恒立液压	44,075,001.46	6.46
67	300072	三聚环保	43,455,445.79	6.37
68	002601	龙鳞佰利	43,363,663.11	6.36
69	601928	凤凰传媒	42,448,757.09	6.22
70	002482	广田集团	41,560,221.61	6.09
71	600373	中文传媒	41,373,817.49	6.06
72	002354	天神娱乐	40,226,367.30	5.90
73	600256	广汇能源	39,971,826.29	5.86
74	601988	中国银行	39,662,354.00	5.81
75	002543	万和电气	38,751,776.50	5.68
76	002714	牧原股份	37,711,893.26	5.53
77	300122	智飞生物	37,437,845.84	5.49
78	002001	新 和 成	35,831,263.08	5.25
79	600312	平高电气	35,305,385.62	5.17
80	000830	鲁西化工	34,823,724.21	5.10
81	600867	通化东宝	34,349,654.33	5.03
82	600529	山东药玻	34,131,980.01	5.00
83	601088	中国神华	32,936,158.16	4.83
84	002044	美年健康	32,397,111.50	4.75
85	600153	建发股份	31,929,676.10	4.68
86	000426	兴业矿业	31,250,966.28	4.58
87	603198	迎驾贡酒	31,192,253.21	4.57
88	601600	中国铝业	30,820,020.82	4.52
89	600068	葛洲坝	30,769,591.27	4.51
90	002071	长城影视	30,623,292.63	4.49
91	601636	旗滨集团	30,612,228.03	4.49
92	601006	大秦铁路	30,402,919.90	4.46
93	600325	华发股份	30,166,449.10	4.42
94	002093	国脉科技	30,126,723.30	4.42
95	600739	辽宁成大	30,068,491.07	4.41
96	601998	中信银行	29,342,766.13	4.30
97	600688	上海石化	29,010,416.15	4.25
98	002456	欧菲科技	28,675,564.56	4.20
99	600887	伊利股份	28,583,090.08	4.19
100	601155	新城控股	28,156,852.91	4.13

101	000858	五 粮 液	27,446,821.36	4.02
102	000333	美的集团	26,436,036.37	3.87
103	600019	宝钢股份	26,217,374.77	3.84
104	000959	首钢股份	25,762,115.75	3.78
105	300316	晶盛机电	25,540,356.36	3.74
106	002475	立讯精密	24,666,676.97	3.62
107	600640	号百控股	24,317,156.45	3.56
108	601997	贵阳银行	24,138,381.54	3.54
109	600808	马钢股份	24,109,733.00	3.53
110	601668	中国建筑	23,185,513.72	3.40
111	603288	海天味业	22,698,047.56	3.33
112	002587	奥拓电子	22,356,252.50	3.28
113	300058	蓝色光标	21,389,915.92	3.14
114	600056	中国医药	21,326,923.82	3.13
115	000728	国元证券	21,196,780.58	3.11
116	600000	浦发银行	19,429,739.27	2.85
117	600438	通威股份	18,979,069.27	2.78
118	000921	海信科龙	17,853,519.74	2.62
119	600549	厦门钨业	15,790,913.30	2.31
120	601999	出版传媒	15,150,719.71	2.22
121	000525	红 太 阳	15,016,734.79	2.20
122	300113	顺网科技	14,568,269.42	2.14
123	002122	天马股份	14,533,608.99	2.13
124	300071	华谊嘉信	14,509,981.14	2.13
125	600516	方大炭素	14,385,000.97	2.11
126	300335	迪森股份	14,296,778.03	2.10
127	000910	大亚圣象	14,178,807.18	2.08
128	600565	迪马股份	14,162,440.00	2.08
129	002558	巨人网络	14,147,131.36	2.07
130	000488	晨鸣纸业	14,125,525.36	2.07
131	603025	大豪科技	13,934,809.73	2.04

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。

8.4.3 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	14,398,713,452.46
卖出股票收入（成交）总额	9,707,783,599.51

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

1、2017 年 6 月 22 日，因南京银行股份有限公司（以下简称“南京银行”，股票代码：601009）独立董事任职时间超过监管规定，中国银行业监督管理委员会江苏监管局依照《中华人民共和国

银行业监督管理法》第四十六条第（五）项之规定，出具苏银监罚决字（2017）7 号行政处罚决定书，处南京银行以罚款二十五万元。

本基金投研人员认为，本基金根据量化模型进行投资，而南京银行资产规模超过万亿，所在区域经济都较为发达，资产质量较好，模型计算的盈利趋势在银行行业内较为突出。基于以上结论，本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内进行了相关投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,931,321.51
2	应收证券清算款	141,914,242.88
3	应收股利	-
4	应收利息	95,941.11
5	应收申购款	23,154,847.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	168,096,352.78

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 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	300730	科创信息	33,603.53	0.00	重大事项停牌

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
189, 536	16, 435. 17	1, 969, 221, 730. 57	63. 22%	1, 145, 834, 258. 22	36. 78%

9.2 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	324, 832. 22	0. 01%

9.3 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 10 月 29 日）基金份额总额	382, 141, 978. 85
本报告期期初基金份额总额	366, 648, 059. 63
本报告期基金总申购份额	4, 575, 378, 817. 17
减:本报告期基金总赎回份额	1, 826, 970, 888. 01
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	3, 115, 055, 988. 79

注：总申购份额含转换入及红利再投资份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人于 2017 年 12 月 29 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意许义明先生辞去本公司总经理一职，聘任康乐先生担任本公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 2 月 14 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任赵代中先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国农业银行股份有限公司于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 5 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 110,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券股份有限公司	24	343,119,329.40	18.02%	4,044,743.81	18.02%	—
海通证券股份有限公司	13	866,712,438.69	16.05%	3,601,071.22	16.05%	—
光大证券股份有限公司	22	355,635,517.04	9.78%	2,193,809.66	9.78%	—
东方证券股份有限公司	12	244,158,675.02	9.31%	2,089,985.67	9.31%	—
平安证券股份有限公司	22	213,522,366.15	9.19%	2,061,442.23	9.19%	—
长江证券股份有限公司	22	169,402,401.69	9.00%	2,020,368.74	9.00%	新增
中国国际金融股份有限公司	22	163,565,363.14	8.98%	2,014,930.52	8.98%	—
兴业证券股份有限公司	1	852,885,542.06	3.54%	794,292.58	3.54%	—
中国银河证券股份有限公司	1	842,341,756.09	3.50%	784,473.88	3.50%	—
广发证券股份有限公司	1	732,904,666.56	3.04%	682,555.40	3.04%	—
恒泰证券股份有限公司	1	439,028,099.43	1.82%	408,868.42	1.82%	—
国金证券股份有限公司	1	411,489,213.32	1.71%	383,221.49	1.71%	—
方正证券股份有限公司	2	403,921,514.00	1.68%	376,174.84	1.68%	—
东兴证券股份有限公司	1	345,910,969.92	1.44%	322,148.48	1.44%	—

民生证券股份有限公司	1	220,927,589.64	0.92%	205,750.27	0.92%	—
天风证券股份有限公司	1	198,925,989.85	0.83%	185,260.54	0.83%	新增
国泰君安证券股份有限公司	1	125,291,367.69	0.52%	116,683.98	0.52%	—
招商证券股份有限公司	2	74,412,708.50	0.31%	69,300.83	0.31%	—
中泰证券股份有限公司	1	56,296,812.49	0.23%	52,429.85	0.23%	—
华泰证券股份有限公司	1	37,412,698.30	0.16%	34,843.21	0.16%	—
东北证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
国信证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
长城证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
川财证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
上海华信证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
中信建投证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券有限公司	1	—	—	—	—	—
国盛证券有限责任公司	1	—	—	—	—	—
华福证券有限责任公司	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。

11.7.2 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
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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者超过 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	20170802--20171231	51,019,897.95	739,032,864.14	51,019,897.95	739,032,864.14	23.72%
	2	20170317--20170410	0.00	505,002,879.77	11,788,755.94	493,214,123.83	15.83%
	3	20170116--20170905	54,316,615.99	919,030,267.37	626,763,242.67	346,583,640.69	11.13%
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。

12.2 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

2018 年 3 月 28 日