

# 景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	24,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-01-21

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均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，被动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。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨焱阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		王永民
		010-66594896
		fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	18,840,334.31
本期利润	27,526,555.27
加权平均基金份额本期利润	0.9986
本期基金份额净值增长率	64.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.2955
期末基金资产净值	56,406,570.44
期末基金份额净值	2.2955

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、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。

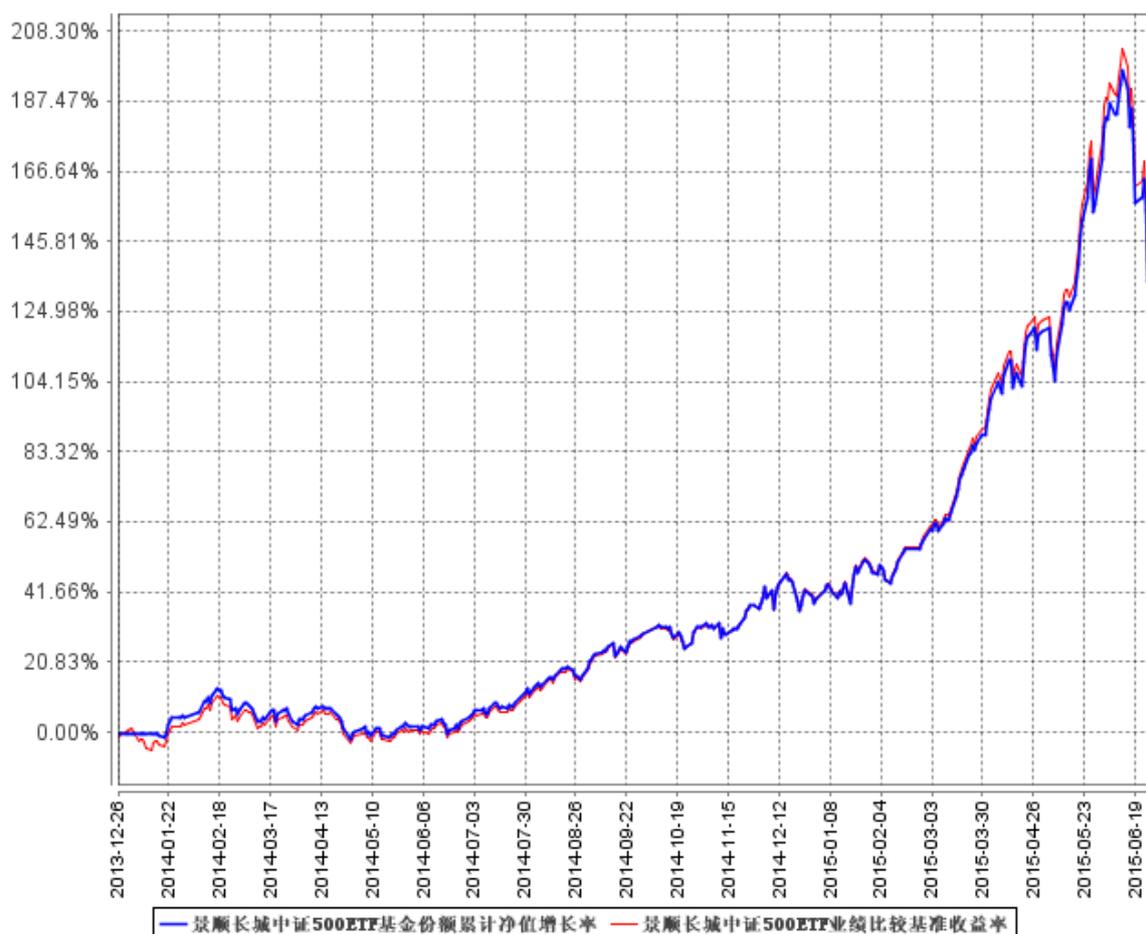
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-10.66%	3.72%	-10.64%	3.79%	-0.02%	-0.07%
过去三个月	21.96%	2.86%	22.79%	2.90%	-0.83%	-0.04%
过去六个月	64.65%	2.25%	67.32%	2.28%	-2.67%	-0.03%
过去一年	120.32%	1.79%	126.91%	1.81%	-6.59%	-0.02%

自基金合同生效起至今	129.55%	1.60%	133.85%	1.65%	-4.30%	-0.05%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

### 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：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、

景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2015 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 46 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 800 食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
江科宏	景顺长城沪深 300 等权重 ETF、景顺长城中证 500ETF、景顺长城中证医药卫生 ETF、景顺长城中证 800 食品饮料 ETF、景顺长城中证 TMT150ETF、景顺长城研究精选股票型基金、景顺长城公司治理股票型基金、景顺长城优势企业基金基金经理	2013 年 12 月 26 日	2015 年 1 月 26 日	8	经济学硕士，CFA。2007 年至 2010 年担任本公司风险管理经理职务。2011 年 2 月重新加入本公司，担任研究员等职务；自 2012 年 6 月起担任基金经理。
徐喻军	上证 180 等权重交易型开放式指数基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数基金联接基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数基金、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基金经理	2014 年 12 月 27 日	-	5	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；

3、江科宏先生于 2015 年 1 月 26 日离任景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

#### 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年宏观经济整体依然疲弱，PMI 数据小幅企稳，消费和进出口数据不佳，内外需依旧不振，基建和房地产投资增速表现较差。通胀小幅回升，但仍在可控范围内。货币政策依然宽松，央行接连出台降准降息等政策，并通过公开市场操作缓解资金面压力。在增量资金入市的推动下，A 股市场上半年经历了一轮大幅上涨，直到 6 月中旬，在去杠杆和估值泡沫的压力下发生了剧烈调整。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，本基金上市以后基金的收益和标的指数收益基本一致。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年，本基金份额净值增长率为 64.65%，低于业绩比较基准收益率 2.67%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

### 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 3 季度，我们认为需求低迷、投资疲弱的情况难以快速转变，在财政政策刺激下，基建投资增速预计会有所企稳，并对经济起到一定的支撑作用。

本基金作为被动指数基金，将继续采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，控制跟踪误差和跟踪偏离度，期望为投资者分享中国经济的长期成长提供投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

##### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

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

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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，报告期内本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2015 年 1 月 6 日至 2015 年 2 月 16 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

从 2014 年 12 月 11 日至 2015 年 1 月 20 日，及从 2015 年 1 月 22 日至 2015 年 3 月 25 日，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## §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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,414,879.52	1,893,852.47
结算备付金		1,476.11	1,821.28
存出保证金		1,890.70	2,848.57
交易性金融资产		55,420,690.79	49,260,401.92
其中：股票投资		55,420,690.79	49,260,401.92
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		31,353.83	274,478.69
应收利息		258.55	233.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		56,870,549.50	51,433,636.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,692.32	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		27,082.98	15,391.22
应付托管费		5,416.59	3,078.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		21,877.17	9,917.68
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		344,910.00	416,132.57
负债合计		463,979.06	444,519.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		24,572,956.00	36,572,956.00
未分配利润		31,833,614.44	14,416,160.32
所有者权益合计		56,406,570.44	50,989,116.32
负债和所有者权益总计		56,870,549.50	51,433,636.04

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.2955 元，基金份额总额 24,572,956.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		28,033,985.00	30,276,428.18
1.利息收入		5,738.87	532,571.78
其中：存款利息收入		5,738.87	171,417.89
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		-	361,153.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,226,883.28	28,229,592.08
其中：股票投资收益		19,047,128.93	28,005,425.74
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		179,754.35	224,166.34
3.公允价值变动收益（损失以		8,686,220.96	1,522,253.44

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		115,141.89	-7,989.12
<b>减：二、费用</b>		507,429.73	1,230,862.60
1. 管理人报酬		133,393.17	296,080.72
2. 托管费		26,678.60	59,216.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		38,676.69	555,461.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		308,681.27	320,103.95
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		27,526,555.27	29,045,565.58
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		27,526,555.27	29,045,565.58

### 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 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	36,572,956.00	14,416,160.32	50,989,116.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,526,555.27	27,526,555.27
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)	-12,000,000.00	-10,109,101.15	-22,109,101.15
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	10,769,910.85	22,769,910.85
2. 基金赎回款	-24,000,000.00	-20,879,012.00	-44,879,012.00
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)	24,572,956.00	31,833,614.44	56,406,570.44
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	512,572,956.00	-2,004,240.06	510,568,715.94
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	29,045,565.58	29,045,565.58
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)	-460,000,000.00	-24,838,387.70	-484,838,387.70
其中：1. 基金申购款	29,000,000.00	688,119.63	29,688,119.63
2. 基金赎回款	-489,000,000.00	-25,526,507.33	-514,526,507.33
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)	52,572,956.00	2,202,937.82	54,775,893.82

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

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(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[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数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《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值),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(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景

顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 34,609.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 17 号文审核同意，本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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份股(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(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、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

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 2015 年 8 月 27 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金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一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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)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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	13,126,642.87	50.33%	17,975,563.60	3.43%

##### 6.4.8.1.2 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。

##### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	11,950.60	50.33%	11,041.86	50.47%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	16,365.77	3.43%	5,240.13	56.44%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	133,393.17	296,080.72
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,678.60	59,216.14

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国银行	1,414,879.52	5,278.04	2,337,863.07	162,728.67

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
300147	香雪制药	2015年6月18日	2015年7月2日	配股	10.46	30.80	1,260	13,179.60	38,808.00	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002183	怡亚通	2015年6月1日	因重大事项停牌	73.15	-	-	5,682	88,450.32	415,638.30	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	因重大事项停牌	22.44	-	-	13,800	120,268.01	309,672.00	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	因重大事项停牌	47.84	2015年7月22日	43.06	6,288	126,286.08	300,817.92	-
601718	际华集团	2015年6月17日	因重大事项停牌	15.12	2015年7月2日	13.61	17,947	106,551.92	271,358.64	-
000748	长城信息	2015年6月18日	因重大事项停牌	34.88	-	-	7,600	171,300.80	265,088.00	-
000566	海南海药	2015年6月18日	因重大事项停牌	49.97	-	-	5,059	110,347.83	252,798.23	-
600645	中源协和	2015年4月27日	因重大事项停牌	79.34	-	-	3,130	144,020.97	248,334.20	-

300144	宋城演艺	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	76.47	2015 年 7 月 20 日	68.82	3,200	173,218.34	244,704.00	-
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	44.08	-	-	5,461	94,580.81	240,720.88	-
600654	中安消	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	30.91	-	-	7,436	111,621.18	229,846.76	-
002223	鱼跃医疗	2015 年 6 月 25 日	因重大事 项停牌	67.20	2015 年 7 月 13 日	60.48	3,384	127,531.55	227,404.80	-
600879	航天电子	2015 年 5 月 15 日	因重大事 项停牌	24.50	-	-	8,796	128,951.15	215,502.00	-
600872	中炬高新	2015 年 5 月 4 日	因重大事 项停牌	21.62	-	-	9,950	126,412.70	215,119.00	-
000592	平潭发展	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	29.76	2015 年 7 月 14 日	30.00	6,900	304,580.00	205,344.00	-
002191	劲嘉股份	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	19.22	-	-	10,474	96,053.94	201,310.28	-
600499	科达洁能	2015 年 6 月 10 日	因重大事 项停牌	29.64	-	-	6,700	136,259.34	198,588.00	-
600643	爱建股份	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	16.73	-	-	11,678	136,164.26	195,372.94	-
600110	中科英华	2015 年 6 月 26 日	因重大事 项停牌	13.73	-	-	13,834	97,040.05	189,940.82	-
002276	万马股份	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	34.15	2015 年 7 月 20 日	30.74	5,452	74,807.31	186,185.80	-
600312	平高电气	2015 年 6 月 23 日	因重大事 项停牌	22.58	-	-	7,800	131,243.34	176,124.00	-
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	58.63	2015 年 7 月 3 日	52.77	2,896	102,575.81	169,792.48	-
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	21.54	-	-	7,542	66,463.86	162,454.68	-
000887	中鼎股份	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	24.75	-	-	6,508	113,298.07	161,073.00	-
000732	泰禾集团	2015 年 6 月 25 日	因重大事 项停牌	34.20	2015 年 7 月 2 日	30.78	4,637	98,292.99	158,585.40	-
300291	华录百纳	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	37.76	2015 年 7 月 13 日	34.65	4,100	217,778.93	154,816.00	-
000543	皖能电力	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	21.36	2015 年 7 月	19.22	7,224	90,110.74	154,304.64	-

					14 日						
000650	仁和药业	2015 年 6 月 12 日	因重大事 项停牌	17.17	-	-	8,986	65,918.45	154,289.62	-	
002325	洪涛股 份	2015 年 6 月 3 日	因重大事 项停牌	31.15	-	-	4,846	74,876.10	150,952.90	-	
002368	太极股 份	2015 年 5 月 14 日	因重大事 项停牌	65.52	-	-	2,280	68,389.50	149,385.60	-	
600175	美都能 源	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	10.64	2015 年 7 月 20 日	9.58	14,015	90,778.69	149,119.60	-	
600967	北方创 业	2015 年 4 月 13 日	因重大事 项停牌	17.12	-	-	8,501	123,870.75	145,537.12	-	
002308	威创股 份	2015 年 6 月 12 日	因重大事 项停牌	31.00	-	-	4,593	52,101.42	142,383.00	-	
600482	风帆股 份	2015 年 5 月 28 日	因重大事 项停牌	42.38	-	-	3,285	45,017.86	139,218.30	-	
001696	宗申动 力	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	17.25	2015 年 8 月 24 日	15.53	8,000	93,051.25	138,000.00	-	
601311	骆驼股 份	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	28.20	2015 年 7 月 15 日	25.38	4,876	88,490.11	137,503.20	-	
600366	宁波韵 升	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	35.09	2015 年 8 月 12 日	31.58	3,845	65,088.54	134,921.05	-	
000786	北新建 材	2015 年 4 月 10 日	因重大事 项停牌	18.58	-	-	7,038	84,648.51	130,766.04	-	
000959	首钢股 份	2015 年 4 月 23 日	因重大事 项停牌	6.15	-	-	19,800	92,758.94	121,770.00	-	
002309	中利科 技	2015 年 6 月 2 日	因重大事 项停牌	33.39	2015 年 7 月 21 日	30.05	3,600	78,360.67	120,204.00	-	
000979	中弘股 份	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	6.04	-	-	19,690	50,208.53	118,927.60	-	
002665	首航节 能	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	27.70	2015 年 7 月 1 日	30.00	4,150	86,011.21	114,955.00	-	
000519	江南红 箭	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	26.06	-	-	4,200	83,287.66	109,452.00	-	
600416	湘电股 份	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	22.64	2015 年 7 月 20 日	20.35	4,532	53,608.33	102,604.48	-	
002414	高德红 外	2015 年 5 月 13 日	因重大事 项停牌	39.36	-	-	2,592	56,510.30	102,021.12	-	

002106	莱宝高科	2015 年 4 月 7 日	因重大事 项停牌	16.42	-	-	6,200	87,715.80	101,804.00	-
000697	炼石有色	2015 年 5 月 18 日	因重大事 项停牌	33.83	-	-	2,922	51,467.98	98,851.26	-
000669	金鸿能源	2015 年 5 月 4 日	因重大事 项停牌	37.72	2015 年 7 月 23 日	33.95	2,470	65,304.56	93,168.40	-
002269	美邦服饰	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	11.86	2015 年 7 月 2 日	10.67	7,500	35,433.37	88,950.00	-
000788	北大医药	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	20.72	2015 年 7 月 21 日	18.65	4,277	67,639.65	88,619.44	-
600790	轻纺城	2015 年 5 月 25 日	因重大事 项停牌	13.38	2015 年 8 月 18 日	12.04	6,474	40,119.01	86,622.12	-
002143	印纪传媒	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	32.01	2015 年 7 月 1 日	33.50	2,500	99,401.00	80,025.00	-
600702	沱牌舍得	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	26.11	2015 年 8 月 20 日	28.00	3,064	54,485.46	80,001.04	-
002727	一心堂	2015 年 4 月 13 日	因重大事 项停牌	78.24	2015 年 8 月 17 日	70.42	1,000	53,269.78	78,240.00	-
600335	国机汽车	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	37.93	2015 年 7 月 21 日	34.14	2,001	42,145.67	75,897.93	-
600078	澄星股份	2015 年 6 月 9 日	因重大事 项停牌	15.23	2015 年 7 月 1 日	13.71	4,800	38,314.22	73,104.00	-
000688	建新矿业	2015 年 6 月 10 日	因重大事 项停牌	17.07	-	-	4,153	33,064.45	70,891.71	-
002242	九阳股份	2015 年 6 月 15 日	因重大事 项停牌	19.45	2015 年 7 月 7 日	17.51	3,449	42,647.80	67,083.05	-
002345	潮宏基	2015 年 5 月 22 日	因重大事 项停牌	19.58	-	-	3,380	32,095.71	66,180.40	-
002461	珠江啤酒	2015 年 6 月 4 日	因重大事 项停牌	26.40	2015 年 7 月 24 日	23.76	2,498	39,398.11	65,947.20	-
000850	华茂股份	2015 年 5 月 7 日	因重大事 项停牌	10.98	-	-	5,875	37,608.45	64,507.50	-
002574	明牌珠宝	2015 年 6 月 4 日	因重大事 项停牌	22.90	-	-	2,680	34,739.54	61,372.00	-
600869	智慧能源	2015 年 5 月 11 日	因重大事 项停牌	29.14	2015 年 7 月	26.23	2,036	20,519.63	59,329.04	-

					31 日						
002069	獐子岛	2015 年 6 月 1 日	因重大事 项停牌	19.76	-	-	2,971	40,392.95	58,706.96	-	
002226	江南化工	2015 年 6 月 8 日	因重大事 项停牌	13.18	-	-	3,958	29,223.47	52,166.44	-	
002194	武汉凡谷	2015 年 6 月 18 日	因重大事 项停牌	26.98	2015 年 7 月 24 日	24.28	1,893	25,078.10	51,073.14	-	
000693	华泽钴镍	2015 年 6 月 30 日	因重大事 项停牌	20.57	2015 年 8 月 18 日	22.63	2,442	72,763.92	50,231.94	-	
002203	海亮股份	2015 年 4 月 27 日	因重大事 项停牌	12.71	-	-	3,768	26,405.80	47,891.28	-	
002091	江苏国泰	2015 年 6 月 1 日	因重大事 项停牌	26.22	-	-	1,800	27,591.73	47,196.00	-	
002238	天威视讯	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	23.76	-	-	1,722	24,159.28	40,914.72	-	
002557	洽洽食品	2015 年 6 月 29 日	因重大事 项停牌	16.38	-	-	2,347	33,170.95	38,443.86	-	
600333	长春燃气	2015 年 5 月 29 日	因重大事 项停牌	11.97	2015 年 7 月 9 日	10.77	2,704	21,282.44	32,366.88	-	
002662	京威股份	2015 年 5 月 15 日	因重大事 项停牌	17.84	2015 年 8 月 13 日	16.06	1,695	19,476.92	30,238.80	-	
600575	皖江物流	2014 年 9 月 9 日	因重大事 项停牌	4.11	-	-	4,546	16,441.53	18,684.06	-	
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	因重大事 项停牌	4.64	-	-	2,604	11,688.51	12,082.56	-	

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

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 45,388,384.66 元，属于第二层次的余额为 10,032,306.13 元，无属于第三层次的余额(于 2014 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属于第一层次的余额为 46,373,239.55 元，属于第二层次的余额为 2,887,162.37 元，无属于第三层次的余额)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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 2015 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(2014 年 12 月 31 日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (2) 基金申购款

于 2015 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 22,769,910.85 元，其中包括以股票支付的申购款 20,039,073.30 元和以现金支付的申购款 2,730,837.55 元(2014 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 29,688,119.63 元，其中包括以股票支付的申购款

27,293,285.00 元和以现金支付的申购款 2,394,834.63 元。)

(3)除公允价值和基金申购款外，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	55,420,690.79	97.45
	其中：股票	55,420,690.79	97.45
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	1,416,355.63	2.49
7	其他各项资产	33,503.08	0.06
8	合计	56,870,549.50	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	844,427.56	1.50
B	采矿业	1,480,370.77	2.62
C	制造业	32,779,440.51	58.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,739,942.33	3.08
E	建筑业	1,240,315.36	2.20
F	批发和零售业	3,764,075.92	6.67
G	交通运输、仓储和邮政业	1,748,319.52	3.10
H	住宿和餐饮业	65,589.80	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,177,379.90	5.63
J	金融业	457,291.22	0.81
K	房地产业	4,018,715.84	7.12
L	租赁和商务服务业	1,438,822.74	2.55
M	科学研究和技术服务业	325,178.20	0.58

N	水利、环境和公共设施管理业	314,151.57	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	159,486.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,096,364.32	1.94
S	综合	770,819.23	1.37
	合计	55,420,690.79	98.25

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 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	002183	怡亚通	5,682	415,638.30	0.74
2	600978	宜华木业	13,800	309,672.00	0.55
3	600410	华胜天成	6,288	300,817.92	0.53
4	002405	四维图新	6,419	281,152.20	0.50
5	601718	际华集团	17,947	271,358.64	0.48
6	600881	亚泰集团	21,110	268,308.10	0.48
7	000748	长城信息	7,600	265,088.00	0.47
8	600895	张江高科	9,000	261,990.00	0.46
9	600037	歌华有线	8,077	254,425.50	0.45
10	000566	海南海药	5,059	252,798.23	0.45

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

### 7.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	600446	金证股份	399,552.22	0.78
2	000592	平潭发展	304,580.00	0.60
3	600500	中化国际	295,048.00	0.58
4	300033	同花顺	289,445.00	0.57
5	600143	金发科技	289,319.00	0.57
6	002400	省广股份	288,484.90	0.57
7	600655	豫园商城	286,671.00	0.56
8	600079	人福医药	271,606.00	0.53
9	600594	益佰制药	269,907.00	0.53
10	300199	翰宇药业	256,045.00	0.50
11	000547	闽福发 A	255,259.00	0.50
12	300244	迪安诊断	232,430.00	0.46
13	600498	烽火通信	229,615.00	0.45
14	300291	华录百纳	217,778.93	0.43
15	600880	博瑞传播	209,561.00	0.41
16	300274	阳光电源	204,857.00	0.40
17	600664	哈药股份	201,244.00	0.39
18	600058	五矿发展	193,311.00	0.38
19	002195	二三四五	188,686.10	0.37
20	600436	片仔癀	184,300.00	0.36

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	300059	东方财富	1,223,937.04	2.40
2	300168	万达信息	640,514.00	1.26
3	601099	太平洋	477,585.10	0.94
4	600820	隧道股份	397,490.94	0.78
5	601519	大智慧	317,285.23	0.62
6	000977	浪潮信息	250,768.80	0.49
7	000712	锦龙股份	243,799.60	0.48
8	601872	招商轮船	242,223.28	0.48
9	600490	鹏欣资源	204,354.95	0.40
10	600266	北京城建	201,636.00	0.40
11	600098	广州发展	189,154.00	0.37

12	600317	营口港	185,666.00	0.36
13	002690	美亚光电	184,283.44	0.36
14	600582	天地科技	175,683.86	0.34
15	000050	深天马 A	147,846.23	0.29
16	600432	吉恩镍业	143,827.60	0.28
17	002052	同洲电子	127,827.00	0.25
18	000627	天茂集团	121,319.12	0.24
19	000555	神州信息	113,377.00	0.22
20	600239	云南城投	110,843.46	0.22

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	14,034,980.34
卖出股票收入（成交）总额	12,060,243.66

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 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。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 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，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 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

1、吉林亚泰（集团）股份有限公司（下称：亚泰集团，股票代码：600881）于 2014 年 9 月 10 日发布公告，其控股子公司—吉林亚泰集团水泥销售有限公司因与具有竞争关系的经营者达成并实施了价格垄断协议的行为，收到吉林省物价局《行政处罚决定书》（吉省价处【2014】9 号）。吉林亚泰集团水泥销售有限公司被处以 2012 年度销售额 30.02 亿元 2%的罚款 6004 万元，占公司 2013 年度经审计归属于母公司所有者净利润的 20.42%（已扣除少数股东损益）。

因本报告期末亚泰集团属于中证 500 指数成分股，而本基金通过完全复制中证 500 指数成分股进行被动式指数化投资，因此持有亚泰集团。

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。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,890.70

2	应收证券清算款	31,353.83
3	应收股利	-
4	应收利息	258.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,503.08

#### 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	002183	怡亚通	415,638.30	0.74	因重大事项停牌
2	600978	宜华木业	309,672.00	0.55	因重大事项停牌
3	600410	华胜天成	300,817.92	0.53	因重大事项停牌
4	601718	际华集团	271,358.64	0.48	因重大事项停牌
5	000748	长城信息	265,088.00	0.47	因重大事项停牌
6	000566	海南海药	252,798.23	0.45	因重大事项停牌

##### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## §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
221	111,189.85	20,391,384.00	82.98%	4,181,572.00	17.02%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	阳光人寿保险股份有限公司-传统保险产品	5,000,000.00	20.35%
2	新华人寿保险股份有限公司	4,800,000.00	19.53%
3	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	4,510,000.00	18.35%
4	工银安盛人寿保险有限公司	3,331,100.00	13.56%
5	李更	1,580,000.00	6.43%
6	中信证券股份有限公司	1,040,983.00	4.24%
7	湖南省电力公司企业年金计划-中国光大银行股份有限公司	983,200.00	4.00%
8	贾建军	538,300.00	2.19%
9	中国银河证券股份有限公司	400,000.00	1.63%
10	上海龙苍投资有限公司	309,000.00	1.26%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

## 8.4 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（2013年12月26日）基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	36,572,956.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
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	24,572,956.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

2、2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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	

长城证券股份 有限公司	2	13,126,642.87	50.33%	11,950.60	50.33%	-
中国银河证券 股份有限公司	1	12,955,401.53	49.67%	11,794.67	49.67%	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本期交易单元未变更。

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
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## §11 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  
2015 年 8 月 29 日