

景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 景顺长城精选蓝筹混合 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 260110 |
| 交易代码 | 260110 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007 年 6 月 18 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,740,351,598.76 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 重点投资于具有较高内在投资价值的大型蓝筹上市公司，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，以市值规模和流动性为基础，重点投资于在行业内居于领导地位、具有较强的盈利能力和分红派现能力的稳健蓝筹公司以及在行业内具有较强竞争优势、成长性好的成长蓝筹公司。针对上述两类公司股票价格驱动因素的不同，本基金分别以价值和 GARP (Growth at Reasonable Price) 原则为基础，精选出具有投资价值的股票构建股票组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是风险程度高的投资品种。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95588 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-66105798 |

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 226,533,789.79 |
| 本期利润 | 641,056,926.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2284 |
| 本期基金份额净值增长率 | 23.06% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2218 |
| 期末基金资产净值 | 3,348,290,959.01 |
| 期末基金份额净值 | 1.222 |

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

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

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

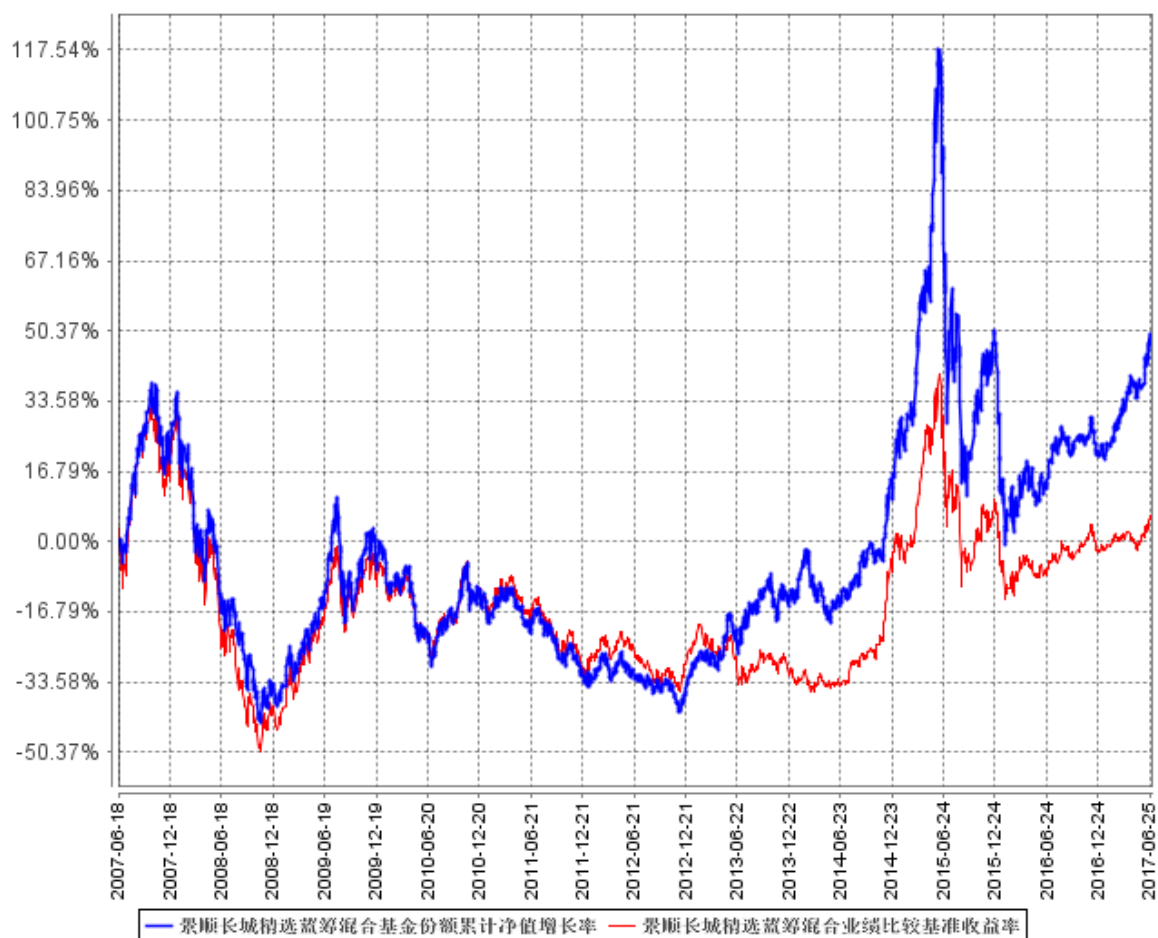
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 8.53% | 0.98% | 4.19% | 0.54% | 4.34% | 0.44% |
| 过去三个月 | 12.52% | 0.84% | 4.84% | 0.50% | 7.68% | 0.34% |
| 过去六个月 | 23.06% | 0.75% | 8.42% | 0.46% | 14.64% | 0.29% |
| 过去一年 | 28.09% | 0.78% | 12.75% | 0.54% | 15.34% | 0.24% |
| 过去三年 | 69.55% | 1.87% | 59.38% | 1.40% | 10.17% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.03% | 1.66% | 5.94% | 1.47% | 43.09% | 0.19% |

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 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-30%，权证投资 0%-3%。本基金自 2007 年 6 月 18 日合同生效日起至 2007 年 12 月 17 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合比例均达到上述要求。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至2017年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理67只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城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 | | |
| 余广 | 本基金的基金经理、股票投资部投资总监 | 2014 年 10 月 28 日 | - | 13 年 | 银行和金融工商管理硕士，中国注册会计师。曾先后担任蛇口中华会计师事务所审计项目经理、杭州中融投资管理有限公司财务顾问项目经理、世纪证券综合研究所研究员、中银国际（中国）证券风险管理部高级经理等职务。2005 年 1 月加入本公司，担任研究员等职务；自 2010 年 5 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、余广先生于 2016 年 2 月 3 日离任景顺长城优势企业混合型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、《景顺长城精选蓝筹混合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，国内 PMI 连续 10 个月处于荣枯线上方，通胀由于翘尾因素或将回升，中国出口依然向好，消费增速平稳，投资边际走弱，但尚在预计范围内，整体上看宏观经济基本面走

势平稳。微观上看，企业盈利改善依然有韧性，虽然产成品库存已开始筑顶回落，工业生产有一定向下压力，叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升，未来经济增长将从高点有所放缓，但整体下降幅度可控。

同时全球主要经济体复苏明显，美国失业率处于低位，PMI 回升但通胀有所回落，美联储 6 月份加息落地，预计年内开始缩表并可能有一次加息，整体流动性收缩依然为渐进式，对于金融市场的影响相对平缓。欧央行维持基准利率不变，预计未来将进一步释放缩减 QE 的细节。日本央行继续按兵不动，维持超宽松政策将有助于日本通胀目标的实现。

上半年 A 股市场表现结构分化明显，沪深 300 指数上涨 10.78%，而创业板指下跌 10.12%。绩优蓝筹股表现亮丽。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为 23.06%，业绩比较基准收益率为 8.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下一阶段，虽然受到库存周期和房地产周期的拖累，宏观经济增长略有放缓，但整体经济企稳的态势并没有改变，特别是稳健的消费增长和较强的装备制造业投资对经济形成了较好的支撑，再加上海外主要经济体复苏，进一步刺激出口积极增长。金融继续去杠杆、利率抬升预计对市场形成一定的压力。我们对 A 股市场看法较为谨慎的同时，对其中的绩优蓝筹股继续看好。

均衡配置的风格将在下一个阶段延续，选股一直是我们的投资流程的关键，本基金将坚持自下而上选股，买入持有质地优良、管理优秀以及估值合理的蓝筹股，以期获取长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

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

和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

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

2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

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

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金 2017 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 152,894,500.81 | 93,623,765.05 |
| 结算备付金 | 918,725.32 | 896,586.25 |
| 存出保证金 | 448,625.35 | 363,069.57 |
| 交易性金融资产 | 3,151,599,781.20 | 2,597,147,865.90 |
| 其中：股票投资 | 3,081,508,781.20 | 2,476,559,865.90 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 70,091,000.00 | 120,588,000.00 |
| 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 | 48,500,144.25 | 160,992,361.49 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 2,995,593.92 | 2,593,864.62 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 630,209.10 | 285,012.57 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 3,357,987,579.95 | 2,855,902,525.45 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2017 年 6 月 30 日 | 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 | - | - |
| 应付赎回款 | 3,353,648.83 | 1,425,522.41 |
| 应付管理人报酬 | 3,988,262.79 | 3,706,949.51 |
| 应付托管费 | 664,710.47 | 617,824.92 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,349,857.46 | 456,889.70 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 应交税费 | 30,899.80 | 30,899.80 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 309,241.59 | 210,097.00 |
| 负债合计 | 9,696,620.94 | 6,448,183.34 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 2,740,351,598.76 | 2,870,421,907.71 |
| 未分配利润 | 607,939,360.25 | -20,967,565.60 |
| 所有者权益合计 | 3,348,290,959.01 | 2,849,454,342.11 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,357,987,579.95 | 2,855,902,525.45 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.222 元，基金份额总额

2,740,351,598.76 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| 一、收入 | 672,897,639.17 | -650,712,239.04 |
| 1.利息收入 | 3,175,063.96 | 3,521,670.98 |
| 其中：存款利息收入 | 664,241.37 | 861,236.29 |
| 债券利息收入 | 1,644,879.80 | 1,989,816.77 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 865,942.79 | 670,617.92 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 255,143,318.37 | -213,755,354.51 |
| 其中：股票投资收益 | 237,370,347.35 | -231,323,381.81 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 18,000.00 | 13,430.00 |
| 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 | 17,754,971.02 | 17,554,597.30 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 414,523,136.99 | -440,564,313.18 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 56,119.85 | 85,757.67 |
| 减：二、费用 | 31,840,712.39 | 29,331,129.60 |

| | | |
|---------------------|----------------|-----------------|
| 1. 管理人报酬 | 22,640,965.71 | 21,205,810.58 |
| 2. 托管费 | 3,773,494.30 | 3,534,301.76 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 5,192,173.48 | 4,339,842.28 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 234,078.90 | 251,174.98 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 641,056,926.78 | -680,043,368.64 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 641,056,926.78 | -680,043,368.64 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 2,870,421,907.71 | -20,967,565.60 | 2,849,454,342.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 641,056,926.78 | 641,056,926.78 |
| 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) | -130,070,308.95 | -12,150,000.93 | -142,220,309.88 |
| 其中：1.基金申购款 | 53,181,042.52 | 6,157,399.38 | 59,338,441.90 |
| 2.基金赎回款 | -183,251,351.47 | -18,307,400.31 | -201,558,751.78 |
| 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) | 2,740,351,598.76 | 607,939,360.25 | 3,348,290,959.01 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|------------------|------------------|------------------|
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 2,791,156,523.54 | 1,136,307,877.20 | 3,927,464,400.74 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | -680,043,368.64 | -680,043,368.64 |
| 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) | 214,151,773.03 | -26,224,813.26 | 187,926,959.77 |
| 其中：1.基金申购款 | 361,574,489.68 | -32,563,793.02 | 329,010,696.66 |
| 2.基金赎回款 | -147,422,716.65 | 6,338,979.76 | -141,083,736.89 |
| 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) | - | -569,577,256.16 | -569,577,256.16 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 3,005,308,296.57 | -139,537,560.86 | 2,865,770,735.71 |

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

景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]159文《关于同意景顺长城精选蓝筹股票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作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2007年6月18日正式生效,首次设立募集规模为14,722,378,815.70份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,注册登记人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据2014年8月8日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)

第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例下限由 60%上调至 80%，景顺长城基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 5 日起将景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金变更为本基金。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产的 70%-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例范围为基金资产的 5%-30%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金重点投资于具有较高内在投资价值的大型蓝筹上市公司，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×20%。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 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

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间均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

本基金本期和上年度可比期间均无应付关联方佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 22,640,965.71 | 21,205,810.58 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 4,467,982.60 | 4,187,196.26 |

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 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,773,494.30 | 3,534,301.76 |

注：基金管理人的托管费每日计算，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 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.8.3 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。

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。

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

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。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|--------|--------------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 152,894,500.81 | 635,998.29 | 88,667,242.21 | 831,994.21 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

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的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.9.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002879 | 长缆科技 | 2017年6月5日 | 2017年7月7日 | 新股流通受限 | 18.02 | 18.02 | 1,313 | 23,660.26 | 23,660.26 | - |
| 002882 | 金龙羽 | 2017年6月15日 | 2017年7月17日 | 新股流通受限 | 6.20 | 6.20 | 2,966 | 18,389.20 | 18,389.20 | - |
| 603933 | 睿能科技 | 2017年6月28日 | 2017年7月6日 | 新股流通受限 | 20.20 | 20.20 | 857 | 17,311.40 | 17,311.40 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017年6月 | 2017年 | 新股流通受限 | 11.26 | 11.26 | 1,351 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |

| | | 30 日 | 7 月 10 日 | | | | | | | |
|--------|------|-----------------------|-----------------------|------------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 300670 | 大烨智能 | 2017 年 6 月 26 日 | 2017 年 7 月 3 日 | 新股流 通受限 | 10.93 | 10.93 | 1,259 | 13,760.87 | 13,760.87 | - |
| 300672 | 国科微 | 2017 年 6 月 30 日 | 2017 年 7 月 12 日 | 新股流 通受限 | 8.48 | 8.48 | 1,257 | 10,659.36 | 10,659.36 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017 年 6 月 27 日 | 2017 年 7 月 5 日 | 新股流 通受限 | 9.63 | 9.63 | 999 | 9,620.37 | 9,620.37 | - |
| 300671 | 富满电子 | 2017 年 6 月 27 日 | 2017 年 7 月 5 日 | 新股流 通受限 | 8.11 | 8.11 | 942 | 7,639.62 | 7,639.62 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017 年 6 月 23 日 | 2017 年 7 月 3 日 | 新股流 通受限 | 8.93 | 8.93 | 832 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，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

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 06 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 3,081,385,098.10 元，划分为第二层次的余额为人民币 70,214,683.10 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 2,476,070,181.39 元，划分为第二层次的余额为人民币 121,077,684.51 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 | 3,081,508,781.20 | 91.77 |
| | 其中：股票 | 3,081,508,781.20 | 91.77 |
| 2 | 固定收益投资 | 70,091,000.00 | 2.09 |
| | 其中：债券 | 70,091,000.00 | 2.09 |
| | 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 | 48,500,144.25 | 1.44 |
| | 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 | 153,813,226.13 | 4.58 |
| 7 | 其他各项资产 | 4,074,428.37 | 0.12 |
| 8 | 合计 | 3,357,987,579.95 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|------------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 27,220,000.00 | 0.81 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,890,210,932.73 | 56.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 458,304,272.99 | 13.69 |
| E | 建筑业 | 38,778.24 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 108,901,393.92 | 3.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 39,298,891.40 | 1.17 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 88,757,639.62 | 2.65 |
| J | 金融业 | 198,631,713.85 | 5.93 |
| K | 房地产业 | 270,145,158.45 | 8.07 |
| 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 | 3,081,508,781.20 | 92.03 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 6,000,000 | 247,020,000.00 | 7.38 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 5,000,000 | 215,200,000.00 | 6.43 |
| 3 | 002572 | 索菲亚 | 5,000,000 | 205,000,000.00 | 6.12 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 4,000,076 | 198,443,770.36 | 5.93 |
| 5 | 002035 | 华帝股份 | 8,000,029 | 193,600,701.80 | 5.78 |
| 6 | 001979 | 招商蛇口 | 8,000,000 | 170,880,000.00 | 5.10 |
| 7 | 600674 | 川投能源 | 16,000,000 | 157,120,000.00 | 4.69 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 2,499,990 | 139,149,443.40 | 4.16 |
| 9 | 600900 | 长江电力 | 8,000,000 | 123,040,000.00 | 3.67 |
| 10 | 600993 | 马应龙 | 5,000,064 | 108,901,393.92 | 3.25 |

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 187,284,748.89 | 6.57 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 177,253,151.86 | 6.22 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 121,054,369.05 | 4.25 |
| 4 | 600886 | 国投电力 | 113,271,654.12 | 3.98 |
| 5 | 600048 | 保利地产 | 99,202,719.01 | 3.48 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 6 | 600329 | 中新药业 | 91,387,193.99 | 3.21 |
| 7 | 601688 | 华泰证券 | 88,093,121.94 | 3.09 |
| 8 | 601689 | 拓普集团 | 84,170,677.16 | 2.95 |
| 9 | 000423 | 东阿阿胶 | 81,377,040.01 | 2.86 |
| 10 | 600116 | 三峡水利 | 77,507,552.37 | 2.72 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 59,018,950.49 | 2.07 |
| 12 | 002192 | 融捷股份 | 57,640,791.93 | 2.02 |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 55,328,150.14 | 1.94 |
| 14 | 300124 | 汇川技术 | 48,762,085.78 | 1.71 |
| 15 | 000418 | 小天鹅 A | 46,574,234.49 | 1.63 |
| 16 | 600993 | 马应龙 | 42,840,465.13 | 1.50 |
| 17 | 600109 | 国金证券 | 40,966,299.00 | 1.44 |
| 18 | 601211 | 国泰君安 | 37,088,846.86 | 1.30 |
| 19 | 300136 | 信维通信 | 31,589,605.71 | 1.11 |
| 20 | 002714 | 牧原股份 | 27,650,595.53 | 0.97 |

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 | 600104 | 上汽集团 | 197,482,345.62 | 6.93 |
| 2 | 000625 | 长安汽车 | 141,189,283.79 | 4.95 |
| 3 | 600741 | 华域汽车 | 115,747,318.52 | 4.06 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 110,448,466.64 | 3.88 |
| 5 | 600340 | 华夏幸福 | 93,981,729.75 | 3.30 |
| 6 | 300145 | 中金环境 | 92,412,796.59 | 3.24 |
| 7 | 001979 | 招商蛇口 | 87,494,879.17 | 3.07 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 86,945,915.69 | 3.05 |
| 9 | 300070 | 碧水源 | 77,928,252.86 | 2.73 |
| 10 | 000333 | 美的集团 | 66,765,676.92 | 2.34 |
| 11 | 600804 | 鹏博士 | 64,270,228.41 | 2.26 |
| 12 | 002557 | 洽洽食品 | 54,993,861.60 | 1.93 |
| 13 | 300124 | 汇川技术 | 51,329,699.82 | 1.80 |
| 14 | 600854 | 春兰股份 | 41,545,125.51 | 1.46 |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 39,612,326.84 | 1.39 |
| 16 | 601211 | 国泰君安 | 38,441,528.57 | 1.35 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 600109 | 国金证券 | 34,327,376.00 | 1.20 |
| 18 | 600566 | 济川药业 | 32,888,153.36 | 1.15 |
| 19 | 002508 | 老板电器 | 32,426,934.16 | 1.14 |
| 20 | 601333 | 广深铁路 | 31,547,196.58 | 1.11 |

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 | 1,677,899,747.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,725,359,317.00 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 70,091,000.00 | 2.09 |
| | 其中：政策性金融债 | 70,091,000.00 | 2.09 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 70,091,000.00 | 2.09 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 140220 | 14 国开 20 | 700,000 | 70,091,000.00 | 2.09 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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 | 448,625.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,995,593.92 |
| 5 | 应收申购款 | 630,209.10 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,074,428.37 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|------------|------------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 181,302 | 15,114.84 | 210,964,377.36 | 7.70% | 2,529,387,221.40 | 92.30% |

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 | 7,139.51 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2007年6月18日）基金份额总额 | 14,722,378,815.70 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,870,421,907.71 |
| 本报告期基金总申购份额 | 53,181,042.52 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 183,251,351.47 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,740,351,598.76 |

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

在本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|-------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 兴业证券股 | 2 | 1,133,957,819.91 | 33.36% | 1,056,055.67 | 33.36% | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|----------------|--------|------------|--------|----|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 恒泰证券股份 有限公司 | 2 | 674,630,012.26 | 19.85% | 628,287.57 | 19.85% | 新增 |
| 平安证券股份 有限公司 | 1 | 572,838,938.08 | 16.85% | 533,487.29 | 16.85% | - |
| 长江证券股份 有限公司 | 1 | 352,521,440.83 | 10.37% | 328,300.22 | 10.37% | - |
| 广发证券股份 有限公司 | 1 | 274,687,745.92 | 8.08% | 255,818.43 | 8.08% | - |
| 安信证券股份 有限公司 | 2 | 207,983,216.24 | 6.12% | 193,695.36 | 6.12% | - |
| 海通证券股份 有限公司 | 1 | 108,311,541.92 | 3.19% | 100,870.90 | 3.19% | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | 1 | 69,303,073.04 | 2.04% | 64,540.52 | 2.04% | - |
| 天风证券股份 有限公司 | 1 | 4,523,878.22 | 0.13% | 4,213.03 | 0.13% | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正证 券有限责任 公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |
| 瑞银证券有 限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 券有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股 份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|----|
| 公司 | | | | | | |
| 长城证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 新增 |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | 191,800,000.00 | 17.97% | - | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | - | - | 365,800,000.00 | 34.26% | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | 250,000,000.00 | 23.42% | - | - |
| 广发证券股份有限公司 | - | - | 160,000,000.00 | 14.99% | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|----------------|-------|---|---|
| 安信证券股份 有限公司 | - | - | 100,000,000.00 | 9.37% | - | - |
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日