

上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52

10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城上证 180 等权重 ETF
场内简称	180EWETF
基金主代码	510420
交易代码	510420
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 12 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	56,455,541.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 7 月 9 日

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的最小化。
投资策略	本基金以上证 180 等权重指数为标的指数，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（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）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（同行业股票优先考虑），以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。
业绩比较基准	上证 180 等权重指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法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	杨崑阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		杨光裕	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	-2,419,936.00
本期利润	4,230,201.88
加权平均基金份额本期利润	0.0680
本期加权平均净值利润率	4.60%
本期基金份额净值增长率	3.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	18,462,859.23
期末可供分配基金份额利润	0.3270
期末基金资产净值	84,799,384.10
期末基金份额净值	1.502
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	50.20%

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

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

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

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

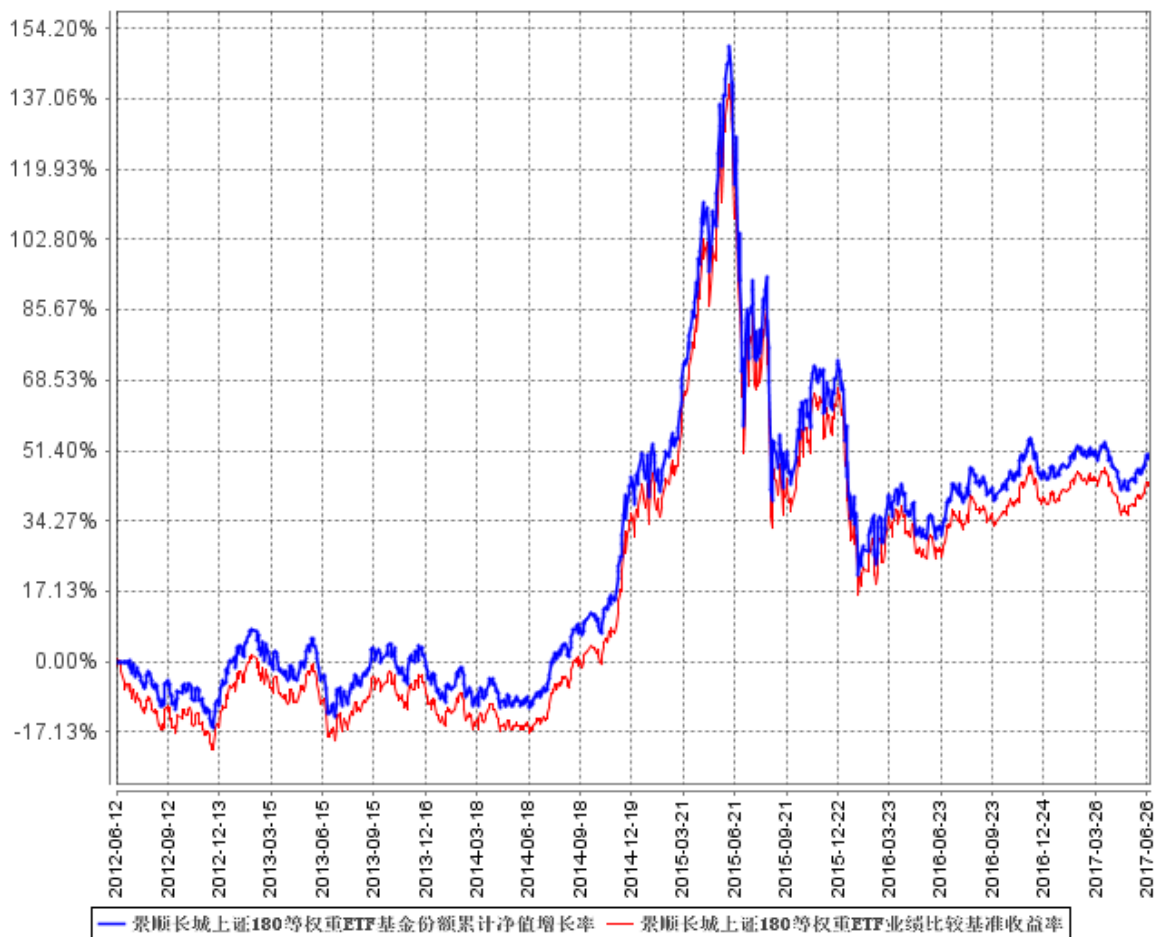
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.87%	0.50%	3.66%	0.52%	0.21%	-0.02%
过去三个月	0.60%	0.58%	0.32%	0.59%	0.28%	-0.01%
过去六个月	3.87%	0.55%	3.68%	0.56%	0.19%	-0.01%
过去一年	11.67%	0.69%	11.43%	0.70%	0.24%	-0.01%
过去三年	64.51%	1.85%	68.93%	1.87%	-4.42%	-0.02%

自基金合同生效起至今	50.20%	1.64%	43.55%	1.67%	6.65%	-0.03%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

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：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合法律法规或监管机构的相关规定，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2012 年 6 月 12 日基金合同生效日起 3 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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2017年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理67只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证800食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置

混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城景瑞双利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城景盈汇利债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐喻军	本基金的基金经理	2014 年 4 月 19 日	-	7 年	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等

有关法律法规及各项实施准则、《上证 180 等权重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

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，为公司旗下三只指数基金因指数成份股调整而发生的反向交易以及量化基金、指数增强基金根据基金合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间临近交易日虽然存在同向交易和反向交易行为，但结合交易时机和交易价差分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 7.6%，增速维持稳定。6 月制造业 PMI 指数 51.7，在出口的拉动下出现短期回升；6 月 PPI 同比上涨 5.5%，环比下降 0.2%，同比涨幅缩小；6 月 CPI 同比上涨 1.5%，涨幅略有上升，通胀预期维持平稳。货币政策基调防风险，市场流动性继续维持中性。2017 年上半年市场出现分化行情，沪深 300 指数大幅跑赢创业板指数，业绩稳定的蓝筹股和部分具备竞争优势的白马成长股持续受到市场关注，靠并购和外延增长的高估值股票表现不好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为 3.87%，业绩比较基准收益率为 3.68%。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

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

本基金采用完全复制上证 180 等权重指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

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。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在上证 180 等权重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：上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,816,448.26	835,388.90
结算备付金		673.44	1,406.11
存出保证金		1,420.94	1,589.74
交易性金融资产	6.4.7.2	83,405,218.20	105,673,515.11
其中：股票投资		83,405,218.20	105,673,515.11
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	312.65	269.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		85,224,073.49	106,512,169.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		34,422.15	46,014.83
应付托管费		6,884.44	9,202.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	25,111.53	29,664.42

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	358,271.27	210,000.00
负债合计		424,689.39	294,882.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	56,455,541.00	73,455,541.00
未分配利润	6.4.7.10	28,343,843.10	32,761,746.00
所有者权益合计		84,799,384.10	106,217,287.00
负债和所有者权益总计		85,224,073.49	106,512,169.22

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.502元，基金份额总额56,455,541.00份。

6.2 利润表

会计主体：上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
一、收入		4,860,984.84	-43,881,048.69
1.利息收入		4,828.05	9,327.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,819.86	9,327.61
债券利息收入		8.19	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,793,129.09	-28,925,645.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,431,998.11	-30,216,762.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	3,133.51	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	635,735.51	1,291,116.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,650,137.88	-14,986,988.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-852.00	22,258.38
减：二、费用		630,782.96	930,604.07

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	229,641.88	444,941.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,928.42	88,988.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	46,571.39	87,121.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	308,641.27	309,552.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,230,201.88	-44,811,652.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,230,201.88	-44,811,652.76

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金

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）	73,455,541.00	32,761,746.00	106,217,287.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,230,201.88	4,230,201.88
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）	-17,000,000.00	-8,648,104.78	-25,648,104.78
其中：1. 基金申购款	1,000,000.00	455,196.18	1,455,196.18
2. 基金赎回款	-18,000,000.00	-9,103,300.96	-27,103,300.96
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）	56,455,541.00	28,343,843.10	84,799,384.10
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）	142,455,541.00	94,619,706.42	237,075,247.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,811,652.76	-44,811,652.76
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）	-52,000,000.00	-18,578,041.62	-70,578,041.62
其中：1. 基金申购款	31,000,000.00	11,877,357.32	42,877,357.32
2. 基金赎回款	-83,000,000.00	-30,455,398.94	-113,455,398.94
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）	90,455,541.00	31,230,012.04	121,685,553.04

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

上证 180 等权重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[2012]第 103 号《关于核准上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《上证 180 等权重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 1,270,430,139.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 159 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 12 日正式生效,基金合同

生效日的基金份额总额为 1,270,455,541.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 25,402.00 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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]第 17 号文审核同意,本基金 1,270,455,541.00 份基金份额于 2012 年 7 月 9 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 等权重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上证 180 等权重指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化;主要投资范围为上证 180 等权重指数的成份股、备选成份股,在建仓完成后,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;本基金可少量投资于新股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合法律法规或监管机构的相关规定,该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。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上证 180 等权重指数。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城上证 180 等权重 ETF 联接基金”)。景顺长城上证 180 等权重 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2017 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协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 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁

后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,816,448.26
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,816,448.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	88,466,148.75	83,405,218.20	-5,060,930.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	88,466,148.75	83,405,218.20	-5,060,930.55

注：于 2017 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本期末的买入返售金融资产项目余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	311.84
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.27
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.54
合计	312.65

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	25,111.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	25,111.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	308,271.27
应付指数使用费	50,000.00
合计	358,271.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,455,541.00	73,455,541.00
本期申购	1,000,000.00	1,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-18,000,000.00	-18,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	56,455,541.00	56,455,541.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,937,026.32	5,824,719.68	32,761,746.00
本期利润	-2,419,936.00	6,650,137.88	4,230,201.88
本期基金份额交易产生的变动数	-6,054,231.09	-2,593,873.69	-8,648,104.78
其中：基金申购款	365,940.02	89,256.16	455,196.18
基金赎回款	-6,420,171.11	-2,683,129.85	-9,103,300.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,462,859.23	9,880,983.87	28,343,843.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	4,574.69

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	235.91
其他	9.26
合计	4,819.86

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-557,169.83
股票投资收益——赎回差价收入	-1,874,828.28
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,431,998.11

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	16,523,164.55
减：卖出股票成本总额	17,080,334.38
买卖股票差价收入	-557,169.83

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	27,103,300.96
减：现金支付赎回款总额	254,374.96
减：赎回股票成本总额	28,723,754.28
赎回差价收入	-1,874,828.28

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,141.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	89,000.00
减：应收利息总额	8.19
买卖债券差价收入	3,133.51

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期的衍生工具收益项目发生额为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	635,735.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	635,735.51

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	6,650,137.88
——股票投资	6,650,137.88
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	6,650,137.88

注：本基金本会计期间公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	-852.00
合计	-852.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	46,571.39
银行间市场交易费用	-
合计	46,571.39

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	370.00
合计	308,641.27

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
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”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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（“景顺长城上证 180 等权重 ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	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	30,298,467.02	100.00%	58,307,541.72	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	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	28,219.09	100.00%	25,111.53	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	54,301.42	100.00%	52,460.41	100.00%

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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年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	229,641.88
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。

6.4.10.2.2 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	45,928.42

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 X0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期和上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
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	21,000,000.00	37.20%	34,000,000.00	46.29%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年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
中国银行	1,816,448.26	4,574.69	1,449,518.82	8,723.20

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末成本总 额	期末估值总额	备注
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项停牌	22.29	-	-	26,929	438,864.79	600,247.41	-
600643	爱建集团	2017年4月17日	重大事项停牌	14.98	2017年8月2日	16.48	36,538	513,422.88	547,339.24	-
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项停牌	7.47	2017年8月21日	8.22	68,670	369,531.71	512,964.90	-
600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项停牌	3.60	-	-	141,075	592,321.08	507,870.00	-
601727	上海电气	2017年6月22日	重大事项停牌	7.57	2017年7月3日	7.54	66,000	659,318.95	499,620.00	-
601608	中信重工	2017年4月19日	重大事项停牌	5.54	2017年7月26日	5.26	79,900	511,812.02	442,646.00	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项停牌	5.16	-	-	84,800	531,899.32	437,568.00	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大事项停牌	14.12	-	-	30,658	520,702.51	432,890.96	-
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事项停牌	5.35	2017年7月26日	5.89	77,600	561,933.79	415,160.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	重大事项停牌	6.21	-	-	62,899	680,134.61	390,602.79	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	-	-	26,100	683,769.65	380,799.00	-
600654	*ST 中安	2017年6月7日	重大事项停牌	13.48	-	-	25,300	488,400.35	341,044.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证 180 等权重指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 等权重指数，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。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于本期末，本基金未持有信用类债券（上期末同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理的价格适时变现。

本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,816,448.26	-	-	-	-	-	1,816,448.26
结算备付金	673.44	-	-	-	-	-	673.44
存出保证金	1,420.94	-	-	-	-	-	1,420.94
交易性金融资产	-	-	-	-	-	83,405,218.20	83,405,218.20
应收利息	-	-	-	-	-	312.65	312.65
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,818,542.64	-	-	-	-	83,405,530.85	85,224,073.49
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,422.15	34,422.15
应付托管费	-	-	-	-	-	6,884.44	6,884.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,111.53	25,111.53
其他负债	-	-	-	-	-	358,271.27	358,271.27
负债总计	-	-	-	-	-	424,689.39	424,689.39
利率敏感度缺口	1,818,542.64	-	-	-	-	-	-
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	835,388.90	-	-	-	-	-	835,388.90
结算备付金	1,406.11	-	-	-	-	-	1,406.11
存出保证金	1,589.74	-	-	-	-	-	1,589.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	105,673,515.11	105,673,515.11
应收利息	-	-	-	-	-	269.36	269.36
资产总计	838,384.75	-	-	-	-	105,673,784.47	106,512,169.22
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	46,014.83	46,014.83
应付托管费	-	-	-	-	-	9,202.97	9,202.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	29,664.42	29,664.42
其他负债	-	-	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	294,882.22	294,882.22
利率敏感度缺口	838,384.75	-	-	-	-	-	-

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资（上年末：未持有），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证 180 等权重指数，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。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	83,405,218.20	98.36	105,673,515.11	99.49
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	83,405,218.20	98.36	105,673,515.11	99.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,702,062.60	5,987,770.48
沪深 300 指数下降 5%	-3,702,062.60	-5,987,770.48	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 77,896,465.90 元，属于第二层次的余额为 5,508,752.30 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 100,883,701.82 元，第二层次 4,789,813.29 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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：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

于本报告期内，本基金申购基金份额的对价总额为 1,455,196.18 元，其中包括以股票支付的申购款 1,399,272.00 元和以现金支付的申购款 55,924.18 元(上年度可比期间：本基金申购基金份额的对价总额为 42,877,357.32 元，其中包括以股票支付的申购款 41,276,810.68 元和以现金支付的申购款 1,600,546.64 元)。

(3) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

(4) 除公允价值、基金申购款和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	83,405,218.20	97.87
	其中：股票	83,405,218.20	97.87
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	1,817,121.70	2.13
7	其他各项资产	1,733.59	0.00
8	合计	85,224,073.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	477,665.28	0.56
B	采矿业	4,787,753.97	5.65
C	制造业	27,503,896.65	32.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,106,832.20	3.66
E	建筑业	4,508,819.33	5.32
F	批发和零售业	4,040,611.77	4.76
G	交通运输、仓储和邮政业	4,817,919.06	5.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,673,611.01	5.51
J	金融业	18,710,219.63	22.06
K	房地产业	8,586,838.99	10.13
L	租赁和商务服务业	416,300.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	443,365.27	0.52

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	434,304.00	0.51
S	综合	897,081.04	1.06
	合计	83,405,218.20	98.36

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	26,929	600,247.41	0.71
2	600516	方大炭素	40,813	580,360.86	0.68
3	600816	安信信托	40,711	553,262.49	0.65
4	600643	爱建集团	36,538	547,339.24	0.65
5	603993	洛阳钼业	107,900	545,974.00	0.64
6	600570	恒生电子	11,659	544,242.12	0.64
7	600741	华域汽车	22,213	538,443.12	0.63
8	600120	浙江东方	19,800	532,224.00	0.63
9	600031	三一重工	63,852	519,116.76	0.61
10	600315	上海家化	15,868	514,916.60	0.61
11	600503	华丽家族	74,299	513,406.09	0.61
12	600050	中国联通	68,670	512,964.90	0.60
13	600497	驰宏锌锗	78,200	512,210.00	0.60
14	600795	国电电力	141,075	507,870.00	0.60
15	601601	中国太保	14,893	504,425.91	0.59
16	601607	上海医药	17,349	501,039.12	0.59
17	601127	小康股份	25,100	500,745.00	0.59
18	600153	建发股份	38,700	500,391.00	0.59
19	600887	伊利股份	23,176	500,369.84	0.59

20	601727	上海电气	66,000	499,620.00	0.59
21	600893	航发动力	18,268	498,716.40	0.59
22	600809	山西汾酒	14,300	496,067.00	0.58
23	600549	厦门钨业	22,900	492,121.00	0.58
24	601699	潞安环能	62,800	491,096.00	0.58
25	600362	江西铜业	29,115	490,878.90	0.58
26	601012	隆基股份	28,600	489,060.00	0.58
27	601966	玲珑轮胎	21,800	488,974.00	0.58
28	600718	东软集团	31,400	488,270.00	0.58
29	600089	特变电工	47,222	487,803.26	0.58
30	601318	中国平安	9,824	487,368.64	0.57
31	603777	来伊份	13,100	486,403.00	0.57
32	600085	同仁堂	13,884	485,384.64	0.57
33	600158	中体产业	28,366	485,058.60	0.57
34	603589	口子窖	12,500	484,875.00	0.57
35	600271	航天信息	23,490	484,833.60	0.57
36	601901	方正证券	48,417	480,780.81	0.57
37	600737	中粮糖业	50,800	479,552.00	0.57
38	600036	招商银行	19,980	477,721.80	0.56
39	601633	长城汽车	35,944	477,695.76	0.56
40	601118	海南橡胶	84,096	477,665.28	0.56
41	600827	百联股份	29,272	475,670.00	0.56
42	600068	葛洲坝	42,300	475,452.00	0.56
43	600637	东方明珠	21,854	473,576.18	0.56
44	600170	上海建工	123,700	472,534.00	0.56
45	601211	国泰君安	23,000	471,730.00	0.56
46	600060	海信电器	31,091	471,650.47	0.56
47	600066	宇通客车	21,437	470,970.89	0.56
48	600804	鹏博士	26,528	470,872.00	0.56
49	600699	均胜电子	14,649	470,086.41	0.55
50	600585	海螺水泥	20,655	469,488.15	0.55
51	600019	宝钢股份	69,869	468,820.99	0.55
52	600048	保利地产	46,953	468,121.41	0.55
53	600219	南山铝业	137,750	466,972.50	0.55
54	600074	保千里	36,400	466,284.00	0.55
55	600839	四川长虹	128,766	466,132.92	0.55
56	600466	蓝光发展	54,000	466,020.00	0.55
57	600406	国电南瑞	26,385	465,695.25	0.55
58	601155	新城控股	25,100	465,354.00	0.55

59	601600	中国铝业	102,911	465,157.72	0.55
60	600522	中天科技	38,600	465,130.00	0.55
61	600104	上汽集团	14,965	464,663.25	0.55
62	600690	青岛海尔	30,834	464,051.70	0.55
63	600909	华安证券	45,900	463,131.00	0.55
64	600773	西藏城投	41,829	463,047.03	0.55
65	600037	歌华有线	31,801	463,022.56	0.55
66	600739	辽宁成大	25,640	462,289.20	0.55
67	601229	上海银行	18,100	462,274.00	0.55
68	600332	白云山	15,892	461,503.68	0.54
69	600535	天士力	11,108	461,426.32	0.54
70	600030	中信证券	27,110	461,412.20	0.54
71	600111	北方稀土	40,686	460,972.38	0.54
72	600383	金地集团	40,162	460,658.14	0.54
73	600446	金证股份	26,200	460,596.00	0.54
74	600820	隧道股份	45,600	460,560.00	0.54
75	601899	紫金矿业	134,146	460,120.78	0.54
76	601933	永辉超市	64,920	459,633.60	0.54
77	600018	上港集团	72,427	459,187.18	0.54
78	601169	北京银行	50,037	458,839.29	0.54
79	600900	长江电力	29,763	457,754.94	0.54
80	600016	民生银行	55,643	457,385.46	0.54
81	600177	雅戈尔	45,111	456,523.32	0.54
82	600807	天业股份	48,400	456,412.00	0.54
83	601998	中信银行	72,500	456,025.00	0.54
84	600519	贵州茅台	966	455,807.10	0.54
85	601009	南京银行	40,633	455,495.93	0.54
86	601718	际华集团	51,797	455,295.63	0.54
87	601166	兴业银行	27,003	455,270.58	0.54
88	600703	三安光电	23,091	454,892.70	0.54
89	600015	华夏银行	49,246	454,048.12	0.54
90	600649	城投控股	43,200	454,032.00	0.54
91	600276	恒瑞医药	8,961	453,336.99	0.53
92	603444	吉比特	1,600	453,328.00	0.53
93	600079	人福医药	23,100	453,222.00	0.53
94	600061	国投安信	29,100	452,505.00	0.53
95	601611	中国核建	37,800	452,466.00	0.53
96	600435	北方导航	31,600	452,196.00	0.53
97	600118	中国卫星	16,208	451,230.72	0.53

98	600895	张江高科	26,708	450,831.04	0.53
99	601555	东吴证券	40,103	450,356.69	0.53
100	600369	西南证券	80,268	450,303.48	0.53
101	600482	中国动力	17,800	450,162.00	0.53
102	601800	中国交建	28,273	449,257.97	0.53
103	601688	华泰证券	25,096	449,218.40	0.53
104	600233	圆通速递	22,900	448,611.00	0.53
105	601398	工商银行	85,447	448,596.75	0.53
106	600873	梅花生物	79,100	448,497.00	0.53
107	601818	光大银行	110,656	448,156.80	0.53
108	600999	招商证券	26,023	448,116.06	0.53
109	601336	新华保险	8,717	448,053.80	0.53
110	601988	中国银行	121,082	448,003.40	0.53
111	601006	大秦铁路	53,371	447,782.69	0.53
112	600010	包钢股份	204,413	447,664.47	0.53
113	601288	农业银行	127,033	447,156.16	0.53
114	601668	中国建筑	46,189	447,109.52	0.53
115	600109	国金证券	38,086	446,367.92	0.53
116	600565	迪马股份	81,000	446,310.00	0.53
117	600770	综艺股份	59,500	446,250.00	0.53
118	600688	上海石化	67,500	446,175.00	0.53
119	601985	中国核电	57,100	445,951.00	0.53
120	600518	康美药业	20,506	445,800.44	0.53
121	600705	中航资本	78,900	445,785.00	0.53
122	600157	永泰能源	124,854	445,728.78	0.53
123	600150	中国船舶	19,473	445,347.51	0.53
124	600978	宜华生活	44,300	445,215.00	0.53
125	600639	浦东金桥	24,557	444,972.84	0.52
126	601099	太平洋	110,683	444,945.66	0.52
127	600958	东方证券	31,900	443,729.00	0.52
128	600266	北京城建	30,511	443,629.94	0.52
129	600645	中源协和	20,689	443,365.27	0.52
130	601328	交通银行	71,942	443,162.72	0.52
131	601198	东兴证券	25,700	443,068.00	0.52
132	600528	中铁工业	31,000	442,990.00	0.52
133	601618	中国中冶	88,400	442,884.00	0.52
134	601608	中信重工	79,900	442,646.00	0.52
135	600376	首开股份	38,658	442,247.52	0.52
136	601766	中国中车	43,661	441,849.32	0.52

137	601018	宁波港	78,193	441,790.45	0.52
138	601669	中国电建	55,712	441,239.04	0.52
139	601216	君正集团	90,128	440,725.92	0.52
140	600009	上海机场	11,800	440,258.00	0.52
141	600886	国投电力	55,641	439,563.90	0.52
142	601377	兴业证券	59,144	439,439.92	0.52
143	601939	建设银行	71,450	439,417.50	0.52
144	600029	南方航空	50,500	439,350.00	0.52
145	601163	三角轮胎	16,700	439,210.00	0.52
146	601186	中国铁建	36,467	438,698.01	0.52
147	600489	中金黄金	43,713	438,441.39	0.52
148	601872	招商轮船	84,800	437,568.00	0.52
149	600115	东方航空	64,300	437,240.00	0.52
150	600663	陆家嘴	18,487	437,032.68	0.52
151	603858	步长制药	6,100	437,004.00	0.52
152	600919	江苏银行	47,000	436,630.00	0.51
153	601857	中国石油	56,777	436,615.13	0.51
154	601881	中国银河	36,800	436,448.00	0.51
155	600008	首创股份	66,300	436,254.00	0.51
156	600837	海通证券	29,321	435,416.85	0.51
157	600977	中国电影	23,200	434,304.00	0.51
158	600094	大名城	56,600	434,122.00	0.51
159	600221	海航控股	134,717	433,788.74	0.51
160	601788	光大证券	29,047	433,671.71	0.51
161	600000	浦发银行	34,230	433,009.50	0.51
162	600100	同方股份	30,658	432,890.96	0.51
163	601628	中国人寿	16,008	431,895.84	0.51
164	600606	绿地控股	55,200	431,664.00	0.51
165	600547	山东黄金	14,912	431,404.16	0.51
166	600196	复星医药	13,902	430,822.98	0.51
167	601390	中国中铁	49,437	428,618.79	0.51
168	600028	中国石化	71,824	425,916.32	0.50
169	600926	杭州银行	28,300	420,255.00	0.50
170	600340	华夏幸福	12,499	419,716.42	0.49
171	600023	浙能电力	76,566	418,050.36	0.49
172	601111	中国国航	42,788	417,183.00	0.49
173	601992	金隅股份	64,400	416,668.00	0.49
174	600415	小商品城	57,500	416,300.00	0.49
175	601919	中远海控	77,600	415,160.00	0.49

176	600021	上海电力	33,200	401,388.00	0.47
177	600208	新湖中宝	88,558	398,511.00	0.47
178	601989	中国重工	62,899	390,602.79	0.46
179	600485	信威集团	26,100	380,799.00	0.45
180	600654	*ST 中安	25,300	341,044.00	0.40
181	600297	广汇汽车	44,630	336,063.90	0.40
182	600704	物产中大	39,355	286,897.95	0.34

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	600019	宝钢股份	1,191,796.00	1.12
2	600497	驰宏锌锗	583,729.00	0.55
3	600809	山西汾酒	506,364.00	0.48
4	600718	东软集团	476,159.00	0.45
5	600008	首创股份	473,336.00	0.45
6	600977	中国电影	467,097.00	0.44
7	603777	来伊份	465,798.00	0.44
8	601229	上海银行	461,257.00	0.43
9	603858	步长制药	458,643.00	0.43
10	600170	上海建工	458,617.00	0.43
11	600909	华安证券	458,429.00	0.43
12	601012	隆基股份	456,282.00	0.43
13	603444	吉比特	455,643.00	0.43
14	601992	金隅股份	454,124.00	0.43
15	600233	圆通速递	451,431.00	0.43
16	601881	中国银河	450,535.00	0.42
17	601163	三角轮胎	449,729.00	0.42
18	600919	江苏银行	449,453.00	0.42
19	600926	杭州银行	447,237.00	0.42
20	601966	玲珑轮胎	447,184.00	0.42

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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	600019	宝钢股份	1,319,978.45	1.24
2	600005	武钢股份	691,152.00	0.65
3	600875	东方电气	582,961.60	0.55
4	600325	华发股份	504,536.00	0.48
5	600674	川投能源	502,962.60	0.47
6	600160	巨化股份	500,346.00	0.47
7	600959	江苏有线	470,037.00	0.44
8	600352	浙江龙盛	448,160.88	0.42
9	600519	贵州茅台	412,279.98	0.39
10	600754	锦江股份	410,990.43	0.39
11	600064	南京高科	404,206.00	0.38
12	601928	凤凰传媒	404,017.45	0.38
13	600252	中恒集团	396,335.86	0.37
14	600240	华业资本	386,304.88	0.36
15	600372	中航电子	381,159.56	0.36
16	603866	桃李面包	375,607.19	0.35
17	600604	市北高新	367,182.00	0.35
18	600053	九鼎投资	352,209.00	0.33
19	600783	鲁信创投	334,628.00	0.32
20	600649	城投控股	304,259.70	0.29

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	15,486,381.87
卖出股票收入（成交）总额	16,523,164.55

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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

- 1、恒生电子股份有限公司（股票代码：600570）的控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公

司（以下简称恒生网络）于 2016 年 12 月 13 日收到中国证监会下发的[2016]123 号《行政处罚决定书》。根据该决定书，恒生网络明知一些不具有经营证券业务资质的机构或个人的证券经营模式，仍向其销售具有证券业务属性的软件（涉案软件具有开立证券交易账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算等功能），提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第 122 条规定，构成非法经营证券业务。中国证监会决定：没收恒生网络违法所得约 10,986 万元，并处以约 32,960 万元罚款。

因本报告期末恒生电子属于上证 180 等权重指数成分股，而本基金通过完全复制上证 180 等权重指数成分股进行被动式指数化投资，因此持有恒生电子。

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	1,420.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	312.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,733.59

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	601088	中国神华	600,247.41	0.71	重大事项停牌
2	600643	爱建集团	547,339.24	0.65	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

8.1.1 本基金的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
451	125,178.58	25,641,658.00	45.42%	9,813,883.00	17.38%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
景顺长城上证 180 等权重 ETF 联接基金	21,000,000.00	37.20%

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	工银安盛人寿保险有限公司	25,159,279.00	44.56%
2	中国银行—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	21,000,000.00	37.20%
3	何凤珍	467,309.00	0.83%
4	吴晓晴	378,317.00	0.67%
5	中国银河证券股份有限公司	285,201.00	0.51%
6	刘宇	263,158.00	0.47%
7	肖伟	228,899.00	0.41%
8	马庭愉	213,939.00	0.38%
9	吕菊锁	211,900.00	0.38%
10	红云红河烟草(集团)有限责任公司曲靖卷烟厂企业年金计划—工行	174,800.00	0.31%
11	林凤燕	160,000.00	0.28%

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（2012年6月12日）基金份额总额	1,270,455,541.00
本报告期期初基金份额总额	73,455,541.00
本报告期基金总申购份额	1,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	56,455,541.00

§ 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

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	
长城证券股	3	30,298,467.02	100.00%	28,219.09	100.00%	-

份有限公司						
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

2、本基金本期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券股份有限公司	92,141.70	100.00%	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
2	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 26 日
3	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2017 年 1 月 26 日

	招募说明书摘要	金管理人网站	
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易“精明 i 定投”PE 区间的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 6 日
5	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
6	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 17 日
8	上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 24 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	25,159,279.00	-	-	25,159,279.00	44.56%
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20170101-20170630	34,000,000.00	16,000,000.00	29,000,000.00	21,000,000.00	37.20%

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况, 可能导致以下风险:

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

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

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

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

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

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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日