

# 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>

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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城中国回报混合
场内简称	无
基金主代码	000772
交易代码	000772
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 6 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	80,478,352.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价，结合投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略：本基金挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票，通过定量和定性相结合的方法，通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。</p> <p>本基金通过认真、细致的宏观研究、行业研究及个股研究，将推动中国经济发展的驱动力转化为基金持有人的长期投资收益。在股票投资方面，本基金利用基金管理人股票研究数据库(SRD)对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出受益于中国经济发</p>

	展趋势和投资主题的公司股票进行投资。 3、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款利率（税后）+3%（单利年化）
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皦阳	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
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 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		杨光裕	易会满

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层
--------	--------------	------------------------------



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	413,955.49
本期利润	4,881,979.38
加权平均基金份额本期利润	0.0578
本期加权平均净值利润率	4.65%
本期基金份额净值增长率	4.75%
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	19,338,301.58
期末可供分配基金份额利润	0.2403
期末基金资产净值	102,864,441.11
期末基金份额净值	1.278
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	27.80%

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。

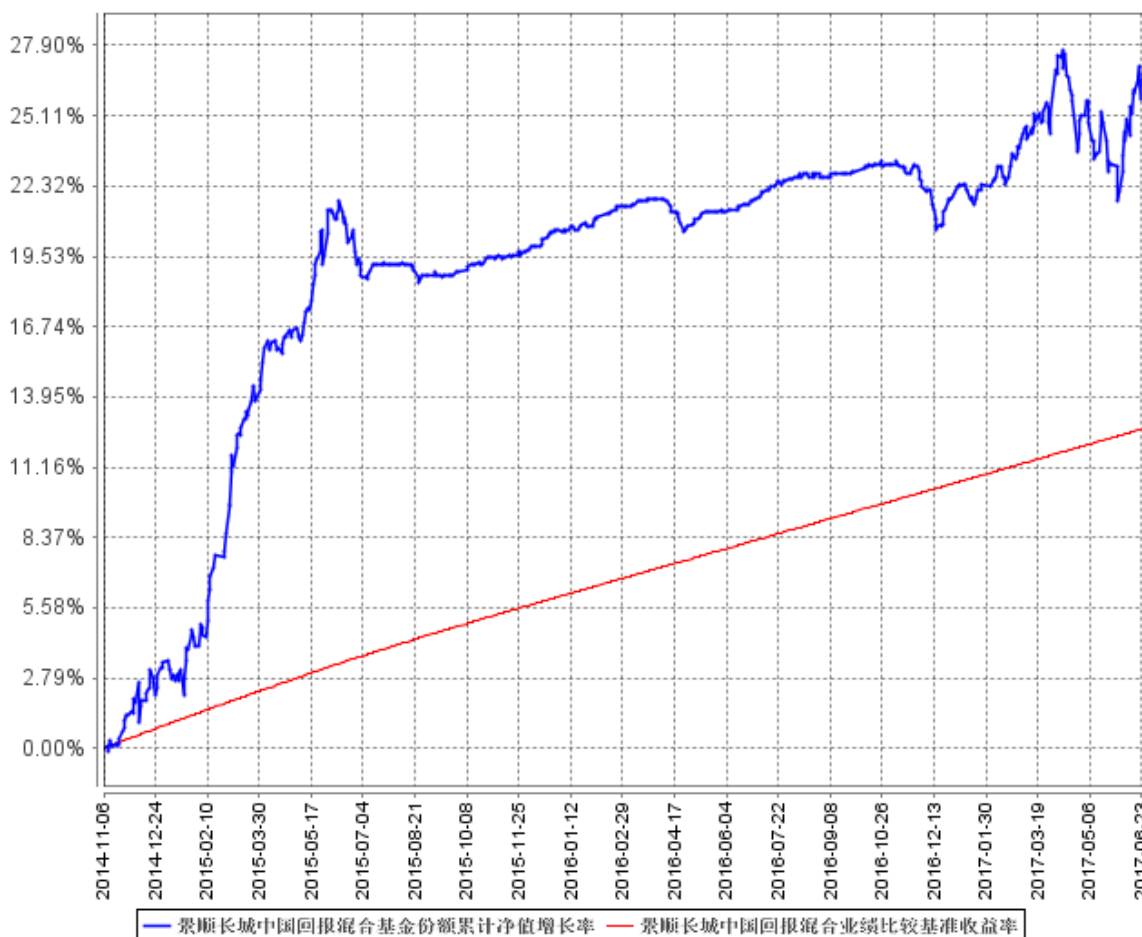
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	3.82%	0.55%	0.33%	0.01%	3.49%	0.54%
过去三个月	2.08%	0.52%	1.01%	0.01%	1.07%	0.51%
过去六个月	4.75%	0.40%	2.02%	0.01%	2.73%	0.39%
过去一年	4.93%	0.29%	4.16%	0.01%	0.77%	0.28%
自基金合同	27.80%	0.26%	12.75%	0.01%	15.05%	0.25%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2014 年 11 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 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		
杨锐文	本基金的基金经理	2016 年 11 月 12 日	-	7 年	工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。2010 年 11 月加入本公司，担任研究员职务；自 2014 年 10 月起担任基金经理。
万梦	本基金的基金经理	2016 年 2 月 4 日	2017 年 2 月 24 日	6 年	工学硕士。曾任职于壳牌（中国）有限公司。2011 年 9 月加入本公司，先后担任研究部行业研究员、固定收益部研究员和基金经理助理职务；自 2015 年 7 月起担任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中国回报灵活配置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

上半年，沪深 300 上涨 10.78%。由于 IPO 发行节奏加速，市场风格加速切换至大市值股票，以家电、白酒为代表的蓝筹股纷纷走牛以及中小市值的崩溃形成明显的“一九效应”。市场像过去疯狂追逐中小市值的股票一样追逐蓝筹股，A 股的情绪总会在各种极端中摆动。

本基金始终坚持寻找绝对收益的机会，随着“一九效应”导致部分优质成长股大跌，估值逐步进入我们的目标区间，基金股票仓位已经逐步从 0-30%加仓至 30%-50%。现时仓位处于基金合同规定仓位限制中的中等偏低。本基金目标并不是为了战胜指数基数，目标是寻找市场出现的绝对

收益机会。本基金更多时间是等待绝对收益机会的出现，希望迅速切入分享最具投资性价比的一段。

尽管市场在疯狂追逐着蓝筹股，但是，我们不希望受市场风格的变化干扰，我们依然坚持寻找符合产业趋势的成长股。不管市场风格如何变化，我们更希望赚伴随企业成长的钱。我们坚信，只有真正的成长股才能为投资者带来持续的超额收益。

#### 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 4.75%，业绩比较基准收益率为 2.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来半年，我们认为市场的机会大于风险。原因主要有两方面：一方面是市场整体估值逐步进入合理区间，部分高成长个股已经进入很有吸引力的区间；另外一方面是金融体系去杠杆的最大冲击过程似乎已经过去了，对股票市场的影响更是有限。不过，我们认为机会依然是结构性机会。我们选股依然需要小心求证，市场的变化不可预知，但是，产业趋势可以预知。所以，我们坚持通过产业趋势来选择个股。

就宏观经济而言，我们则认为经济复苏有可能超预期。供给侧改革让传统行业的盈利大为改善，彻底扭转了过去几年传统行业 ROE 连续下滑的趋势。ROE 的反转刺激了民间投资，结合环保核查对中小企业的影响，这尤其刺激了行业龙头企业的投资意愿。

我们依然看好史上最严的环保核查带来的各种投资机会。环保核查成为供给侧改革最重要的手段，加强了中国去产能的力度。过去，大部分中小企业都逃避了环保监管，享受了环保红利，大企业面对中小企业的竞争并没有优势。而环保核查消灭了这种不合理的环保红利，有利于市场集中度的提升。环保核查前期主要体现于制造业龙头的投资机会，中后期将会体现于优质的环保产业个股的投资机会。中国制造业补环保欠账足以让行业保持多年高景气度，因为对于不少制造业企业而言，这是生死存亡的选择。

同时，我们也看好新能源汽车产业链以及各种科技产业的机会。特斯拉的成功倒逼着传统车厂加速进入新能源汽车领域，而新能源汽车产业链如同手机产业链一样，大部分配套产业都在中国。中国企业能充分享受到全球新能源汽车的爆发增长。过去几年，我们看到中国企业在不同科技产业中不断取得突破，越来越多有意思的科技股进入 A 股，假以时日，中国会出现越来越多的科技牛股。

我们在“一九行情”过程经历了痛苦的煎熬，但是，我们相信我们在这个过程中找到了一些长期空间巨大、估值相对合理的个股。希望这些持仓能为投资者带来合理的回报。

#### 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、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中国回报灵活配置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，景顺长城中国回报灵活配置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中国回报灵活配置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，景顺长城中国回报灵活配置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的真实、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中国回报灵活配置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：景顺长城中国回报灵活配置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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	16,332,356.90	9,895,479.72
结算备付金		212,695.22	568,185.67
存出保证金		26,903.57	2,578.27
交易性金融资产	6.4.7.2	87,104,860.68	87,805,712.08
其中：股票投资		44,628,860.68	10,656,422.08
基金投资		-	-
债券投资		42,476,000.00	77,149,290.00
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	-	12,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	730,508.08	1,599,659.08
应收股利		-	-
应收申购款		195.31	98.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		104,407,519.76	111,871,713.34
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,022,437.69	5,000,000.00
应付赎回款		28,384.14	29,902.32
应付管理人报酬		125,533.27	137,781.92
应付托管费		20,922.20	22,963.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	58,415.19	23,996.27

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	287,386.16	169,011.26
负债合计		1,543,078.65	5,383,655.43
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	80,478,352.85	87,320,246.06
未分配利润	6.4.7.10	22,386,088.26	19,167,811.85
所有者权益合计		102,864,441.11	106,488,057.91
负债和所有者权益总计		104,407,519.76	111,871,713.34

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.278 元，基金份额总额 80,478,352.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中国回报灵活配置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	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
<b>一、收入</b>		6,160,539.98	5,244,368.39
1.利息收入		1,250,154.65	6,657,364.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	50,923.32	91,491.16
债券利息收入		1,017,882.15	6,199,226.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		181,349.18	366,647.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		415,237.69	3,822,797.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,512,468.45	19,144.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,198,185.38	3,803,652.65
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	100,954.62	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,468,023.89	-6,688,927.98
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	27,123.75	1,453,134.30
<b>减：二、费用</b>		1,278,560.60	3,141,860.08

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	780,439.47	2,385,933.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	130,073.22	397,655.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	168,967.69	63,288.51
5. 利息支出		43.89	76,286.42
其中：卖出回购金融资产支出		43.89	76,286.42
6. 其他费用	6.4.7.19	199,036.33	218,695.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,881,979.38	2,102,508.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,881,979.38	2,102,508.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中国回报灵活配置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）	87,320,246.06	19,167,811.85	106,488,057.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,881,979.38	4,881,979.38
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）	-6,841,893.21	-1,663,702.97	-8,505,596.18
其中：1.基金申购款	11,058,449.04	2,675,302.72	13,733,751.76
2.基金赎回款	-17,900,342.25	-4,339,005.69	-22,239,347.94
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）	80,478,352.85	22,386,088.26	102,864,441.11

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)	1,072,590,328.60	221,208,963.61	1,293,799,292.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,102,508.31	2,102,508.31
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)	-959,647,396.55	-198,728,598.69	-1,158,375,995.24
其中：1.基金申购款	6,524,467.42	1,389,681.51	7,914,148.93
2.基金赎回款	-966,171,863.97	-200,118,280.20	-1,166,290,144.17
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)	112,942,932.05	24,582,873.23	137,525,805.28

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

景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2014】810号文《关于核准景顺长城中国回报灵活配置混合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于2014年9月30日至2014年11月4日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第60467014\_H03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年11月6日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币2,869,742,421.49元，在募集期间

产生的活期存款利息为人民币 879,788.45 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,870,622,209.94 元，折合 2,870,622,209.94 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%（单利年化）。

#### 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 2017 年 6 月 30 日止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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

#### 6.4.6 税项

印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

营业税、增值税、企业所得税

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税

应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	16,332,356.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	16,332,356.90

#### 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	41,561,236.40	44,628,860.68	3,067,624.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	-	-	-



	银行间市场	42,506,991.32	42,476,000.00	-30,991.32
	合计	42,506,991.32	42,476,000.00	-30,991.32
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		84,068,227.72	87,104,860.68	3,036,632.96

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本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	3,126.04
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	86.22
应收债券利息	727,284.93
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	10.89
合计	730,508.08

#### 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	57,815.44
银行间市场应付交易费用	599.75
合计	58,415.19

#### 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	13.83
预提费用	287,372.33
合计	287,386.16

#### 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	87,320,246.06	87,320,246.06
本期申购	11,058,449.04	11,058,449.04
本期赎回(以“-”号填列)	-17,900,342.25	-17,900,342.25
- 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	80,478,352.85	80,478,352.85

注：本期申购份额包含基金转入份额；本期赎回份额包含基金转出份额。

#### 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	20,580,217.34	-1,412,405.49	19,167,811.85
本期利润	413,955.49	4,468,023.89	4,881,979.38
本期基金份额交易产生的变动数	-1,655,871.25	-7,831.72	-1,663,702.97
其中：基金申购款	2,550,747.61	124,555.11	2,675,302.72

基金赎回款	-4,206,618.86	-132,386.83	-4,339,005.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,338,301.58	3,047,786.68	22,386,088.26

#### 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	46,766.08
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	4,042.26
其他	114.98
合计	50,923.32

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	45,351,225.26
减：卖出股票成本总额	43,838,756.81
买卖股票差价收入	1,512,468.45

#### 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	75,412,961.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	75,559,001.27
减：应收利息总额	1,052,145.21
买卖债券差价收入	-1,198,185.38

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益发生额为零。

**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	100,954.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	100,954.62

**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	4,468,023.89
——股票投资	3,417,232.62
——债券投资	1,050,791.27
——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	4,468,023.89

**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	26,859.79
基金转换费收入	263.96
合计	27,123.75

**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	167,567.69
银行间市场交易费用	1,400.00
合计	168,967.69

#### 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
债券托管账户维护费	18,653.84
银行划款手续费	1,864.00
合计	199,036.33

#### 6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作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、注册登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

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

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年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	780,439.47	2,385,933.84
其中：支付销售机构的客户维护费	338,151.34	536,365.60

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

#### 6.4.10.2.2 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	130,073.22	397,655.62

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期及上年度可比期间与关联方均未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本期及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

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。

#### 6.4.10.5 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
中国工商银行	16,332,356.90	46,766.08	468,910.27	90,853.54

注：本基金的活期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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

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

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，



不得超过该证券余额的 10%。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,332,356.90	-	-	-	-	-	16,332,356.90
结算备付金	212,695.22	-	-	-	-	-	212,695.22
存出保证金	26,903.57	-	-	-	-	-	26,903.57

交易性金融资产	19,986,000.00		-22,490,000.00			-44,628,860.68	87,104,860.68
应收利息						730,508.08	730,508.08
应收申购款						195.31	195.31
资产总计	36,557,955.69		-22,490,000.00			-45,359,564.07	104,407,519.76
负债							
应付证券清算款						1,022,437.69	1,022,437.69
应付赎回款						28,384.14	28,384.14
应付管理人报酬						125,533.27	125,533.27
应付托管费						20,922.20	20,922.20
应付交易费用						58,415.19	58,415.19
其他负债						287,386.16	287,386.16
负债总计						1,543,078.65	1,543,078.65
利率敏感度缺口	36,557,955.69		-22,490,000.00				
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	9,895,479.72						9,895,479.72
结算备付金	568,185.67						568,185.67
存出保证金	2,578.27						2,578.27
交易性金融资产		-7,500,000.00	24,648,890.00	45,000,400.00		-10,656,422.08	87,805,712.08
买入返售金融资产	12,000,000.00						12,000,000.00
应收利息						1,599,659.08	1,599,659.08
应收申购款						98.52	98.52
其他资产							
资产总计	22,466,243.66	7,500,000.00	24,648,890.00	45,000,400.00		-12,256,179.68	111,871,713.34
负债							
应付证券清算款						5,000,000.00	5,000,000.00
应付赎回款						29,902.32	29,902.32
应付管理人报酬						137,781.92	137,781.92
应付托管费						22,963.66	22,963.66
应付交易费用						23,996.27	23,996.27
其他负债						169,011.26	169,011.26

负债总计	-	-	-	-	-	5,383,655.43	5,383,655.43
利率敏感度缺口	22,466,243.66	7,500,000.00	24,648,890.00	45,000,400.00	-	-	-

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

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。		
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）
	市场利率上升 25 个基点	-38,414.37	-327,537.66
市场利率下降 25 个基点	38,524.33	330,917.39	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于本期末，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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	44,628,860.68	43.39	10,656,422.08	10.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	42,476,000.00	41.29	77,149,290.00	72.45
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	87,104,860.68	84.68	87,805,712.08	82.46

#### 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%	1,458,894.31	63,206.26
沪深300指数下降5%	-1,458,894.31	-63,206.26	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 其他事项

##### (1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币44,628,860.68元，划分为第二层次的余额为人民币42,476,000.00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10,653,882.08元，划分为第二层次的余额为人民币77,151,830.00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	44,628,860.68	42.74
	其中：股票	44,628,860.68	42.74
2	固定收益投资	42,476,000.00	40.68
	其中：债券	42,476,000.00	40.68
	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	16,545,052.12	15.85
7	其他各项资产	757,606.96	0.73
8	合计	104,407,519.76	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	2,036,056.00	1.98
B	采矿业	-	-
C	制造业	32,489,392.48	31.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,666,652.00	5.51
E	建筑业	2,056,970.00	2.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,025,691.00	1.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,354,099.20	1.32

0	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	44,628,860.68	43.39

### 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	300616	尚品宅配	52,500	7,116,900.00	6.92
2	000400	许继电气	321,100	5,766,956.00	5.61
3	300335	迪森股份	295,600	5,666,652.00	5.51
4	002192	融捷股份	188,071	4,829,663.28	4.70
5	600884	杉杉股份	225,200	3,709,044.00	3.61
6	603788	宁波高发	61,200	2,632,824.00	2.56
7	002841	视源股份	35,300	2,619,966.00	2.55
8	000967	盈峰环境	234,455	2,541,492.20	2.47
9	300232	洲明科技	139,100	2,225,600.00	2.16
10	000065	北方国际	86,500	2,056,970.00	2.00
11	002714	牧原股份	74,800	2,036,056.00	1.98
12	300355	蒙草生态	126,080	1,354,099.20	1.32
13	002850	科达利	11,500	1,044,085.00	1.02
14	601788	光大证券	68,700	1,025,691.00	1.00
15	002664	信质电机	100	2,862.00	0.00

### 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	300616	尚品宅配	6,864,080.00	6.45
2	000400	许继电气	5,709,054.00	5.36

3	300335	迪森股份	5,295,771.90	4.97
4	002688	金河生物	5,282,980.60	4.96
5	603778	乾景园林	4,926,635.75	4.63
6	600884	杉杉股份	3,279,088.14	3.08
7	603788	宁波高发	2,699,093.00	2.53
8	000036	华联控股	2,665,045.83	2.50
9	002841	视源股份	2,470,378.00	2.32
10	600060	海信电器	2,151,068.00	2.02
11	600109	国金证券	2,123,689.00	1.99
12	601211	国泰君安	2,123,073.00	1.99
13	600030	中信证券	2,123,052.00	1.99
14	601688	华泰证券	2,122,144.00	1.99
15	002714	牧原股份	2,119,753.00	1.99
16	002192	融捷股份	2,095,996.60	1.97
17	300145	中金环境	2,085,749.00	1.96
18	000967	盈峰环境	2,041,183.00	1.92
19	000065	北方国际	2,036,241.43	1.91
20	300232	洲明科技	2,033,644.14	1.91

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	603778	乾景园林	5,405,941.76	5.08
2	002688	金河生物	5,321,482.67	5.00
3	300145	中金环境	5,014,044.80	4.71
4	000036	华联控股	2,845,791.66	2.67
5	600340	华夏幸福	2,821,240.00	2.65
6	600060	海信电器	2,329,470.00	2.19
7	000967	盈峰环境	2,212,137.00	2.08
8	600030	中信证券	2,033,342.00	1.91
9	601211	国泰君安	2,010,984.00	1.89
10	601688	华泰证券	1,965,608.91	1.85
11	300284	苏交科	1,875,094.14	1.76
12	600109	国金证券	1,847,891.00	1.74
13	600993	马应龙	1,227,964.00	1.15



14	000728	国元证券	1,121,109.54	1.05
15	000039	中集集团	1,100,039.00	1.03
16	600759	洲际油气	1,062,375.00	1.00
17	601377	兴业证券	1,043,681.00	0.98
18	603366	日出东方	1,042,725.00	0.98
19	300416	苏试试验	941,515.64	0.88
20	600998	九州通	569,231.14	0.53

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	74,393,962.79
卖出股票收入（成交）总额	45,351,225.26

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	39,907,000.00	38.80
	其中：政策性金融债	39,907,000.00	38.80
4	企业债券	2,569,000.00	2.50
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	42,476,000.00	41.29

### 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	160419	16 农发 19	200,000	19,986,000.00	19.43
2	170203	17 国开 03	100,000	9,964,000.00	9.69
3	170204	17 国开 04	100,000	9,957,000.00	9.68

4	1280014	12 华发集团 债	100,000	2,569,000.00	2.50
---	---------	--------------	---------	--------------	------

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 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

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	26,903.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	730,508.08
5	应收申购款	195.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	757,606.96

### 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
1,797	44,784.84	279,400.23	0.35%	80,198,952.62	99.65%

### 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	470,246.87	0.58%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年11月6日）基金份额总额	2,870,622,209.94
本报告期期初基金份额总额	87,320,246.06
本报告期基金总申购份额	11,058,449.04
减：本报告期基金总赎回份额	17,900,342.25
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	80,478,352.85

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	
方正证券股	2	35,434,436.51	29.59%	33,001.52	29.59%	新增一个

份有限公司							
瑞银证券有 限责任公司	1	17,530,731.70	14.64%	16,326.79	14.64%		-
兴业证券股 份有限公司	1	15,733,467.98	13.14%	14,651.80	13.14%		-
国金证券股 份有限公司	1	14,533,008.79	12.14%	13,535.24	12.14%		-
天风证券股 份有限公司	1	12,816,632.98	10.70%	11,936.55	10.70%		-
平安证券股 份有限公司	1	9,797,837.95	8.18%	9,124.83	8.18%		-
华创证券有 限责任公司	1	8,702,306.54	7.27%	8,104.30	7.27%		-
瑞信方正证 券有限责任 公司	2	2,571,473.80	2.15%	2,394.94	2.15%		新增
民生证券股 份有限公司	1	1,175,977.00	0.98%	1,094.99	0.98%		-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	1,022,347.00	0.85%	952.12	0.85%		-
恒泰证券股 份有限公司	1	426,967.80	0.36%	397.65	0.36%		新增
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-		-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-		-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-		-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-		-
海通证券股 份有限公司	1	-	-	-	-		-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-		-
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-		-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-		-
长城证券股	1	-	-	-	-		-

份有限公司						
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

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

2) 选择程序

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

### 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
方正证券股 份有限公司	-	-	152,900,000.00	42.96%	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3,004,323.29	100.00%	4,000,000.00	1.12%	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	162,000,000.00	45.52%	-	-
天风证券股	-	-	-	-	-	-



份有限公司						
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞信方正证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	37,000,000.00	10.40%	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 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	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 20 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海朝阳永续基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换业务和参加基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 20 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统招行直联渠道基金交易费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 3 日
6	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
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉兴银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 17 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景益货币市场基金开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 22 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 2 月 24 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于	中国证券报, 上海证	2017 年 2 月 25 日

	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月2日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金通过好买基金开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月10日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月22日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月22日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海华夏财富投资管理有限公司为销售机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月24日
17	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 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
18	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 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
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年3月29日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海云湾投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017年4月17日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海云湾投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基	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

	金转换业务的公告		
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市金斧子投资咨询有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 17 日
23	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
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财金融信息服务有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海挖财金融信息服务有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
27	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 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
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加武汉市伯嘉基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 26 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江南农商行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 27 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于调整直销网上交易系统建行直联渠道(含建行网银、建行快捷)基金交易费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 5 月 4 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳秋实惠智财富投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 5 月 11 日

32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳秋实惠智财富管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 5 月 11 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在深圳市金斧子基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 5 月 31 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城景益货币市场基金继续开展基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 5 月 31 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大河财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 2 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大河财富基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 2 日
37	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司定期定额申购起点金额的公告	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 9 日
38	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 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 6 月 20 日
39	景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 20 日
40	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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017年8月26日