

景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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

| | |
|--|-----------|
| §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..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| §5 托管人报告 | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| 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..... | 18 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 19 |
| 6.1 资产负债表..... | 19 |
| 6.2 利润表..... | 20 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 6.4 报表附注..... | 22 |
| §7 投资组合报告..... | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 46 |
| 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..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 48 |
| 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..... | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 48 |
| 10.8 其他重大事件..... | 52 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 56 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 56 |
| 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 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城成长之星股票 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000418 |
| 交易代码 | 000418 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 12 月 13 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 | 41,968,650.98 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在中国经济转型的大背景下，深度挖掘具备未来增长潜力的产业趋势和受益企业进行投资，在有效控制风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置：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，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、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：本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，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，并进一步挖掘出质地优秀，未来预期成长性良好的上市公司股票进行投资。</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×90%+中证全债指数×10%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 |

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 |
| 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 | -337,051.47 |
| 本期利润 | 5,106,833.25 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1157 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.87% |
| 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 | 25,939,619.91 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6181 |
| 期末基金资产净值 | 67,908,270.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.618 |
| 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 | 61.80% |

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。

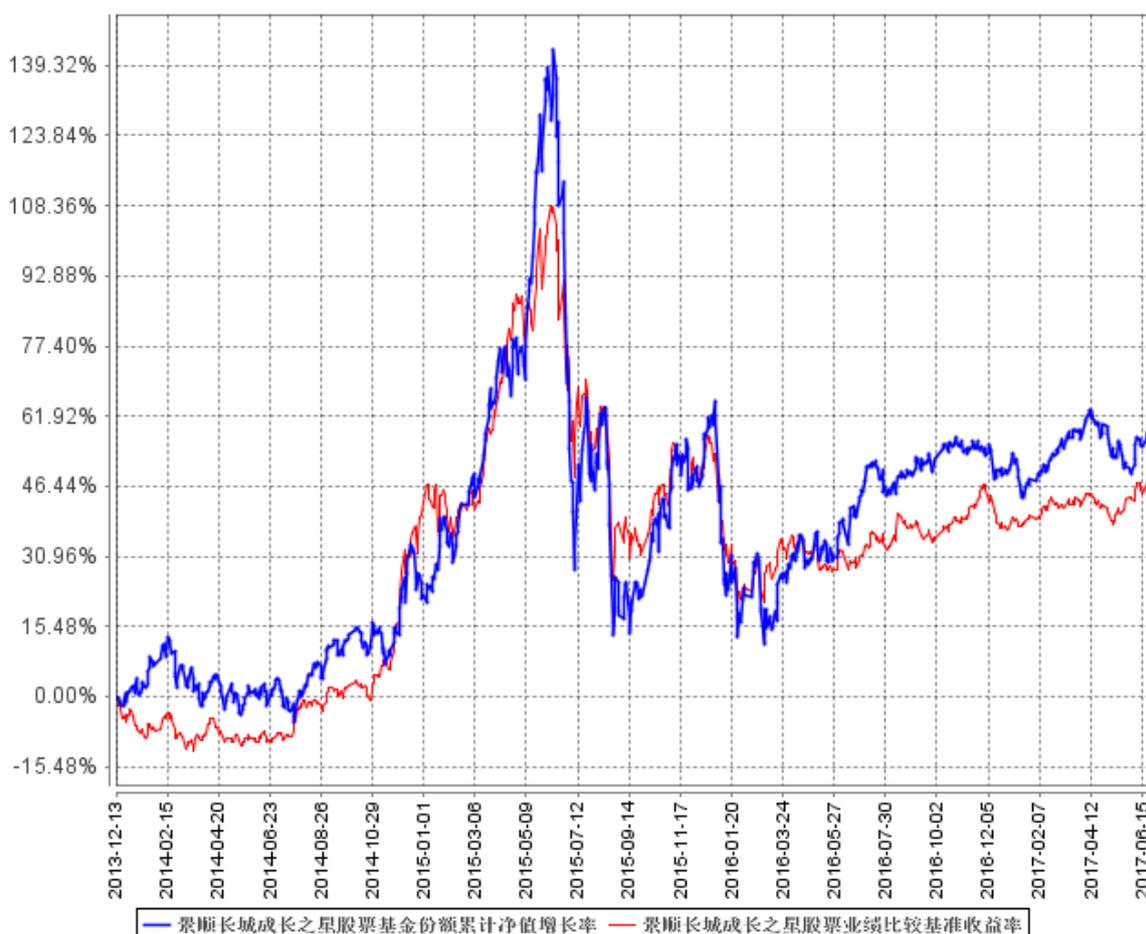
3.2 基金净值表现

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 | 7.51% | 0.85% | 4.60% | 0.61% | 2.91% | 0.24% |
| 过去三个月 | 2.41% | 0.91% | 5.50% | 0.56% | -3.09% | 0.35% |
| 过去六个月 | 7.87% | 0.82% | 9.65% | 0.51% | -1.78% | 0.31% |
| 过去一年 | 11.05% | 0.84% | 14.60% | 0.60% | -3.55% | 0.24% |
| 过去三年 | 57.39% | 2.10% | 64.78% | 1.58% | -7.39% | 0.52% |

| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 自基金合同生效起至今 | 61.80% | 2.00% | 50.55% | 1.50% | 11.25% | 0.50% |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 80%–95% 投资于股票资产，其中，投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将不超过 20% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种，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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 13 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 | | |
| 刘晓明 | 本基金的基金经理 | 2015 年 3 月 28 日 | - | 9 年 | 农学硕士。曾担任国元证券研究所研究员，第一创业证券研究所行业研究员。2011 年 6 月加入本公司，历任研究员、高级研究员职务；自 2014 年 11 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、《景顺长城成长之星股票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

1、本基金重点关注了新兴行业中发展前景好增速快，且估值合理的公司；

投资的新兴行业包括定制家具、医疗、通信、新能源汽车、环保行业和电子行业。

2、传统行业中的增长较快估值优势明显的龙头公司和转型公司。

投资的传统行业包括化工、机械、园林、电力设备、白酒、电力、汽车和有业绩有估值的军转民公司等。考察标准均是自下而上，公司增速较快，估值水平相对合理或较低；同时结合自上而下，观测哪些发生积极变化的行业。

3、基金在报告期内投资了大金融行业，包括银行、保险等。

3.1 银行（1）净息差走稳，负债成本走高的边际影响有所减弱，资产重定价开始发挥作用；

（2）信用风险企稳，潜在问题资产增速回落表明银行净资产稳定性增强，去杠杆则降低长期系统

性风险发生；(3) 盈利出现恢复，预计 2017/2018 年上市银行归属净利润同比增 5%/10%；(4) ROE 稳定利好估值，行业平均 ROE2017 年见底，预计稳定在 13-14%，合理估值中枢 1.2X，目前 16 家上市银行平均 2017 年 0.98X PB，仍旧具备投资吸引力。银行股投资更应关注长期逻辑，去杠杆是长期基调。

3.2 保险

3.2.1 利率影响保险公司基本面通过以下三种途径：

1) 责任准备金计提，进而对当期会计利润产生影响；2) 利率变化影响资产价格；3) 影响“调整后净资产”，进而影响内含价值。

近二十年海外市场数据显示，升息或高利率阶段，保险板块容易出现独立行情，反之跑输大盘指数。1) 美国 2003 年 5 月进入升息周期后，美亚和大都会等个股累计回报率强势反弹，2007 年 8 月步入降息周期后，表现不及标普 500 指数；2) 日本市场上，利率处于长周期的降息周期，保险板块大幅跑输日经 225 指数；3) 台湾市场上，国泰、新光、富邦等保险集团在低利率阶段整体上难有估值提升，利率阶段性回升时有相对估值提升；4) 英国是一个反例，高利率阶段，保险股与富时 100 指数高度重合，低利率阶段总体上跑赢指数。

市场利率上行是保险板块本轮估值提升启动最简单的逻辑。展望未来，如果国内金融去杠杆政策不变、美国加息及缩表继续推进，国内市场利率可能维持在相对高位，既能实现政策平稳推进，又不对实体经济产生过多冲击。因此，长端利率保持稳健的情况下，保险板块的投资价值依旧彰显，如果行业基本面向好的逻辑不断得到验证，则投资价值将进一步强化。目前行业动态 P/EV 为 1.09 倍，仍处低位。

3.2.2 保险行业未来增长空间仍较大。

我国保费收入过去五年复合增长 13%。我国保费收入从 2010 年的 1.3 万亿元，增长到 2015 年的 2.4 万亿元，年均增长 13.4%。行业利润从 2010 年的 837 亿元，增长到 2015 年的 2824 亿元，增加 2.4 倍。

预计未来五年保持 13%左右的复合增速问题也不大。2015 年，我国保险深度(=保费/GDP)达到 3.6%，保险密度(人均保费)达到 1768 元/人。根据保监会的保险行业十三五规划，到 2020 年，全国保险保费收入争取达到 4.5 万亿元左右，保险深度达到 5%，保险密度达到 3500 元/人，保险业总资产争取达到 25 万亿元左右。根据这一规划，对应这五年保费收入复合增速约 13%。

我国保险深度和保险密度都有提升空间。横向对比来看，根据 2014 年的数据，台湾的寿险保险深度 16%，日本、美国分别有 8.4%、3.0%（美国保障渠道除了寿险外，有 401k 基金式的养老保险等保障手段），相比之下，我国的寿险保险深度（2.0%）仍有上升空间。

2017 年 5 月，行业保费整体继续保持较快增长，但与去年同期相比，同比增速有所放缓，主要是受到 2016 年收益率下滑、万能险规模大幅收缩的影响。2017 年，保险行业资产配置面临着较大挑战，但随着资本市场的回暖，收益率有望提升；且随着监管倡导行业回归保障本源，行业保费结构持续改善，保障型产品占比不断提升。仍看好我国保险行业的长期发展，同时大型上市险企在此轮监管导向中受益，因此判断保险行业极有可能进入成长阶段。

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 7.87%，业绩比较基准收益率为 9.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

参考各大机构发布了对 1 季度经济数据点评。其实无论 1 季度数据如何，在排除国际因素的前提下，在一个比较短的周期内，我们的观点是今年的宏观经济会比较稳定。

原因在于，首先 2016 年 GDP 连续三个季度维持 6.7，第四个季度达到 6.8，而 PPI 在连续 54 个月低迷后开始转正，这意味着企业销售量在增长，销售额在扩大，伴随着销售增加现金流开始变好；其次，国有企业与民营企业的工业企业利润，从去年下半年开始正增长；再次，PMI 去年下半年一直在 50 以上。

一直以来，我国面临着去杠杆、去产能杂糅到一起的局面，宏观经济错综复杂。因为去杠杆间接导致经济进一步下行，在这样的局面下，很难下决心大力推动去产能。

而企业的利润上升后，还本能力得到增强，企业部门的杠杆暂时趋于稳定。从去年下半年来宏观经济稳定的这种态势，为去杠杆创造了非常有利积极的条件。我们认为经济目前处在非常接近 L 型的底部，中期来看是趋平走稳的。

小周期：去杠杆取得初效，经济开始筑底企稳

回顾去年、宏观经济走出趋稳的运行，与发改委在几个周期行业去产能有很大关系，使得煤炭、钢铁等行业的一部分产能退出生产环节，但并不是退出彻底生产，相当一部分很多是去产量不是去产能，富裕产能没有真正出清，僵尸企业没有彻底消失。因此这一轮企业部门是通过去产能来去了部分杠杆。

我们判断经济小周期正在结束从 2010 年以来的下行趋势，开始出现筑底企稳的迹象，主要标志如下：

第一，各项高频经济指标出现向好企稳迹象，这预示着短期经济景气度在提升。第二，运行中的各种对冲效率进一步释放：宏观加杠杆（基建投资等）对冲微观去杠杆（企业部门），这非常有利于减轻微观去杠杆带来经济的波动性；新经济的加速对冲了旧经济的减速，旧经济在调整过

程中，传统国有经济在改革，以互联网、高科技等代表的新经济的力量会进一步增长，利于经济发展。第三，大力促进国内需求对冲国际需求减力，国内投资消费两大需求均是求稳求进。

整体来看宏观经济短期，有可能在经历今年一年短暂的调整后，从 2018 年开始真正进入 L 型底部的平稳态势。

从政策信号来看，我们观测到也是一个“稳”字，意味着对短期担忧度降低。稳中求进，稳是头等大事，也为十九大创造条件。货币政策更加收紧，已经开始向社会透露，决策者对短期经济增长速度下行的担忧已经不在排在第一位，进而开始考虑十九大以后中长期的重大问题，例如防范风险、防泡沫，促进改革。整个中国经济的营商环境在改善，行政办事进一步转变作风，提高能力与效率。

大周期：增速下台阶尚未结束，转换动能在于产业更替

我们认为本轮经济增长和变化，与历史上的经济调整都不一样，并不是周期性减速，或者简单的周期循环、而是到了新旧动能转换的攻坚阶段，产业更替。

我们一直把经济发展动能分解成所谓的“三驾马车”，过去我国整体消费疲软，出口和投资两架马车比较强劲。投资和出口背后的逻辑就是制造业，支持中国过去 30 年经济飞速发展。我国获得世界工厂的名字，代表中国奇迹的制造业就是——珠三角（出口拉动型）和长三角（投资拉动型）沿海地区相对知识比较密集型产业，和内陆一些资源型和劳动密集型的制造业。

但是目前劳动力成本不断攀升，而投资率也逐渐下行，人口红利没有了，竞争力没有了，而一些无效产能还依然过剩的厉害，下一步就会步入所谓的“中等收入陷阱”。

中国经济去年基础设施建设和房地产起了很大作用，去年这两大产业对于 GDP 的直接拉动超过 2%，如果算上间接作用，例如水泥钢铁产业，去除这些元素后经济增长可能小于 4%。

而今年开始房地产会放缓，但趋向相对平稳。整个国家企业居民的总杠杆率目前已经超过美国，没有继续大幅加杠杆的空间了。因此中期来看宏观经济会进一步下台阶，直到完成产业升级换代。

大周期来说，经济下台阶并没有结束，增速会继续下台阶的原因在于：首先，总量经济的基数已经很大，我国已经是全球第二大经济体；其次，人口红利已经不存在，人口老龄化会导致储蓄率进一步下降，有劳动能力的人口数量下降；再次，我国面临的是资源的瓶颈和过去三十年高速发展带来的环境问题。

今后我国的宏观经济增长不能依靠美国等发达国家了，而是看自己如何成功转型。市场经济进一步活跃，企业家精神实践的企业会代表着中国的未来。

基于此，我们认为中期比较有竞争力产业的将会是：消费、健康相关的大产业；成本提高后

依然有竞争力的产业，如我国掌握核心技术的产业。

不过，尽管宏观有望转好，但有些风险点仍需保持关注：近几年最大的危险是国际形势，出口对中国的影响造成很大压力。特朗普的政策会对全球带来冲击。特朗普所谓的“去全球化”就是试图将世界从建制化、和平发展的时代过渡到竞争与冲突时代，也因此带来很大的不确定性。

本基金未来将持续重点关注几条投资主线：

持续的自下而上选股，不局限于个别或者部分行业。选股标准依然是紧扣基金投资主题，寻找当年业绩增速或预期业绩增速排名靠前的公司，或有预期差的公司。

本基金重点关注估值合理或估值较低的白马成长股，这类公司很多是所在行业的龙头企业，业绩增速稳定且较快，估值水平吸引力较强。

本基金持续关注大金融行业的投资机会，基金经理认为中期来看金融行业的改善逻辑依然比较确定，会持续买入或持有估值合理的金融标的。

管理人同样会继续站在自下而上的角度，配置已经回调至价值区间的优质成长个股。成长股方面，管理人认为首先应该关注的依然是偏实一点的增长性行业和公司，例如定制家具行业、电子行业、通信行业等科技股、有业绩有估值的军工公司。而文化、传媒、体育、互联网等行业整体相对吸引力不强，但已经观察到少数公司估值已经降到比较低的位置，基金也会在其中精选。这是由政策导向、宏观市场情况和今年以来的市场偏好趋势和其本身的估值水平所决定的。

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成长之星股票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，景顺长城成长之星股票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成长之星股票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，景顺长城成长之星股票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成长之星股票型证券投资基金 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：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 8,916,744.60 | 6,567,690.74 |
| 结算备付金 | | 244,613.49 | 92,962.47 |
| 存出保证金 | | 35,727.31 | 21,390.33 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 59,320,095.92 | 64,650,806.80 |
| 其中：股票投资 | | 59,320,095.92 | 64,650,806.80 |
| 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 | 1,601.76 | 1,293.25 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 93,238.66 | 4,719.17 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 68,612,021.74 | 71,338,862.76 |
| 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 | | 3,215.32 | 364,432.27 |
| 应付赎回款 | | 202,314.59 | 59,274.56 |
| 应付管理人报酬 | | 82,296.61 | 92,382.38 |
| 应付托管费 | | 13,716.09 | 15,397.04 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 123,788.42 | 57,945.84 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 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 | 278,419.82 | 154,512.52 |
| 负债合计 | | 703,750.85 | 743,944.61 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 41,968,650.98 | 47,076,022.86 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 25,939,619.91 | 23,518,895.29 |
| 所有者权益合计 | | 67,908,270.89 | 70,594,918.15 |
| 负债和所有者权益总计 | | 68,612,021.74 | 71,338,862.76 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.618 元，基金份额总额 41,968,650.98 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

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 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 6,193,794.78 | -6,375,324.57 |
| 1.利息收入 | | 22,123.88 | 48,112.67 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 22,123.88 | 23,007.44 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 25,105.23 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 703,015.72 | -5,623,081.05 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 211,051.62 | -5,816,090.06 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 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 | 491,964.10 | 193,009.01 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 5,443,884.72 | -841,178.33 |
| 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 | 24,770.46 | 40,822.14 |
| 减：二、费用 | | 1,086,961.53 | 871,888.28 |

| | | | |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 507,121.75 | 467,881.40 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 84,520.28 | 77,980.18 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 312,307.68 | 137,516.96 |
| 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 | 183,011.82 | 188,509.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,106,833.25 | -7,247,212.85 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 5,106,833.25 | -7,247,212.85 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城成长之星股票型证券投资基金

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） | 47,076,022.86 | 23,518,895.29 | 70,594,918.15 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 5,106,833.25 | 5,106,833.25 |
| 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） | -5,107,371.88 | -2,686,108.63 | -7,793,480.51 |
| 其中：1.基金申购款 | 5,024,971.44 | 2,808,892.59 | 7,833,864.03 |
| 2.基金赎回款 | -10,132,343.32 | -5,495,001.22 | -15,627,344.54 |
| 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） | 41,968,650.98 | 25,939,619.91 | 67,908,270.89 |
| 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) | 47,915,679.58 | 29,349,814.22 | 77,265,493.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -7,247,212.85 | -7,247,212.85 |
| 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) | 103,259.83 | -137,534.84 | -34,275.01 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,245,673.59 | 2,910,506.64 | 12,156,180.23 |
| 2.基金赎回款 | -9,142,413.76 | -3,048,041.48 | -12,190,455.24 |
| 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) | 48,018,939.41 | 21,965,066.53 | 69,984,005.94 |

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

景顺长城成长之星股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1361号《关于核准景顺长城成长之星股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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535,635,270.28元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第794号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》于2013年12月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为535,770,185.52份基金份额,其中认购资金利息折

合 134,915.24 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，其中，投资于成长性良好的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将不超过 20% 的基金资产投资于债券等固定收益类品种，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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×90%+中证全债指数×10%。

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》、《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、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 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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、债券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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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 | 8,916,744.60 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 8,916,744.60 |

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 | 55,992,756.58 | 59,320,095.92 | 3,327,339.34 |
| 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 | 55,992,756.58 | 59,320,095.92 | 3,327,339.34 |

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 | 1,488.18 |
| 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 | 99.09 |
| 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 | 14.49 |
| 合计 | 1,601.76 |

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 | 123,788.42 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 123,788.42 |

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 | 432.00 |
| 预提费用 | 277,987.82 |
| 合计 | 278,419.82 |

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 | 47,076,022.86 | 47,076,022.86 |
| 本期申购 | 5,024,971.44 | 5,024,971.44 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -10,132,343.32 | -10,132,343.32 |
| - 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 | 41,968,650.98 | 41,968,650.98 |

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 | 51,685,038.13 | -28,166,142.84 | 23,518,895.29 |
| 本期利润 | -337,051.47 | 5,443,884.72 | 5,106,833.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,586,057.40 | 2,899,948.77 | -2,686,108.63 |
| 其中：基金申购款 | 5,592,584.76 | -2,783,692.17 | 2,808,892.59 |
| 基金赎回款 | -11,178,642.16 | 5,683,640.94 | -5,495,001.22 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 45,761,929.26 | -19,822,309.35 | 25,939,619.91 |

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 |
| 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 | 1,193.03 |
| 其他 | 236.73 |
| 合计 | 22,123.88 |

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 | 106,453,719.35 |
| 减：卖出股票成本总额 | 106,242,667.73 |
| 买卖股票差价收入 | 211,051.62 |

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

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 | 491,964.10 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 491,964.10 |

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 | 5,443,884.72 |
| ——股票投资 | 5,443,884.72 |
| ——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 | 5,443,884.72 |
|----|--------------|

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 | 22,872.98 |
| 基金转换费收入 | 1,897.48 |
| 合计 | 24,770.46 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减；赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减，且不低于赎回费总额的 25%。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分中归入转出基金资产的比例按持有期间递减，且不低于赎回费总额的 25%。

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 | 312,307.68 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 312,307.68 |

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 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 债券托管账户维护费 | 9,126.92 |
| 银行划款手续费 | 324.00 |
| 合计 | 183,011.82 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“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

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 | 8,496,290.56 | 4.21% | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于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

6.4.10.1.3 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 | 7,912.63 | 4.21% | - | - |
| 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 | - | - | - | - |

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 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 | 507,121.75 | 467,881.40 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 251,535.54 | 230,480.13 |

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 1.5%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 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | 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 | 84,520.28 | 77,980.18 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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。

6.4.10.4 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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 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 | 8,916,744.60 | 20,694.12 | 6,618,312.34 | 21,310.93 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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均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

本基金本报告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**

本基金本期末未持有因认购新发/增发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

本基金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

截至本期末，本基金未从事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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

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工商银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

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，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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风险管理岗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，其余均能以合理价格适时变现。

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、结算备付金及债券投资等。

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 | 8,916,744.60 | - | - | - | - | - | 8,916,744.60 |
| 结算备付金 | 244,613.49 | - | - | - | - | - | 244,613.49 |
| 存出保证金 | 35,727.31 | - | - | - | - | - | 35,727.31 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 59,320,095.92 | 59,320,095.92 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,601.76 | 1,601.76 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 93,238.66 | 93,238.66 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 9,197,085.40 | - | - | - | - | 59,414,936.34 | 68,612,021.74 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,215.32 | 3,215.32 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 202,314.59 | 202,314.59 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 82,296.61 | 82,296.61 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 13,716.09 | 13,716.09 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 123,788.42 | 123,788.42 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 278,419.82 | 278,419.82 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 703,750.85 | 703,750.85 |
| 利率敏感度缺口 | 9,197,085.40 | - | - | - | - | - | - |
| 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 | 6,567,690.74 | - | - | - | - | - | 6,567,690.74 |
| 结算备付金 | 92,962.47 | - | - | - | - | - | 92,962.47 |
| 存出保证金 | 21,390.33 | - | - | - | - | - | 21,390.33 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 64,650,806.80 | 64,650,806.80 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,293.25 | 1,293.25 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 4,719.17 | 4,719.17 |
| 资产总计 | 6,682,043.54 | - | - | - | - | 64,656,819.22 | 71,338,862.76 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 364,432.27 | 364,432.27 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 59,274.56 | 59,274.56 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 92,382.38 | 92,382.38 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 15,397.04 | 15,397.04 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 57,945.84 | 57,945.84 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 154,512.52 | 154,512.52 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 743,944.61 | 743,944.61 |
| 利率敏感度缺口 | 6,682,043.54 | - | - | - | - | - | - |

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：同)，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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，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 | 59,320,095.92 | 87.35 | 64,650,806.80 | 91.58 |
| 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 | 59,320,095.92 | 87.35 | 64,650,806.80 | 91.58 |

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% | 3,338,762.62 | 4,063,915.28 |
| 沪深300指数下降5% | -3,338,762.62 | -4,063,915.28 | |

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59,320,095.92元，无属于第二层次和第三层次的余额（2016年12月31日：第一层次64,613,496.40元，第二层次37,310.40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和债券，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）、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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券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，确定相关股票和债券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) 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。

(3) 除公允价值和增值税外，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 | 59,320,095.92 | 86.46 |
| | 其中：股票 | 59,320,095.92 | 86.46 |
| 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 | 9,161,358.09 | 13.35 |
| 7 | 其他各项资产 | 130,567.73 | 0.19 |
| 8 | 合计 | 68,612,021.74 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 37,947,668.43 | 55.88 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,090,848.00 | 7.50 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,954,505.00 | 4.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 808,178.49 | 1.19 |
| 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 | 10,481,067.00 | 15.43 |
| K | 房地产业 | 704,879.00 | 1.04 |
| 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 | 1,332,950.00 | 1.96 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 59,320,095.92 | 87.35 |

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 | 600703 | 三安光电 | 245,140 | 4,829,258.00 | 7.11 |
| 2 | 002179 | 中航光电 | 118,950 | 3,710,050.50 | 5.46 |
| 3 | 600886 | 国投电力 | 413,400 | 3,265,860.00 | 4.81 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 133,300 | 3,187,203.00 | 4.69 |
| 5 | 600153 | 建发股份 | 228,500 | 2,954,505.00 | 4.35 |
| 6 | 601336 | 新华保险 | 55,400 | 2,847,560.00 | 4.19 |
| 7 | 600742 | 一汽富维 | 148,700 | 2,841,657.00 | 4.18 |
| 8 | 600388 | 龙净环保 | 168,000 | 2,609,040.00 | 3.84 |
| 9 | 002002 | 鸿达兴业 | 302,068 | 2,365,192.44 | 3.48 |
| 10 | 000538 | 云南白药 | 24,251 | 2,275,956.35 | 3.35 |
| 11 | 300415 | 伊之密 | 155,520 | 2,245,708.80 | 3.31 |
| 12 | 300323 | 华灿光电 | 160,200 | 2,223,576.00 | 3.27 |
| 13 | 002241 | 歌尔股份 | 107,800 | 2,078,384.00 | 3.06 |
| 14 | 300258 | 精锻科技 | 124,850 | 2,061,273.50 | 3.04 |
| 15 | 601169 | 北京银行 | 216,000 | 1,980,720.00 | 2.92 |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 38,807 | 1,962,858.06 | 2.89 |
| 17 | 002583 | 海能达 | 117,582 | 1,891,894.38 | 2.79 |
| 18 | 600116 | 三峡水利 | 162,800 | 1,824,988.00 | 2.69 |
| 19 | 002185 | 华天科技 | 206,324 | 1,493,785.76 | 2.20 |
| 20 | 600519 | 贵州茅台 | 3,082 | 1,454,241.70 | 2.14 |
| 21 | 000001 | 平安银行 | 147,400 | 1,384,086.00 | 2.04 |
| 22 | 600219 | 南山铝业 | 397,500 | 1,347,525.00 | 1.98 |
| 23 | 000069 | 华侨城A | 132,500 | 1,332,950.00 | 1.96 |
| 24 | 601318 | 中国平安 | 21,800 | 1,081,498.00 | 1.59 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 25 | 002572 | 索菲亚 | 24,872 | 1,019,752.00 | 1.50 |
| 26 | 600270 | 外运发展 | 42,693 | 808,178.49 | 1.19 |
| 27 | 000725 | 京东方 A | 173,200 | 720,512.00 | 1.06 |
| 28 | 600048 | 保利地产 | 70,700 | 704,879.00 | 1.04 |
| 29 | 002425 | 凯撒文化 | 70,694 | 646,143.16 | 0.95 |
| 30 | 600529 | 山东药玻 | 6,954 | 170,859.78 | 0.25 |

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 | 600068 | 葛洲坝 | 5,357,484.50 | 7.59 |
| 2 | 601336 | 新华保险 | 4,952,254.00 | 7.02 |
| 3 | 600703 | 三安光电 | 4,446,878.00 | 6.30 |
| 4 | 002002 | 鸿达兴业 | 3,941,061.00 | 5.58 |
| 5 | 000400 | 许继电气 | 3,599,513.04 | 5.10 |
| 6 | 300136 | 信维通信 | 3,552,622.46 | 5.03 |
| 7 | 002573 | 清新环境 | 3,315,348.00 | 4.70 |
| 8 | 600886 | 国投电力 | 3,111,519.00 | 4.41 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 3,031,477.51 | 4.29 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 2,910,832.00 | 4.12 |
| 11 | 002583 | 海能达 | 2,854,400.53 | 4.04 |
| 12 | 600742 | 一汽富维 | 2,638,287.00 | 3.74 |
| 13 | 600153 | 建发股份 | 2,617,062.00 | 3.71 |
| 14 | 600388 | 龙净环保 | 2,533,486.39 | 3.59 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 2,482,012.00 | 3.52 |
| 16 | 000538 | 云南白药 | 2,281,850.80 | 3.23 |
| 17 | 002572 | 索菲亚 | 2,160,768.00 | 3.06 |
| 18 | 300323 | 华灿光电 | 2,155,337.00 | 3.05 |
| 19 | 600529 | 山东药玻 | 2,149,910.00 | 3.05 |
| 20 | 300415 | 伊之密 | 2,107,558.46 | 2.99 |
| 21 | 600729 | 重庆百货 | 2,086,752.99 | 2.96 |
| 22 | 300258 | 精锻科技 | 2,052,307.07 | 2.91 |
| 23 | 002241 | 歌尔股份 | 2,045,271.00 | 2.90 |
| 24 | 002353 | 杰瑞股份 | 2,036,963.93 | 2.89 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 25 | 002080 | 中材科技 | 2,029,373.00 | 2.87 |
| 26 | 600116 | 三峡水利 | 2,005,358.00 | 2.84 |
| 27 | 002185 | 华天科技 | 1,985,988.55 | 2.81 |
| 28 | 601169 | 北京银行 | 1,936,030.00 | 2.74 |
| 29 | 002425 | 凯撒文化 | 1,920,020.80 | 2.72 |
| 30 | 300197 | 铁汉生态 | 1,902,952.00 | 2.70 |
| 31 | 600104 | 上汽集团 | 1,418,950.00 | 2.01 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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 | 002572 | 索菲亚 | 7,222,241.99 | 10.23 |
| 2 | 600068 | 葛洲坝 | 5,719,854.14 | 8.10 |
| 3 | 002573 | 清新环境 | 4,211,902.69 | 5.97 |
| 4 | 300296 | 利亚德 | 4,170,596.64 | 5.91 |
| 5 | 300136 | 信维通信 | 3,665,900.98 | 5.19 |
| 6 | 600273 | 嘉化能源 | 3,593,429.62 | 5.09 |
| 7 | 600884 | 杉杉股份 | 3,377,710.90 | 4.78 |
| 8 | 600138 | 中青旅 | 3,334,282.70 | 4.72 |
| 9 | 002775 | 文科园林 | 3,306,460.41 | 4.68 |
| 10 | 000400 | 许继电气 | 3,235,242.67 | 4.58 |
| 11 | 600310 | 桂东电力 | 3,181,132.44 | 4.51 |
| 12 | 300207 | 欣旺达 | 2,922,732.40 | 4.14 |
| 13 | 600742 | 一汽富维 | 2,907,312.61 | 4.12 |
| 14 | 300232 | 洲明科技 | 2,798,351.08 | 3.96 |
| 15 | 002074 | 国轩高科 | 2,578,675.00 | 3.65 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 2,527,857.00 | 3.58 |
| 17 | 000039 | 中集集团 | 2,509,039.76 | 3.55 |
| 18 | 002519 | 银河电子 | 2,479,337.00 | 3.51 |
| 19 | 600567 | 山鹰纸业 | 2,425,998.90 | 3.44 |
| 20 | 600258 | 首旅酒店 | 2,416,224.00 | 3.42 |
| 21 | 601336 | 新华保险 | 2,259,419.22 | 3.20 |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 2,100,850.00 | 2.98 |
| 23 | 000978 | 桂林旅游 | 2,096,384.62 | 2.97 |
| 24 | 002080 | 中材科技 | 2,066,830.64 | 2.93 |
| 25 | 600529 | 山东药玻 | 2,038,215.01 | 2.89 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 26 | 002502 | 骅威文化 | 1,977,499.07 | 2.80 |
| 27 | 300197 | 铁汉生态 | 1,955,825.00 | 2.77 |
| 28 | 002002 | 鸿达兴业 | 1,941,009.78 | 2.75 |
| 29 | 600729 | 重庆百货 | 1,940,497.64 | 2.75 |
| 30 | 002090 | 金智科技 | 1,869,308.74 | 2.65 |
| 31 | 000568 | 泸州老窖 | 1,686,445.24 | 2.39 |
| 32 | 002583 | 海能达 | 1,664,447.50 | 2.36 |
| 33 | 600104 | 上汽集团 | 1,632,811.00 | 2.31 |
| 34 | 000603 | 盛达矿业 | 1,525,464.65 | 2.16 |
| 35 | 600398 | 海澜之家 | 1,518,224.88 | 2.15 |
| 36 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,436,582.00 | 2.03 |

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 | 95,468,072.13 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 106,453,719.35 |

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 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。

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。

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。

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 | 35,727.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,601.76 |
| 5 | 应收申购款 | 93,238.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 130,567.73 |

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 |
| 3,301 | 12,713.92 | 42,320.52 | 0.10% | 41,926,330.46 | 99.90% |

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 | 160,057.09 | 0.38% |

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 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013年12月13日）基金份额总额 | 535,770,185.52 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 47,076,022.86 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,024,971.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 10,132,343.32 |
| 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 | 41,968,650.98 |

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 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | | |
|--------------|---|---------------|--------|-----------|--------|--------|
| 方正证券股份有限公司 | 2 | 37,716,211.56 | 18.69% | 35,128.81 | 18.69% | 新增 1 个 |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | 32,046,567.73 | 15.88% | 29,845.02 | 15.88% | - |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | 28,648,376.45 | 14.20% | 26,680.23 | 14.19% | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 22,619,608.32 | 11.21% | 21,065.87 | 11.21% | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | 1 | 19,158,287.20 | 9.49% | 17,841.92 | 9.49% | - |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 13,459,411.32 | 6.67% | 12,534.74 | 6.67% | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 11,686,202.78 | 5.79% | 10,883.31 | 5.79% | - |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | 9,184,533.33 | 4.55% | 8,553.58 | 4.55% | - |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | 8,496,290.56 | 4.21% | 7,912.63 | 4.21% | - |
| 瑞信方正证券有限责任公司 | 2 | 7,624,781.47 | 3.78% | 7,100.80 | 3.78% | 新增 |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 5,622,874.72 | 2.79% | 5,236.52 | 2.79% | - |
| 平安证券股份有限公司 | 1 | 4,605,641.69 | 2.28% | 4,289.17 | 2.28% | - |
| 恒泰证券股份有限公司 | 1 | 950,365.48 | 0.47% | 885.05 | 0.47% | 新增 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | 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 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有 限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞信方正证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证 券股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金 融股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证 券有限责任 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|
| 券有限公司 | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|

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 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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 1 月 26 日 |
| 6 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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 1 月 26 日 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基 | 2017 年 2 月 23 日 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|-----------------|
| | 银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 金管理人网站 | |
| 11 | 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 |
| 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 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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广发证券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 10 日 |
| 21 | 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 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基 | 2017 年 4 月 17 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 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 | 金管理人网站 | |
| 22 | 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17日 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 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 |
| 27 | 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 |
| 28 | 景顺长城成长之星股票型证券投资基金 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 |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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) | 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 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 基金交易费率优惠活动的公告 | | |
| 32 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加厦门市鑫鼎盛控股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8日 |
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增厦门市鑫鼎盛控股有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”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8日 |
| 34 | 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 |
| 35 | 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5月11日 |
| 36 | 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 |
| 37 | 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 |
| 38 | 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 |
| 39 | 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 |
| 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成长之星股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城成长之星股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城成长之星股票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