

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
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.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
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.....	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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63

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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强
场内简称	无
基金主代码	000311
交易代码	000311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 10 月 29 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,225,214,987.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略:本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、</p>

	权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5、中小企业私募债券的投资策略:对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		杨光裕	周慕冰

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.igwfmc.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	71,482,455.50
本期利润	274,439,193.26
加权平均基金份额本期利润	0.3777
本期加权平均净值利润率	18.59%
本期基金份额净值增长率	18.22%
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	891,700,578.63
期末可供分配基金份额利润	0.7278
期末基金资产净值	2,695,863,519.72
期末基金份额净值	2.200
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	120.00%

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。

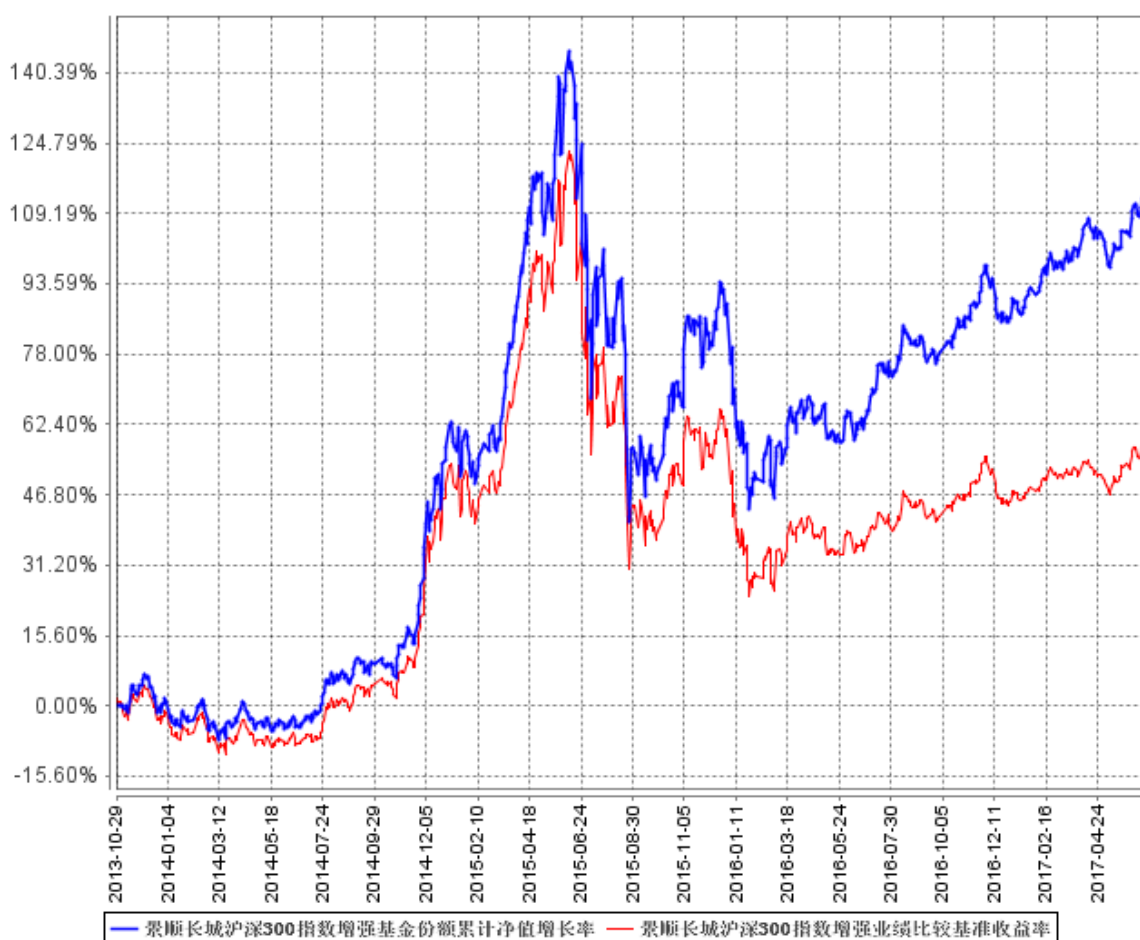
3.2 基金净值表现

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	7.32%	0.68%	4.85%	0.64%	2.47%	0.04%
过去三个月	9.29%	0.67%	6.18%	0.59%	3.11%	0.08%
过去六个月	18.22%	0.63%	11.04%	0.54%	7.18%	0.09%

过去一年	32.93%	0.70%	17.15%	0.64%	15.78%	0.06%
过去三年	127.04%	1.79%	73.44%	1.66%	53.60%	0.13%
自基金合同生效起至今	120.00%	1.67%	61.09%	1.56%	58.91%	0.11%

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



注：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 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		
黎海威	本基金的基金经理、量化及 ETF 投资部投资总监	2013 年 10 月 29 日	-	14 年	经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部投资总监；自 2013 年 10 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、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 7.6%，增速维持稳定，经济整体呈现向

好迹象。6 月份 PMI 指数 51.7, 景气指数回落后有所反弹; PPI 同比上涨 5.5%, 环比下降 0.2%, 同比涨幅缩小; CPI 同比上涨 1.5%, 涨幅略有上升, 通胀预期维持平稳。货币政策基调防风险, 市场流动性继续维持中性。6 月份 M2 增速回落至 9.4%, M1 增速也回落至 15%, 货币供应继续保持较紧的状态; 6 月末外汇储备 3.1 万亿美元, 逐月都有所增加, 汇率受到内外部环境因素影响稳步上升。房地产行业今年以来出现分化。6 月末的 70 个大中城市新建住宅价格指数同比上涨 9.4%, 环比上涨 0.7%, 涨幅维持平稳略有回落; 三四线城市地产销售景气度大幅好于一二线城市, 截至 6 月的全国房地产销售面积累计同比上升 16.1%, 销售额累计同比上升 21.5%。

2017 年上半年市场继续出现分化行情, 沪深 300 指数继续大幅跑赢创业板指数, 业绩稳定的蓝筹股和部分具备竞争优势的白马成长股持续受到市场关注, 靠并购和外延增长的高估值股票继续表现不好。6 月份以后风格趋于平衡。

组合仍主要以选股作为主要的收益来源, 在价值和成长之间保持平衡, 重点关注估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹以及白马成长股。

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 18.22%, 业绩比较基准收益率为 11.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面方面, 中国国内出口依然向好, 消费平稳, 投资边际有走弱尚在预计范围内, 基本面 2 季度平稳过渡。从工业企业利润上看, 经济复苏企业盈利改善依然有韧性, 然而产成品库存已开始筑顶回落表明本轮补库存已经基本完成, 工业生产有向下压力。叠加金融去杠杆导致实体经济融资利率抬升, 预计至 4 季度经济将面临小幅的下行压力。

国际方面, 美联储加息落地, 缩表已在路上, 整体预计依然为渐进式, 对于金融市场的影响相对平缓。欧洲方面表达退出 QE 的可能性, 至今年年底全球主要央行或均转为收缩。

展望下半年, A 股指数可能以波动为主, 缺乏趋势性行情, 但不排除阶段性上行的可能。风格上, 大概率会从大盘龙头股逐渐扩散到估值和成长相对均衡的中盘股。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡, 关注经济小幅下行压力的传导, 在股市波动中以自下而上选股为主以期获得长期投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性、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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——景顺长城基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	146,327,286.40	98,622,324.74
结算备付金		7,443,047.42	1,189,852.97
存出保证金		598,534.60	72,320.16
交易性金融资产	6.4.7.2	2,549,104,919.24	645,198,318.75
其中：股票投资		2,549,104,919.24	645,198,318.75
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		248,870.08	-
应收利息	6.4.7.5	39,573.19	10,443.85
应收股利		-	-
应收申购款		9,734,413.12	1,167,372.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,713,496,644.05	746,260,633.29
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		-	61,533,274.85
应付赎回款		11,240,519.95	763,156.97
应付管理人报酬		2,075,021.72	533,660.81
应付托管费		415,004.34	106,732.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,502,493.53	881,264.29

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	400,084.79	212,314.80
负债合计		17,633,124.33	64,030,403.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,225,214,987.40	366,648,059.63
未分配利润	6.4.7.10	1,470,648,532.32	315,582,169.79
所有者权益合计		2,695,863,519.72	682,230,229.42
负债和所有者权益总计		2,713,496,644.05	746,260,633.29

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.200 元，基金份额总额 1,225,214,987.40 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		290,991,933.75	-47,805,965.87
1.利息收入		461,367.60	101,349.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	461,367.60	101,349.45
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		86,696,923.07	-32,160,481.24
其中：股票投资收益	6.4.7.12	69,599,901.59	-37,044,766.46
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	17,097,021.48	4,884,285.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	202,956,737.76	-15,871,559.23
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	876,905.32	124,725.15
减：二、费用		16,552,740.49	4,349,201.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,198,030.95	1,979,320.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,439,606.13	395,864.03
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,596,786.05	1,682,274.09
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	318,317.36	291,742.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		274,439,193.26	-52,155,166.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		274,439,193.26	-52,155,166.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

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）	366,648,059.63	315,582,169.79	682,230,229.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	274,439,193.26	274,439,193.26
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）	858,566,927.77	880,627,169.27	1,739,194,097.04
其中：1.基金申购款	1,226,556,657.92	1,268,843,258.09	2,495,399,916.01
2.基金赎回款	-367,989,730.15	-388,216,088.82	-756,205,818.97
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	1,225,214,987.40	1,470,648,532.32	2,695,863,519.72

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	209,402,295.59	183,032,714.05	392,435,009.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,155,166.90	-52,155,166.90
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）	33,054,494.76	27,995,497.24	61,049,992.00
其中：1.基金申购款	99,987,865.08	68,953,268.63	168,941,133.71
2.基金赎回款	-66,933,370.32	-40,957,771.39	-107,891,141.71
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）	242,456,790.35	158,873,044.39	401,329,834.74

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

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金(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[2013]1028 号文《关于核准景顺长城沪深 300 指数增强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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2013 年 9 月 23 日至 2013 年 10 月 25 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第 60467014_H04 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 2013 年 10 月 29 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 381,986,684.48 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 155,294.37 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 382,141,978.85 元，折合 382,141,978.85 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。（以下简称“中国农业银行”）

本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 1.5\%$ （指数年收益率，评价时按期间折算）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需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	146,327,286.40
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	146,327,286.40

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	2,343,414,868.20	2,549,104,919.24	205,690,051.04
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		2,343,414,868.20	2,549,104,919.24	205,690,051.04

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

本基金于本期末的买入返售金融资产期末余额为零。

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	32,315.62
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	3,014.46
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4,000.74
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	242.37
合计	39,573.19

6.4.7.6 其他资产

本基金于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	3,502,493.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,502,493.53

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	41,037.02
预提费用	278,518.49
应付指数使用费	80,529.28
合计	400,084.79

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	366,648,059.63	366,648,059.63
本期申购	1,226,556,657.92	1,226,556,657.92
本期赎回(以“-”号填列)	-367,989,730.15	-367,989,730.15
- 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	1,225,214,987.40	1,225,214,987.40

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	230,632,203.13	84,949,966.66	315,582,169.79
本期利润	71,482,455.50	202,956,737.76	274,439,193.26
本期基金份额交易产生的变动数	589,585,920.00	291,041,249.27	880,627,169.27

其中：基金申购款	843,297,556.50	425,545,701.59	1,268,843,258.09
基金赎回款	-253,711,636.50	-134,504,452.32	-388,216,088.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	891,700,578.63	578,947,953.69	1,470,648,532.32

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	359,498.24
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	41,722.81
其他	60,146.55
合计	461,367.60

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	1,953,065,270.52
减：卖出股票成本总额	1,883,465,368.93
买卖股票差价收入	69,599,901.59

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

本基金于本期无衍生工具收益。

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	17,097,021.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,097,021.48

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	202,956,737.76
——股票投资	202,956,737.76
——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	202,956,737.76

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	848,632.30
基金转换费收入	28,273.02
合计	876,905.32

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	7,596,786.05
银行间市场交易费用	-
合计	7,596,786.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
指数使用费	130,529.28
银行划款手续费	9,169.59
其他费用	100.00
合计	318,317.36

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，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 本基金的基金管理人于 2017 年 8 月 2 日宣告 2017 年度第 1 次分红，向截至 2017 年 8 月 4 日止在本基金注册登记人景顺长城基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.900 元；

2. 本基金的基金管理人于 2017 年 8 月 11 日宣告 2017 年度第 2 次分红，向截至 2017 年 8 月 15 日止在本基金注册登记人景顺长城基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 1.500 元；

3. 除上述事项外，截至本财务报表批准报出日，本基金并无其它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
中国农业银行	基金托管人、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**

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间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	7,198,030.95	1,979,320.20
其中：支付销售机构的客户维护费	1,689,150.08	764,977.78

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30
----	------------------------	--------------------------------

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	1,439,606.13	395,864.03

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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
中国农业银行	146,327,286.40	359,498.24	26,590,768.17	90,071.47

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并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

本基金本期及上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

601919	中远海控	2017年5月17日	重大事项停牌	5.41	2017年7月26日	5.89	4,351,829	26,533,242.14	23,543,394.89	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大事项停牌	10.57	-	-	578,990	6,303,182.50	6,119,924.30	-

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涉及的财务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

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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	146,327,286.40	-	-	-	-	-	146,327,286.40
结算备付金	7,443,047.42	-	-	-	-	-	7,443,047.42
存出保证金	598,534.60	-	-	-	-	-	598,534.60

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	2,549,104,919.24	2,549,104,919.24
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	248,870.08	248,870.08
应收利息	-	-	-	-	-	-	39,573.19	39,573.19
应收申购款	-	-	-	-	-	-	9,734,413.12	9,734,413.12
资产总计	154,368,868.42	-	-	-	-	-	2,559,127,775.63	2,713,496,644.05
负债	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	11,240,519.95	11,240,519.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	2,075,021.72	2,075,021.72
应付托管费	-	-	-	-	-	-	415,004.34	415,004.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	3,502,493.53	3,502,493.53
其他负债	-	-	-	-	-	-	400,084.79	400,084.79
负债总计	-	-	-	-	-	-	17,633,124.33	17,633,124.33
利率敏感度缺口	154,368,868.42	-	-	-	-	-	-	-
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	98,622,324.74	-	-	-	-	-	-	98,622,324.74
结算备付金	1,189,852.97	-	-	-	-	-	-	1,189,852.97
存出保证金	72,320.16	-	-	-	-	-	-	72,320.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	645,198,318.75	645,198,318.75
应收利息	-	-	-	-	-	-	10,443.85	10,443.85
应收申购款	18,905.03	-	-	-	-	-	1,148,467.79	1,167,372.82
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	99,903,402.90	-	-	-	-	-	646,357,230.39	746,260,633.29
负债	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	61,533,274.85	61,533,274.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	763,156.97	763,156.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	533,660.81	533,660.81
应付托管费	-	-	-	-	-	-	106,732.15	106,732.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	881,264.29	881,264.29
其他负债	-	-	-	-	-	-	212,314.80	212,314.80
负债总计	-	-	-	-	-	-	64,030,403.87	64,030,403.87
利率敏感度缺口	99,903,402.90	-	-	-	-	-	-	-

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

本基金于本期末未持有交易性债券投资（上年末：无），因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对期末基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

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其它价格风险，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。

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	2,549,104,919.24	94.56	645,198,318.75	94.57
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	2,549,104,919.24	94.56	645,198,318.75	94.57

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%	142,847,512.63	34,456,527.04
沪深 300 指数下降 5%	-142,847,512.63	-34,456,527.04	

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 2,519,317,916.95 元，划分为第二层次的余额为人民币 29,787,002.29 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 639,667,366.13 元，划分为第二层次的余额为人民币 5,530,952.62 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可转换、可交换债券，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

本基金于本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	2,549,104,919.24	93.94
	其中：股票	2,549,104,919.24	93.94
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	153,770,333.82	5.67
7	其他各项资产	10,621,390.99	0.39
8	合计	2,713,496,644.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	29,844,008.00	1.11
B	采矿业	174,873,468.52	6.49
C	制造业	870,947,960.95	32.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,980,735.96	3.41
E	建筑业	88,271,844.00	3.27
F	批发和零售业	75,051,301.60	2.78
G	交通运输、仓储和邮政业	131,944,534.25	4.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,487,522.52	2.54
J	金融业	801,716,144.11	29.74
K	房地产业	128,600,056.52	4.77
L	租赁和商务服务业	82,740,968.11	3.07
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,239,615.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	2,548,698,159.54	94.54

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	399,120.08	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	406,759.70	0.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,722,907	184,693,416.27	6.85
2	000725	京东方 A	22,501,540	93,606,406.40	3.47
3	600900	长江电力	5,980,542	91,980,735.96	3.41
4	600816	安信信托	6,319,893	85,887,345.87	3.19
5	000338	潍柴动力	6,247,508	82,467,105.60	3.06
6	601398	工商银行	15,473,100	81,233,775.00	3.01
7	601818	光大银行	19,936,600	80,743,230.00	3.00
8	002142	宁波银行	3,986,647	76,942,287.10	2.85
9	601899	紫金矿业	20,689,100	70,963,613.00	2.63
10	600036	招商银行	2,926,100	69,963,051.00	2.60
11	600519	贵州茅台	148,181	69,919,204.85	2.59
12	000415	渤海金控	10,298,947	69,311,913.31	2.57
13	000963	华东医药	1,200,046	59,642,286.20	2.21
14	600690	青岛海尔	3,912,500	58,883,125.00	2.18
15	000800	一汽轿车	5,308,646	53,988,929.82	2.00
16	600018	上港集团	8,473,700	53,723,258.00	1.99
17	600009	上海机场	1,408,256	52,542,031.36	1.95
18	600188	兖州煤业	4,084,873	49,998,845.52	1.85
19	601877	正泰电器	2,457,417	49,369,507.53	1.83
20	603993	洛阳钼业	9,124,100	46,167,946.00	1.71
21	601939	建设银行	7,109,021	43,720,479.15	1.62
22	600383	金地集团	3,745,000	42,955,150.00	1.59
23	000651	格力电器	1,013,294	41,717,313.98	1.55
24	600741	华域汽车	1,665,678	40,376,034.72	1.50
25	600309	万华化学	1,390,010	39,809,886.40	1.48
26	601628	中国人寿	1,430,735	38,601,230.30	1.43
27	601328	交通银行	6,139,802	37,821,180.32	1.40
28	600015	华夏银行	4,080,980	37,626,635.60	1.40
29	601601	中国太保	1,080,100	36,582,987.00	1.36
30	002354	天神娱乐	1,464,758	31,492,297.00	1.17

31	601186	中国铁建	2,539,400	30,548,982.00	1.13
32	002714	牧原股份	1,096,400	29,844,008.00	1.11
33	600031	三一重工	3,585,300	29,148,489.00	1.08
34	600325	华发股份	3,344,720	27,928,412.00	1.04
35	000402	金融街	2,344,070	27,472,500.40	1.02
36	600566	济川药业	669,300	25,453,479.00	0.94
37	601919	中远海控	4,351,829	23,543,394.89	0.87
38	600183	生益科技	1,689,100	20,843,494.00	0.77
39	600663	陆家嘴	825,258	19,509,099.12	0.72
40	002174	游族网络	582,604	18,503,503.04	0.69
41	601636	旗滨集团	3,899,500	17,586,745.00	0.65
42	601100	恒立液压	1,042,400	16,980,696.00	0.63
43	600529	山东药玻	688,541	16,917,452.37	0.63
44	000488	晨鸣纸业	1,301,100	16,784,190.00	0.62
45	601669	中国电建	2,072,100	16,411,032.00	0.61
46	000425	徐工机械	4,295,200	16,107,000.00	0.60
47	600068	葛洲坝	1,367,500	15,370,700.00	0.57
48	000830	鲁西化工	2,223,300	15,340,770.00	0.57
49	600061	国投安信	928,630	14,440,196.50	0.54
50	002543	万和电气	566,000	13,906,620.00	0.52
51	600867	通化东宝	744,336	13,576,688.64	0.50
52	000728	国元证券	1,101,500	13,460,330.00	0.50
53	300071	华谊嘉信	1,657,908	13,429,054.80	0.50
54	600507	方大特钢	1,477,700	12,604,781.00	0.47
55	600409	三友化工	1,242,400	12,510,968.00	0.46
56	603198	迎驾贡酒	646,500	12,302,895.00	0.46
57	601390	中国中铁	1,339,300	11,611,731.00	0.43
58	600312	平高电气	813,100	11,171,994.00	0.41
59	601800	中国交建	638,400	10,144,176.00	0.38
60	600153	建发股份	761,600	9,847,488.00	0.37
61	601231	环旭电子	610,400	9,589,384.00	0.36
62	600585	海螺水泥	418,300	9,507,959.00	0.35
63	002315	焦点科技	371,131	9,256,007.14	0.34
64	601225	陕西煤业	1,095,200	7,743,064.00	0.29
65	000921	海信科龙	425,700	7,326,297.00	0.27
66	002601	龙鳞佰利	421,000	6,895,980.00	0.26
67	300316	晶盛机电	522,100	6,521,029.00	0.24
68	600959	江苏有线	578,990	6,119,924.30	0.23
69	600565	迪马股份	1,092,200	6,018,022.00	0.22

70	300427	红相电力	296,000	5,905,200.00	0.22
71	002449	国星光电	349,958	5,791,804.90	0.21
72	601233	桐昆股份	415,300	5,756,058.00	0.21
73	600160	巨化股份	416,900	5,015,307.00	0.19
74	600828	茂业商业	594,800	4,948,736.00	0.18
75	600966	博汇纸业	910,700	4,726,533.00	0.18
76	002146	荣盛发展	477,900	4,716,873.00	0.17
77	300072	三聚环保	124,200	4,601,610.00	0.17
78	600268	国电南自	726,874	4,484,812.58	0.17
79	600551	时代出版	268,500	4,239,615.00	0.16
80	002652	扬子新材	440,100	3,173,121.00	0.12
81	002558	巨人网络	67,400	3,115,228.00	0.12
82	002068	黑猫股份	329,600	2,771,936.00	0.10
83	002482	广田集团	298,900	2,687,111.00	0.10
84	600308	华泰股份	414,700	2,355,496.00	0.09
85	600029	南方航空	245,500	2,135,850.00	0.08
86	002310	东方园林	89,600	1,498,112.00	0.06
87	600801	华新水泥	155,500	1,481,915.00	0.05
88	002475	立讯精密	39,484	1,154,512.16	0.04
89	000528	柳工	110,700	956,448.00	0.04
90	000877	天山股份	69,300	878,031.00	0.03
91	600873	梅花生物	109,700	621,999.00	0.02
92	600297	广汇汽车	81,380	612,791.40	0.02
93	002559	亚威股份	5,400	58,752.00	0.00
94	300315	掌趣科技	69	563.04	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
2	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
3	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
4	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
5	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
6	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00

7	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
8	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
9	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
10	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
11	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
12	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
13	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
14	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
15	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
16	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
17	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
18	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
19	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	601318	中国平安	157,058,426.06	23.02
2	600519	贵州茅台	95,708,189.54	14.03
3	601818	光大银行	84,438,604.10	12.38
4	601398	工商银行	81,623,469.20	11.96
5	601899	紫金矿业	77,911,336.43	11.42
6	000725	京东方A	77,304,247.49	11.33
7	600900	长江电力	72,674,155.51	10.65
8	000415	渤海金控	71,807,071.48	10.53
9	000800	一汽轿车	71,071,187.82	10.42
10	600018	上港集团	64,140,014.61	9.40
11	600015	华夏银行	64,098,256.87	9.40
12	000338	潍柴动力	64,048,043.33	9.39
13	002142	宁波银行	61,896,498.78	9.07
14	601628	中国人寿	61,239,803.28	8.98
15	600036	招商银行	60,672,210.54	8.89
16	600816	安信信托	60,599,764.87	8.88

17	600663	陆家嘴	58,816,829.19	8.62
18	600690	青岛海尔	58,458,648.78	8.57
19	600009	上海机场	58,072,075.87	8.51
20	600383	金地集团	53,623,591.90	7.86
21	600188	兖州煤业	50,721,535.67	7.43
22	601877	正泰电器	50,223,254.84	7.36
23	601939	建设银行	46,737,231.55	6.85
24	000963	华东医药	45,557,719.90	6.68
25	600741	华域汽车	43,706,703.64	6.41
26	601225	陕西煤业	43,236,803.01	6.34
27	600309	万华化学	42,852,393.64	6.28
28	603993	洛阳钼业	42,647,165.61	6.25
29	002354	天神娱乐	42,244,775.30	6.19
30	601328	交通银行	42,009,512.21	6.16
31	000776	广发证券	40,454,873.60	5.93
32	601009	南京银行	39,992,500.90	5.86
33	601186	中国铁建	39,913,157.09	5.85
34	600312	平高电气	39,013,182.17	5.72
35	000651	格力电器	38,614,633.23	5.66
36	000686	东北证券	37,544,811.05	5.50
37	601928	凤凰传媒	34,821,108.55	5.10
38	601601	中国太保	34,329,787.28	5.03
39	600867	通化东宝	34,309,527.30	5.03
40	002146	荣盛发展	33,630,569.19	4.93
41	002714	牧原股份	32,253,280.87	4.73
42	000402	金融街	31,727,362.51	4.65
43	600325	华发股份	31,645,863.79	4.64
44	600739	辽宁成大	30,062,435.95	4.41
45	600688	上海石化	29,004,773.68	4.25
46	601919	中远海控	28,336,250.67	4.15
47	601600	中国铝业	28,274,705.77	4.14
48	600061	国投安信	27,784,901.73	4.07
49	600153	建发股份	27,528,647.99	4.04
50	600031	三一重工	26,494,353.85	3.88
51	601390	中国中铁	26,419,956.51	3.87
52	002174	游族网络	26,091,585.45	3.82

53	002456	欧菲光	25,475,121.55	3.73
54	000568	泸州老窖	24,638,644.36	3.61
55	600566	济川药业	24,267,837.73	3.56
56	601155	新城控股	23,112,067.08	3.39
57	601088	中国神华	22,917,531.40	3.36
58	600183	生益科技	22,215,666.83	3.26
59	002475	立讯精密	18,598,641.26	2.73
60	601636	旗滨集团	17,896,713.34	2.62
61	601669	中国电建	17,759,830.77	2.60
62	601100	恒立液压	17,552,780.35	2.57
63	600529	山东药玻	16,785,425.39	2.46
64	000488	晨鸣纸业	16,550,517.51	2.43
65	600068	葛洲坝	16,298,221.00	2.39
66	600019	宝钢股份	16,208,656.43	2.38
67	000425	徐工机械	16,118,395.33	2.36
68	000728	国元证券	15,563,440.04	2.28
69	601999	出版传媒	15,345,705.35	2.25
70	000830	鲁西化工	14,854,660.98	2.18
71	002543	万和电气	14,817,803.30	2.17
72	002482	广田集团	14,335,660.91	2.10
73	603198	迎驾贡酒	14,271,631.15	2.09
74	300071	华谊嘉信	14,018,002.02	2.05
75	600056	中国医药	13,741,174.35	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	601318	中国平安	60,804,720.87	8.91
2	002146	荣盛发展	54,141,314.69	7.94
3	601009	南京银行	52,533,991.97	7.70
4	000776	广发证券	51,512,183.30	7.55
5	601225	陕西煤业	49,481,045.78	7.25
6	600663	陆家嘴	47,205,215.76	6.92

7	000568	泸州老窖	45,689,682.08	6.70
8	000686	东北证券	45,598,340.54	6.68
9	601928	凤凰传媒	42,448,757.09	6.22
10	600309	万华化学	35,397,844.81	5.19
11	600519	贵州茅台	33,737,828.63	4.95
12	000709	河钢股份	33,121,113.45	4.85
13	600741	华域汽车	32,705,197.50	4.79
14	601600	中国铝业	30,820,020.82	4.52
15	600739	辽宁成大	30,068,491.07	4.41
16	601998	中信银行	29,342,766.13	4.30
17	600688	上海石化	29,010,416.15	4.25
18	002456	欧菲光	28,675,564.56	4.20
19	000651	格力电器	28,579,963.97	4.19
20	601390	中国中铁	28,136,906.26	4.12
21	601155	新城控股	26,272,836.87	3.85
22	600019	宝钢股份	26,217,374.77	3.84
23	601088	中国神华	25,527,802.76	3.74
24	600015	华夏银行	25,484,232.09	3.74
25	601939	建设银行	25,484,200.28	3.74
26	601628	中国人寿	23,681,515.57	3.47
27	600312	平高电气	23,545,810.73	3.45
28	002475	立讯精密	22,022,701.37	3.23
29	600061	国投安信	21,807,410.44	3.20
30	300058	蓝色光标	21,389,915.92	3.14
31	600056	中国医药	21,326,923.82	3.13
32	600867	通化东宝	20,865,454.27	3.06
33	600383	金地集团	20,236,441.33	2.97
34	600000	浦发银行	19,429,739.27	2.85
35	601988	中国银行	19,407,272.00	2.84
36	600153	建发股份	18,606,317.91	2.73
37	601668	中国建筑	17,565,583.72	2.57
38	000725	京东方 A	17,065,911.44	2.50
39	600900	长江电力	15,863,002.00	2.33
40	000800	一汽轿车	15,575,198.06	2.28
41	601999	出版传媒	15,150,719.71	2.22
42	600585	海螺水泥	15,106,143.76	2.21
43	600188	兖州煤业	14,782,623.31	2.17
44	600018	上港集团	14,569,819.58	2.14

45	300113	顺网科技	14,568,269.42	2.14
46	601186	中国铁建	14,226,254.95	2.09
47	000910	大亚圣象	14,178,807.18	2.08

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	3,584,415,231.66
卖出股票收入（成交）总额	1,953,065,270.52

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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	598,534.60
2	应收证券清算款	248,870.08
3	应收股利	-
4	应收利息	39,573.19
5	应收申购款	9,734,413.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,621,390.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
70,515	17,375.24	793,123,724.58	64.73%	432,091,262.82	35.27%

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	127,975.43	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 10 月 29 日）基金份额总额	382,141,978.85
本报告期期初基金份额总额	366,648,059.63
本报告期基金总申购份额	1,226,556,657.92
减:本报告期基金总赎回份额	367,989,730.15
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	1,225,214,987.40

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	
平安证券股份有限公司	21	1,497,012,222.98	27.06%	1,394,155.73	27.06%	-

光大证券股 份有限公司	2	1,401,907,454.16	25.34%	1,305,598.92	25.34%	-
海通证券股 份有限公司	1	658,564,452.90	11.90%	613,326.50	11.90%	-
恒泰证券股 份有限公司	1	439,028,099.43	7.93%	408,868.42	7.93%	-
兴业证券股 份有限公司	1	376,266,180.01	6.80%	350,416.34	6.80%	-
东兴证券股 份有限公司	1	345,910,969.92	6.25%	322,148.48	6.25%	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	229,690,390.05	4.15%	213,911.94	4.15%	-
方正证券股 份有限公司	2	211,046,994.02	3.81%	196,549.69	3.81%	-
民生证券股 份有限公司	1	180,900,477.43	3.27%	168,473.05	3.27%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	125,291,367.69	2.26%	116,683.98	2.26%	-
招商证券股 份有限公司	2	65,160,462.85	1.18%	60,684.24	1.18%	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	2,177,821.00	0.04%	2,028.24	0.04%	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

2、本基金本期租用交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证	-	-	-	-	-	-

券有限责任公司						
川财证券有限责任公司						
广发证券股份有限公司						
华福证券有限责任公司						
东方证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司						
华泰证券股份有限公司						
国盛证券有限责任公司						
东北证券股份有限公司						
长城证券股份有限公司						
国信证券股份有限公司						

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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增微众银行为销售机构并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18日
2	景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金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
3	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
4	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	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

	定期定额投资申购费率优惠活动的公告		
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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 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
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	中国证券报, 上海证	2017 年 3 月 22 日

	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	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
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	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 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
18	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 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
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行基金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 31 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在深圳前海微众银行股份有限公司开通基金“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 31 日
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金面向养老金	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基	2017 年 4 月 20 日

	客户实施特定申购费率的公告	金管理人网站	
27	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
28	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
29	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
30	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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管理管理有限公司为销售机	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

	构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告		
37	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
38	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
39	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
40	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
41	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
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京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6月9日
43	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
44	景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金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13日
45	景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金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13日
46	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行基金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30日
47	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	2017年6月30日

		金管理人网站	
--	--	--------	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170116—20170630	54,316,615.99	393,130,055.06	91,669,337.44	355,777,333.61	29.04%
	2	20170317—20170410	-	163,614,582.63	240,000.00	163,374,582.63	13.33%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪深 300 指数增强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