

景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指 数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

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

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
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.....	49
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.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54

10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城沪深 300 等权重 ETF
场内简称	300 等权
基金主代码	159924
交易代码	159924
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 7 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	42,515,929.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013 年 6 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以沪深 300 等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑）或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	沪深 300 等权重指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国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.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	280,920.27
本期利润	2,691,646.08
加权平均基金份额本期利润	0.0626
本期加权平均净值利润率	4.48%
本期基金份额净值增长率	4.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	18,337,864.97
期末可供分配基金份额利润	0.4313
期末基金资产净值	60,853,793.97
期末基金份额净值	1.431
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	43.10%

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。

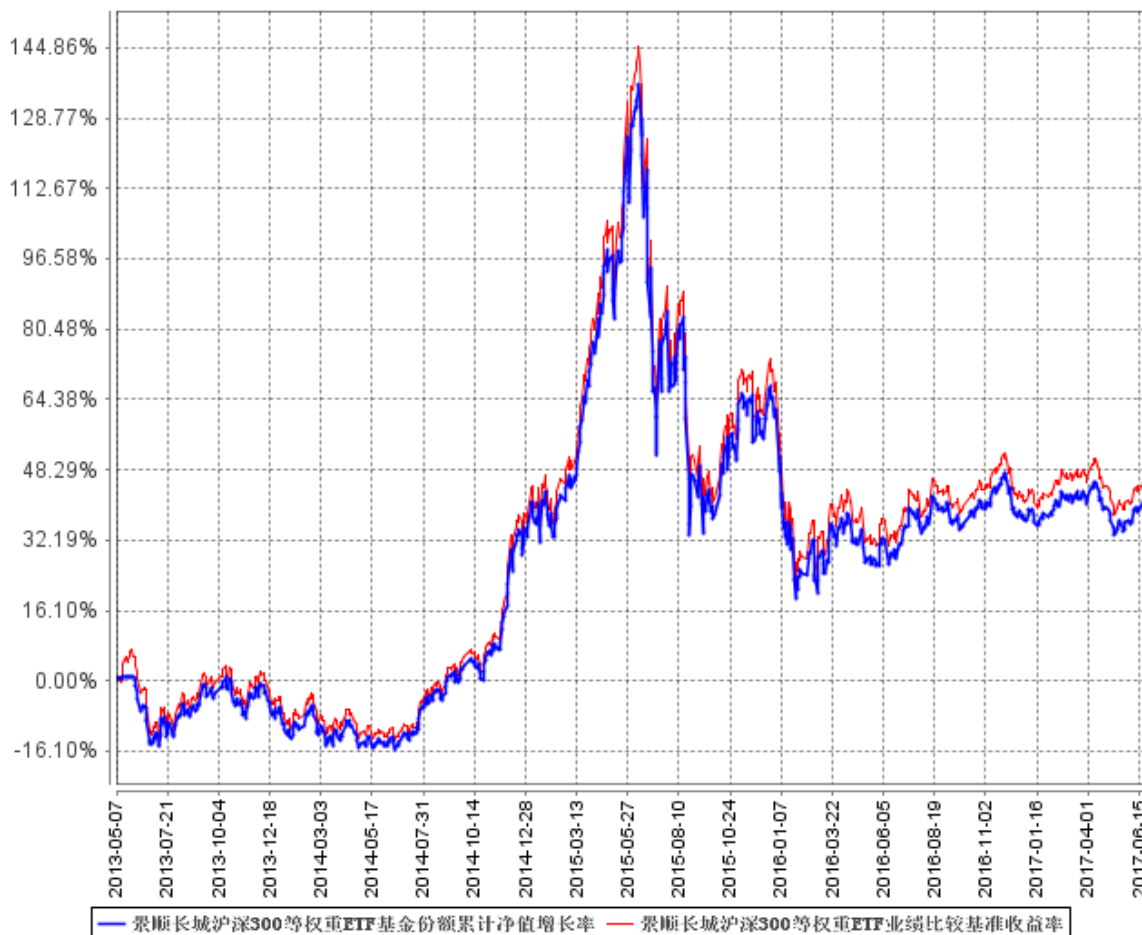
3.2 基金净值表现

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	4.76%	0.58%	4.64%	0.60%	0.12%	-0.02%
过去三个月	1.42%	0.66%	1.20%	0.67%	0.22%	-0.01%
过去六个月	4.53%	0.61%	4.58%	0.62%	-0.05%	-0.01%
过去一年	8.82%	0.73%	9.04%	0.74%	-0.22%	-0.01%
过去三年	64.48%	1.83%	66.22%	1.86%	-1.74%	-0.03%

自基金合同生效起至今	43.10%	1.68%	47.84%	1.72%	-4.74%	-0.04%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（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、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、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）。本基金的建仓期为自 2013 年 5 月 7 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		
徐喻军	本基金的基金经理	2014 年 4 月 19 日	-	7 年	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员职务；自 2014 年 4 月起担任基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年上半年，本基金份额净值增长率为 4.53%，业绩比较基准收益率为 4.58%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，跟踪误差（年化）控制

在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金采用完全复制沪深 300 等权重指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

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

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

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

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

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关

从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

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

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

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

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 等权重交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,002,587.41	1,253,515.38
结算备付金		197.73	-
存出保证金		1,945.70	1,459.14
交易性金融资产	6.4.7.2	59,254,178.16	59,957,906.52
其中：股票投资		59,254,178.16	59,957,906.52
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	357.07	278.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		61,259,266.07	61,213,159.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,359.25	26,525.87
应付托管费		4,871.85	5,305.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	17,969.73	17,347.46

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	358,271.27	200,000.00
负债合计		405,472.10	249,178.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	42,515,929.00	44,515,929.00
未分配利润	6.4.7.10	18,337,864.97	16,448,052.28
所有者权益合计		60,853,793.97	60,963,981.28
负债和所有者权益总计		61,259,266.07	61,213,159.79

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.431 元，基金份额总额 42,515,929.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		3,209,909.90	-16,213,750.49
1.利息收入		4,639.74	6,964.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,636.33	6,961.51
债券利息收入		3.41	3.48
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）		794,544.35	-3,591,257.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	352,888.30	-4,173,382.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,302.69	2,089.81
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	440,353.36	580,035.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,410,725.81	-12,556,352.59
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	-	-73,105.75

减：二、费用		518,263.82	554,614.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	148,910.00	180,834.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,781.95	36,166.98
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	31,040.60	33,357.66
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	308,531.27	304,255.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,691,646.08	-16,768,364.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,691,646.08	-16,768,364.99

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 等权重交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	44,515,929.00	16,448,052.28	60,963,981.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,691,646.08	2,691,646.08
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）	-2,000,000.00	-801,833.39	-2,801,833.39
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-2,000,000.00	-801,833.39	-2,801,833.39
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）	42,515,929.00	18,337,864.97	60,853,793.97

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）	54,515,929.00	32,943,447.25	87,459,376.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,768,364.99	-16,768,364.99
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）	-2,000,000.00	357,523.85	-1,642,476.15
其中：1. 基金申购款	14,000,000.00	4,765,782.33	18,765,782.33
2. 基金赎回款	-16,000,000.00	-4,408,258.48	-20,408,258.48
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）	52,515,929.00	16,532,606.11	69,048,535.11

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 等权重交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第 1542 号《关于核准景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数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《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 870,464,701.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 183 号验资报告予以验证。经向中国证监会备

案,《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 5 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 870,515,929.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 51,228.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]第 181 号文审核同意,本基金 870,515,929.00 份基金份额于 2013 年 6 月 5 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 等权重指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化;主要投资范围为沪深 300 等权重指数的成份股及备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 90%;本基金可少量投资于部分非成份股(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、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、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)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 等权重指数。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本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	2,002,587.41
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,002,587.41

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	59,167,171.26	59,254,178.16	87,006.90
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	59,167,171.26	59,254,178.16	87,006.90

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	356.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.09
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	0.81
合计	357.07

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	17,969.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,969.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

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

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

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,515,929.00	44,515,929.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-2,000,000.00	-2,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	42,515,929.00	42,515,929.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,720,292.57	-11,272,240.29	16,448,052.28
本期利润	280,920.27	2,410,725.81	2,691,646.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,236,276.86	434,443.47	-801,833.39
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,236,276.86	434,443.47	-801,833.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,764,935.98	-8,427,071.01	18,337,864.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	4,486.72

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	128.56
其他	21.05
合计	4,636.33

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	393,498.93
股票投资收益——赎回差价收入	-40,610.63
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	352,888.30

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	10,740,941.05
减：卖出股票成本总额	10,347,442.12
买卖股票差价收入	393,498.93

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,801,833.39
减：现金支付赎回款总额	31,913.39
减：赎回股票成本总额	2,810,530.63
赎回差价收入	-40,610.63

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	38,306.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	37,000.00
减：应收利息总额	3.41
买卖债券差价收入	1,302.69

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	440,353.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	440,353.36

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	2,410,725.81
——股票投资	2,410,725.81
——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	2,410,725.81

6.4.7.17 其他收入

本基金本期其他收入发生额为零。

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	31,040.60
银行间市场交易费用	-
合计	31,040.60

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
银行划款手续费	160.00
其他费用	100.00
合计	308,531.27

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	8,702,439.27	43.11%	9,012,204.95	39.51%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
长城证券	8,104.61	43.11%	8,104.61	45.10%
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	8,393.18	39.51%	7,189.83	39.15%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	148,910.00	180,834.62
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	29,781.95	36,166.98

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金基金管理人于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
中国农业银行	2,002,587.41	4,486.72	1,654,962.93	6,499.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本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**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
601088	中国神华	2017年6月5日	重大事项停牌	22.29	-	-	11,700	231,780.61	260,793.00	-
600050	中国联通	2017年4月5日	重大事项停牌	7.47	2017年8月21日	8.22	29,508	128,386.62	220,424.76	-

600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事项停牌	3.60	-	-	60,862	204,140.57	219,103.20	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22 日	重大事项停牌	7.57	2017 年 7 月 3 日	7.54	28,200	242,570.33	213,474.00	-
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大事项停牌	17.40	-	-	11,200	233,219.40	194,880.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	14.12	-	-	13,650	169,968.32	192,738.00	-
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	20.24	-	-	9,465	151,382.27	191,571.60	-
601608	中信重工	2017 年 4 月 19 日	重大事项停牌	5.54	2017 年 7 月 26 日	5.26	34,500	226,050.63	191,130.00	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事项停牌	5.16	-	-	36,200	233,081.87	186,792.00	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	53,426	199,101.34	183,251.18	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事项停牌	10.57	-	-	17,300	238,893.43	182,861.00	-
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项停牌	30.82	2017 年 7 月 17 日	27.74	5,900	198,754.82	181,838.00	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事项停牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	33,755	317,980.81	180,589.25	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	14.59	-	-	11,601	361,644.88	169,258.59	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项停牌	6.21	-	-	27,175	202,061.77	168,756.75	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.27	-	-	19,791	211,107.26	163,671.57	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事项停牌	7.68	-	-	21,100	204,795.07	162,048.00	-
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大事项停牌	13.48	-	-	10,700	205,404.65	144,236.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事项停牌	24.93	-	-	4,000	113,646.81	99,720.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项停牌	30.68	-	-	3,200	208,459.30	98,176.00	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪沪深 300 等权重指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、

备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本期末，本基金未持有债券投资（上年末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，

或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,002,587.41	-	-	-	-	-	2,002,587.41
结算备付金	197.73	-	-	-	-	-	197.73
存出保证金	1,945.70	-	-	-	-	-	1,945.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,254,178.16	59,254,178.16
应收利息	-	-	-	-	-	357.07	357.07
资产总计	2,004,730.84	-	-	-	-	59,254,535.23	61,259,266.07
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,359.25	24,359.25
应付托管费	-	-	-	-	-	4,871.85	4,871.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,969.73	17,969.73
其他负债	-	-	-	-	-	358,271.27	358,271.27
负债总计	-	-	-	-	-	405,472.10	405,472.10
利率敏感度缺口	2,004,730.84	-	-	-	-	-	-
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	1,253,515.38	-	-	-	-	-	1,253,515.38
存出保证金	1,459.14	-	-	-	-	-	1,459.14
交易性金融资产	-	-	-	-	-	59,957,906.52	59,957,906.52
应收利息	-	-	-	-	-	278.75	278.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,254,974.52	-	-	-	-	59,958,185.27	61,213,159.79
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,525.87	26,525.87
应付托管费	-	-	-	-	-	5,305.18	5,305.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,347.46	17,347.46
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	249,178.51	249,178.51
利率敏感度缺口	1,254,974.52	-	-	-	-	-	-

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交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪沪深 300 等权重指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据

标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	59,254,178.16	97.37	59,957,906.52	98.35
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	59,254,178.16	97.37	59,957,906.52	98.35

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%	2,909,799.53	3,433,113.71
沪深300指数下降5%	-2,909,799.53	-3,433,113.71	

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级的余额为 55,648,865.26 元，属于第二层级的余额为 3,605,312.90 元，无属于第三层级的余额（于 2016 年 12 月 31 日，第一层次：57,781,906.12 元，第二层次：2,176,000.40 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，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票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) 基金申购款

本报告期内，本基金无申购基金份额。（上年度可比期间：本基金申购基金份额的对价总额为 18,765,782.33 元，其中包括以股票支付的申购款 16,376,481.00 元和以现金支付的申购款 2,389,301.33 元）。

(3) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间（含到期）取得的非

保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

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

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	59,254,178.16	96.73
	其中：股票	59,254,178.16	96.73
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	2,002,785.14	3.27
7	其他各项资产	2,302.77	0.00
8	合计	61,259,266.07	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	629,742.86	1.03
B	采矿业	3,010,140.17	4.95
C	制造业	23,162,643.30	38.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,521,577.10	2.50
E	建筑业	2,710,551.72	4.45
F	批发和零售业	1,891,024.97	3.11
G	交通运输、仓储和邮政业	2,812,245.33	4.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,511,841.75	9.06
J	金融业	10,863,833.24	17.85
K	房地产业	3,256,044.72	5.35
L	租赁和商务服务业	954,352.28	1.57
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	609,787.76	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	212,500.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,709,942.60	2.81
S	综合	397,950.36	0.65
	合计	59,254,178.16	97.37

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	11,700	260,793.00	0.43
2	002230	科大讯飞	6,174	246,342.60	0.40
3	002466	天齐锂业	4,400	239,140.00	0.39
4	600816	安信信托	17,400	236,466.00	0.39
5	600309	万华化学	8,222	235,478.08	0.39
6	000651	格力电器	5,670	233,433.90	0.38
7	603993	洛阳钼业	46,100	233,266.00	0.38
8	600570	恒生电子	4,988	232,839.84	0.38
9	600741	华域汽车	9,494	230,134.56	0.38
10	000002	万科A	9,119	227,701.43	0.37
11	000063	中兴通讯	9,514	225,862.36	0.37
12	600373	中文传媒	9,600	225,696.00	0.37
13	000983	西山煤电	25,500	223,635.00	0.37
14	000858	五粮液	3,990	222,083.40	0.36
15	600031	三一重工	27,300	221,949.00	0.36
16	600588	用友网络	12,925	221,276.00	0.36
17	600050	中国联通	29,508	220,424.76	0.36
18	000938	紫光股份	3,600	220,032.00	0.36
19	000333	美的集团	5,112	220,020.48	0.36
20	000069	华侨城A	21,801	219,318.06	0.36

21	601225	陕西煤业	31,000	219,170.00	0.36
22	600795	国电电力	60,862	219,103.20	0.36
23	600498	烽火通信	8,600	218,010.00	0.36
24	600372	中航电子	12,547	217,941.39	0.36
25	601601	中国太保	6,420	217,445.40	0.36
26	300124	汇川技术	8,499	217,064.46	0.36
27	002236	大华股份	9,480	216,238.80	0.36
28	002195	二三四五	30,220	216,073.00	0.36
29	000338	潍柴动力	16,344	215,740.80	0.35
30	002299	圣农发展	14,500	215,615.00	0.35
31	002415	海康威视	6,660	215,118.00	0.35
32	000627	天茂集团	26,600	214,928.00	0.35
33	600519	贵州茅台	453	213,748.05	0.35
34	601607	上海医药	7,394	213,538.72	0.35
35	601727	上海电气	28,200	213,474.00	0.35
36	601127	小康股份	10,700	213,465.00	0.35
37	600153	建发股份	16,462	212,853.66	0.35
38	600893	航发动力	7,790	212,667.00	0.35
39	002044	美年健康	12,500	212,500.00	0.35
40	600887	伊利股份	9,830	212,229.70	0.35
41	000413	东旭光电	18,883	211,867.26	0.35
42	000060	中金岭南	18,900	211,680.00	0.35
43	000963	华东医药	4,258	211,622.60	0.35
44	002074	国轩高科	6,700	211,385.00	0.35
45	000839	中信国安	21,150	211,288.50	0.35
46	002450	康得新	9,375	211,125.00	0.35
47	000559	万向钱潮	19,848	210,785.76	0.35
48	002714	牧原股份	7,741	210,710.02	0.35
49	600549	厦门钨业	9,800	210,602.00	0.35
50	600038	中直股份	4,600	210,542.00	0.35
51	600188	兖州煤业	17,200	210,528.00	0.35
52	002153	石基信息	9,227	209,729.71	0.34
53	600718	东软集团	13,457	209,256.35	0.34
54	000423	东阿阿胶	2,906	208,912.34	0.34
55	600362	江西铜业	12,378	208,693.08	0.34
56	601966	玲珑轮胎	9,300	208,599.00	0.34
57	601318	中国平安	4,194	208,064.34	0.34
58	000792	盐湖股份	19,872	207,662.40	0.34
59	600436	片仔癀	3,400	207,536.00	0.34

60	600089	特变电工	20,075	207,374.75	0.34
61	600271	航天信息	10,040	207,225.60	0.34
62	600085	同仁堂	5,906	206,473.76	0.34
63	002174	游族网络	6,500	206,440.00	0.34
64	000425	徐工机械	54,992	206,220.00	0.34
65	002292	奥飞娱乐	12,184	205,909.60	0.34
66	002424	贵州百灵	10,900	205,574.00	0.34
67	601901	方正证券	20,698	205,531.14	0.34
68	000009	中国宝安	25,404	205,518.36	0.34
69	002411	必康股份	7,100	205,332.00	0.34
70	002558	巨人网络	4,440	205,216.80	0.34
71	600737	中粮糖业	21,700	204,848.00	0.34
72	600036	招商银行	8,557	204,597.87	0.34
73	002081	金螳螂	18,594	204,162.12	0.34
74	601117	中国化学	29,200	204,108.00	0.34
75	601633	长城汽车	15,329	203,722.41	0.33
76	601118	海南橡胶	35,813	203,417.84	0.33
77	002602	世纪华通	5,600	203,056.00	0.33
78	600827	百联股份	12,490	202,962.50	0.33
79	000540	中天金融	29,200	202,940.00	0.33
80	002142	宁波银行	10,511	202,862.30	0.33
81	600068	葛洲坝	18,044	202,814.56	0.33
82	002831	裕同科技	2,700	202,500.00	0.33
83	000568	泸州老窖	4,000	202,320.00	0.33
84	000826	启迪桑德	5,760	202,291.20	0.33
85	000895	双汇发展	8,512	202,160.00	0.33
86	002241	歌尔股份	10,480	202,054.40	0.33
87	002024	苏宁云商	17,960	202,050.00	0.33
88	002152	广电运通	24,300	201,933.00	0.33
89	002008	大族激光	5,827	201,847.28	0.33
90	600170	上海建工	52,838	201,841.16	0.33
91	001979	招商蛇口	9,444	201,723.84	0.33
92	600637	东方明珠	9,306	201,661.02	0.33
93	600066	宇通客车	9,178	201,640.66	0.33
94	300017	网宿科技	16,694	201,496.58	0.33
95	600660	福耀玻璃	7,731	201,315.24	0.33
96	600804	鹏博士	11,326	201,036.50	0.33
97	000538	云南白药	2,142	201,026.70	0.33
98	601211	国泰君安	9,800	200,998.00	0.33

99	601877	正泰电器	10,000	200,900.00	0.33
100	600060	海信电器	13,239	200,835.63	0.33
101	603160	汇顶科技	2,000	200,600.00	0.33
102	002470	金正大	26,616	200,418.48	0.33
103	000725	京东方 A	48,161	200,349.76	0.33
104	600019	宝钢股份	29,813	200,045.23	0.33
105	600685	中船防务	7,300	199,874.00	0.33
106	000623	吉林敖东	8,715	199,486.35	0.33
107	600585	海螺水泥	8,774	199,433.02	0.33
108	600522	中天科技	16,500	198,825.00	0.33
109	601600	中国铝业	43,943	198,622.36	0.33
110	600048	保利地产	19,918	198,582.46	0.33
111	600074	保千里	15,500	198,555.00	0.33
112	600406	国电南瑞	11,248	198,527.20	0.33
113	601155	新城控股	10,700	198,378.00	0.33
114	600332	白云山	6,829	198,314.16	0.33
115	002839	张家港行	12,600	198,072.00	0.33
116	600037	歌华有线	13,600	198,016.00	0.33
117	600690	青岛海尔	13,144	197,817.20	0.33
118	600909	华安证券	19,600	197,764.00	0.32
119	600104	上汽集团	6,368	197,726.40	0.32
120	000738	航发控制	10,100	197,657.00	0.32
121	600535	天士力	4,758	197,647.32	0.32
122	600739	辽宁成大	10,958	197,572.74	0.32
123	000768	中航飞机	10,712	197,529.28	0.32
124	000630	铜陵有色	69,455	197,252.20	0.32
125	000415	渤海金控	29,300	197,189.00	0.32
126	002304	洋河股份	2,270	197,058.70	0.32
127	601888	中国国旅	6,538	197,055.32	0.32
128	600446	金证股份	11,200	196,896.00	0.32
129	002555	三七互娱	7,700	196,889.00	0.32
130	600030	中信证券	11,558	196,717.16	0.32
131	600352	浙江龙盛	20,638	196,680.14	0.32
132	601229	上海银行	7,700	196,658.00	0.32
133	600383	金地集团	17,144	196,641.68	0.32
134	600111	北方稀土	17,350	196,575.50	0.32
135	300072	三聚环保	5,300	196,365.00	0.32
136	000876	新希望	23,860	196,129.20	0.32
137	601169	北京银行	21,372	195,981.24	0.32

138	000776	广发证券	11,359	195,942.75	0.32
139	600820	隧道股份	19,400	195,940.00	0.32
140	601899	紫金矿业	57,110	195,887.30	0.32
141	601933	永辉超市	27,660	195,832.80	0.32
142	601958	金钼股份	27,310	195,812.70	0.32
143	000686	东北证券	19,480	195,774.00	0.32
144	002673	西部证券	13,760	195,667.20	0.32
145	002310	东方园林	11,700	195,624.00	0.32
146	000555	神州信息	11,700	195,390.00	0.32
147	600900	长江电力	12,700	195,326.00	0.32
148	600177	雅戈尔	19,297	195,285.64	0.32
149	600016	民生银行	23,755	195,266.10	0.32
150	002500	山西证券	20,377	195,211.66	0.32
151	000959	首钢股份	27,900	195,021.00	0.32
152	002385	大北农	30,992	194,939.68	0.32
153	000750	国海证券	35,438	194,909.00	0.32
154	600666	奥瑞德	11,200	194,880.00	0.32
155	300024	机器人	9,991	194,824.50	0.32
156	002736	国信证券	14,700	194,775.00	0.32
157	601718	际华集团	22,155	194,742.45	0.32
158	601998	中信银行	30,938	194,600.02	0.32
159	601333	广深铁路	43,051	194,590.52	0.32
160	000001	平安银行	20,718	194,542.02	0.32
161	601166	兴业银行	11,538	194,530.68	0.32
162	002007	华兰生物	5,329	194,508.50	0.32
163	601009	南京银行	17,351	194,504.71	0.32
164	600018	上港集团	30,670	194,447.80	0.32
165	000917	电广传媒	17,193	194,280.90	0.32
166	600703	三安光电	9,854	194,123.80	0.32
167	000156	华数传媒	13,018	194,098.38	0.32
168	600649	城投控股	18,457	193,983.07	0.32
169	600015	华夏银行	21,005	193,666.10	0.32
170	000783	长江证券	20,446	193,623.62	0.32
171	601336	新华保险	3,763	193,418.20	0.32
172	600276	恒瑞医药	3,820	193,253.80	0.32
173	002202	金风科技	12,486	193,158.42	0.32
174	002841	视源股份	2,600	192,972.00	0.32
175	002475	立讯精密	6,599	192,954.76	0.32
176	600061	国投安信	12,400	192,820.00	0.32

177	600100	同方股份	13,650	192,738.00	0.32
178	601611	中国核建	16,100	192,717.00	0.32
179	600674	川投能源	19,610	192,570.20	0.32
180	002183	怡亚通	22,300	192,449.00	0.32
181	600895	张江高科	11,400	192,432.00	0.32
182	600999	招商证券	11,173	192,399.06	0.32
183	601555	东吴证券	17,122	192,280.06	0.32
184	601866	中远海发	53,408	192,268.80	0.32
185	600482	中国动力	7,600	192,204.00	0.32
186	600369	西南证券	34,238	192,075.18	0.32
187	601688	华泰证券	10,729	192,049.10	0.32
188	600233	圆通速递	9,800	191,982.00	0.32
189	000157	中联重科	42,700	191,723.00	0.32
190	300027	华谊兄弟	23,694	191,684.46	0.31
191	002252	上海莱士	9,465	191,571.60	0.31
192	300133	华策影视	17,100	191,520.00	0.31
193	000008	神州高铁	26,300	191,464.00	0.31
194	601398	工商银行	36,450	191,362.50	0.31
195	002508	老板电器	4,400	191,312.00	0.31
196	601818	光大银行	47,212	191,208.60	0.31
197	601608	中信重工	34,500	191,130.00	0.31
198	601988	中国银行	51,655	191,123.50	0.31
199	600518	康美药业	8,788	191,051.12	0.31
200	601800	中国交建	12,019	190,981.91	0.31
201	600010	宝钢股份	87,180	190,924.20	0.31
202	601006	大秦铁路	22,754	190,906.06	0.31
203	600118	中国卫星	6,857	190,898.88	0.31
204	601288	农业银行	54,207	190,808.64	0.31
205	600109	国金证券	16,276	190,754.72	0.31
206	601668	中国建筑	19,700	190,696.00	0.31
207	601985	中国核电	24,400	190,564.00	0.31
208	600688	上海石化	28,820	190,500.20	0.31
209	600705	中航资本	33,700	190,405.00	0.31
210	002465	海格通信	17,700	190,098.00	0.31
211	600157	永泰能源	53,220	189,995.40	0.31
212	601099	太平洋	47,240	189,904.80	0.31
213	002027	分众传媒	13,800	189,888.00	0.31
214	300251	光线传媒	23,180	189,844.20	0.31
215	600150	中国船舶	8,295	189,706.65	0.31

216	601198	东兴证券	11,000	189,640.00	0.31
217	000625	长安汽车	13,131	189,349.02	0.31
218	601328	交通银行	30,721	189,241.36	0.31
219	600958	东方证券	13,600	189,176.00	0.31
220	600256	广汇能源	45,663	189,044.82	0.31
221	601618	中国中冶	37,684	188,796.84	0.31
222	600376	首开股份	16,500	188,760.00	0.31
223	601021	春秋航空	5,600	188,328.00	0.31
224	601018	宁波港	33,324	188,280.60	0.31
225	601669	中国电建	23,770	188,258.40	0.31
226	601216	君正集团	38,496	188,245.44	0.31
227	600682	南京新百	5,100	188,190.00	0.31
228	300070	碧水源	10,090	188,178.50	0.31
229	601997	贵阳银行	11,900	188,139.00	0.31
230	601766	中国中车	18,586	188,090.32	0.31
231	600886	国投电力	23,765	187,743.50	0.31
232	601377	兴业证券	25,250	187,607.50	0.31
233	601939	建设银行	30,496	187,550.40	0.31
234	600489	中金黄金	18,676	187,320.28	0.31
235	600663	陆家嘴	7,923	187,299.72	0.31
236	000793	华闻传媒	18,488	187,098.56	0.31
237	600029	南方航空	21,500	187,050.00	0.31
238	600115	东方航空	27,500	187,000.00	0.31
239	000728	国元证券	15,292	186,868.24	0.31
240	601872	招商轮船	36,200	186,792.00	0.31
241	601163	三角轮胎	7,100	186,730.00	0.31
242	600919	江苏银行	20,100	186,729.00	0.31
243	000402	金融街	15,932	186,723.04	0.31
244	601186	中国铁建	15,515	186,645.45	0.31
245	300033	同花顺	3,000	186,630.00	0.31
246	601857	中国石油	24,245	186,444.05	0.31
247	603858	步长制药	2,600	186,264.00	0.31
248	600008	首创股份	28,300	186,214.00	0.31
249	601881	中国银河	15,700	186,202.00	0.31
250	601375	中原证券	18,500	186,110.00	0.31
251	600196	复星医药	6,001	185,970.99	0.31
252	600009	上海机场	4,983	185,915.73	0.31
253	000166	申万宏源	33,199	185,914.40	0.31
254	002594	比亚迪	3,716	185,614.20	0.31

255	600977	中国电影	9,900	185,328.00	0.30
256	600837	海通证券	12,477	185,283.45	0.30
257	000718	苏宁环球	31,600	185,176.00	0.30
258	600221	海航控股	57,506	185,169.32	0.30
259	000961	中南建设	28,400	185,168.00	0.30
260	600547	山东黄金	6,400	185,152.00	0.30
261	601788	光大证券	12,381	184,848.33	0.30
262	002065	东华软件	8,475	184,670.25	0.30
263	600606	绿地控股	23,600	184,552.00	0.30
264	000671	阳光城	31,700	184,494.00	0.30
265	002797	第一创业	20,020	184,384.20	0.30
266	600000	浦发银行	14,557	184,146.05	0.30
267	300059	东方财富	15,312	184,050.24	0.30
268	000100	TCL 集团	53,426	183,251.18	0.30
269	600959	江苏有线	17,300	182,861.00	0.30
270	601390	中国中铁	21,084	182,798.28	0.30
271	000709	河钢股份	43,594	182,658.86	0.30
272	601628	中国人寿	6,768	182,600.64	0.30
273	000977	浪潮信息	10,500	181,860.00	0.30
274	002049	紫光国芯	5,900	181,838.00	0.30
275	600028	中国石化	30,650	181,754.50	0.30
276	600583	海油工程	29,113	181,665.12	0.30
277	300144	宋城演艺	8,700	181,569.00	0.30
278	002352	顺丰控股	3,400	180,744.00	0.30
279	601919	中远海控	33,755	180,589.25	0.30
280	600926	杭州银行	12,100	179,685.00	0.30
281	600023	浙能电力	32,670	178,378.20	0.29
282	601111	中国国航	18,275	178,181.25	0.29
283	601992	金隅股份	27,500	177,925.00	0.29
284	600415	小商品城	24,554	177,770.96	0.29
285	600340	华夏幸福	5,283	177,403.14	0.29
286	002146	荣盛发展	17,860	176,278.20	0.29
287	300315	掌趣科技	21,400	174,624.00	0.29
288	600021	上海电力	14,200	171,678.00	0.28
289	002131	利欧股份	52,150	171,573.50	0.28
290	600208	新潮中宝	37,805	170,122.50	0.28
291	600871	石化油服	50,800	169,672.00	0.28
292	600485	信威集团	11,601	169,258.59	0.28
293	601989	中国重工	27,175	168,756.75	0.28

294	002129	中环股份	19,791	163,671.57	0.27
295	002739	万达电影	3,200	163,104.00	0.27
296	002426	胜利精密	21,100	162,048.00	0.27
297	600654	*ST 中安	10,700	144,236.00	0.24
298	600297	广汇汽车	19,090	143,747.70	0.24
299	600704	物产中大	16,825	122,654.25	0.20
300	300168	万达信息	8,400	122,220.00	0.20
301	000503	海虹控股	4,000	99,720.00	0.16
302	300104	乐视网	3,200	98,176.00	0.16
303	002456	欧菲光	4,951	89,959.67	0.15

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600019	宝钢股份	419,494.20	0.69
2	600549	厦门钨业	223,380.00	0.37
3	002558	巨人网络	206,271.00	0.34
4	002555	三七互娱	201,925.00	0.33
5	002411	必康股份	201,763.00	0.33
6	002508	老板电器	200,222.00	0.33
7	002044	美年健康	198,345.00	0.33
8	002602	世纪华通	197,081.00	0.32
9	002839	张家港行	196,948.00	0.32
10	601117	中国化学	196,855.00	0.32
11	600436	片仔癀	192,658.00	0.32
12	600977	中国电影	192,582.00	0.32
13	603858	步长制药	192,044.00	0.32
14	601229	上海银行	191,475.00	0.31
15	600522	中天科技	191,068.00	0.31
16	000961	中南建设	190,963.00	0.31
17	600233	圆通速递	190,429.00	0.31

18	600909	华安证券	190,160.00	0.31
19	000959	首钢股份	189,996.00	0.31
20	002841	视源股份	189,401.00	0.31

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	600019	宝钢股份	466,794.70	0.77
2	000778	新兴铸管	261,375.92	0.43
3	600005	武钢股份（退市）	233,811.20	0.38
4	000039	中集集团	225,758.70	0.37
5	601258	庞大集团	210,886.64	0.35
6	300015	爱尔眼科	197,899.75	0.32
7	000027	深圳能源	191,380.00	0.31
8	603885	吉祥航空	182,736.00	0.30
9	300146	汤臣倍健	181,363.00	0.30
10	600754	锦江股份	181,066.53	0.30
11	600648	外高桥	180,279.00	0.30
12	002085	万丰奥威	178,971.00	0.29
13	600875	东方电气	177,769.30	0.29
14	300182	捷成股份	176,589.00	0.29
15	600867	通化东宝	176,308.75	0.29
16	601928	凤凰传媒	174,782.28	0.29
17	000800	一汽轿车	171,715.42	0.28
18	600252	中恒集团	167,891.37	0.28
19	600873	梅花生物	165,227.32	0.27
20	300002	神州泰岳	164,863.57	0.27

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	10,043,518.58
卖出股票收入（成交）总额	10,740,941.05

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，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

1、恒生电子股份有限公司（股票代码：600570）的控股子公司杭州恒生网络技术服务有限公司（以下简称恒生网络）于 2016 年 12 月 13 日收到中国证监会下发的[2016]123 号《行政处罚决定书》。根据该决定书，恒生网络明知一些不具有经营证券业务资质的机构或个人的证券经营模式，仍向其销售具有证券业务属性的软件（涉案软件具有开立证券交易账户、接受证券交易委托、查询证券交易信息、进行证券和资金的交易结算等功能），提供相关服务，并获取收益的行为违反了《证券法》第 122 条规定，构成非法经营证券业务。中国证监会决定：没收恒生网络违法所得约 10,986 万元，并处以约 32,960 万元罚款。

因本报告期末恒生电子属于沪深 300 等权重指数成分股，而本基金通过完全复制沪深 300 等权重指数成分股进行被动式指数化投资，因此持有恒生电子。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,945.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	357.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,302.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601088	中国神华	260,793.00	0.43	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
429	99, 104. 73	31, 650, 277. 00	74. 44%	10, 865, 652. 00	25. 56%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

本基金无联接基金。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	南京紫金资产管理有限公司	12, 349, 630. 00	28. 99%
2	工银安盛人寿保险有限公司	8, 534, 781. 00	20. 04%
3	工银安盛人寿保险有限公司	5, 244, 834. 00	12. 31%
4	江苏舜天股份有限公司	2, 510, 240. 00	5. 89%
5	陕西方直贸易有限公司	2, 058, 200. 00	4. 83%
6	黄燕	786, 038. 00	1. 85%
7	福建道冲投资管理有限公司一道冲 补天 1 号私募基金	445, 508. 00	1. 05%
8	吉林省农村信用社联合社企业年金 计划—交行	384, 900. 00	0. 90%
9	朱东珍	285, 013. 00	0. 67%
10	吴嘉水	280, 599. 00	0. 66%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年5月7日）基金份额总额	870,515,929.00
本报告期期初基金份额总额	44,515,929.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	42,515,929.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

在本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股	1	10,406,444.86	51.55%	9,693.31	51.56%	-

份有限公司						
长城证券股份 有限公司	1	8,702,439.27	43.11%	8,104.61	43.11%	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	1,077,448.01	5.34%	1,003.46	5.34%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 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	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 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	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	38,306.10	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-

中国银河证 券股份有限 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	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 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	-	-	-	-	-	-
东方证券股 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	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 1 月 19 日
2	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
3	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
4	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 3 月 29 日
5	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
6	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 4 月 24 日

7	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 21 日
8	景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 号更新招募说明书摘要	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 21 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日