

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金  
(LOF)  
2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 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：2018 年 3 月 28 日

## §1 重要提示

### 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 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金简称         | 景顺长城资源垄断混合（LOF）    |
| 场内简称         | 景顺资源               |
| 基金主代码        | 162607             |
| 交易代码         | 162607             |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式（LOF）      |
| 基金合同生效日      | 2006 年 1 月 26 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   | 3,179,055,571.19 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         | 2006 年 4 月 7 日     |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                      |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，重点投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。                                                               |
| 投资策略   | 本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。从业务价值、估值、管理能力、自由现金流量与分红政策四个方面结合必要的合理性分析对上市公司的品质和估值水平进行鉴别，选择目标股票构建组合。债券投资部分着重本金安全性和流动性。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×20%                                                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金。                                                                           |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人              | 基金托管人              |
|---------|------|--------------------|--------------------|
| 名称      |      | 景顺长城基金管理有限公司       | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨皞阳                | 贺倩                 |
|         | 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       |

## 2.4 信息披露方式

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公场所    |

### §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2017年            | 2016年            | 2015年            |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 393,382,517.77   | -41,573,786.90   | 2,475,349,838.65 |
| 本期利润          | 498,924,312.77   | -234,086,135.00  | 2,072,370,186.60 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1439           | -0.0673          | 0.5877           |
| 本期基金份额净值增长率   | 30.91%           | -8.39%           | 25.27%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017年末           | 2016年末           | 2015年末           |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1413           | 0.0059           | 0.5434           |
| 期末基金资产净值      | 1,830,082,897.16 | 1,491,679,653.76 | 2,131,053,916.98 |
| 期末基金份额净值      | 0.576            | 0.440            | 0.978            |

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

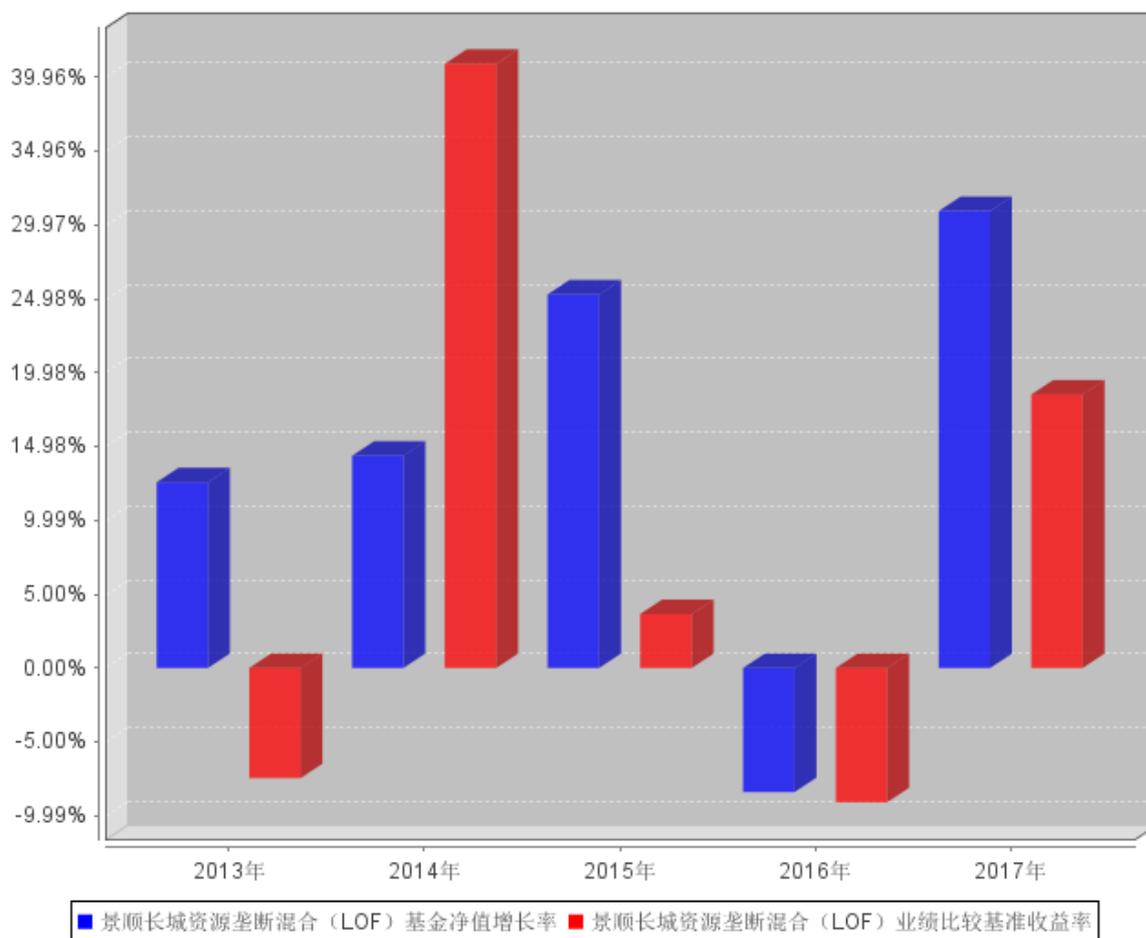
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.05%    | 1.05%       | 3.88%      | 0.64%         | -2.83%  | 0.41% |
| 过去六个月      | 12.94%   | 0.97%       | 7.82%      | 0.56%         | 5.12%   | 0.41% |
| 过去一年       | 30.91%   | 0.94%       | 18.50%     | 0.51%         | 12.41%  | 0.43% |
| 过去三年       | 50.23%   | 2.13%       | 11.67%     | 1.33%         | 38.56%  | 0.80% |
| 过去五年       | 93.41%   | 1.85%       | 45.61%     | 1.23%         | 47.80%  | 0.62% |
| 自基金合同生效起至今 | 412.51%  | 1.73%       | 217.01%    | 1.43%         | 195.50% | 0.30% |

### 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：对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2006 年 1 月 26 日合同生效日起至 2006 年 4 月 25 日为建仓期。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。自 2017 年 9 月 15 日起，本基金业绩比较基准由“富时中国 A200 指数×80%+中国债券总指数×20%”变更为“沪深 300 指数×80%+中国债券总指数×20%”。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年<br>度 | 每10份基金<br>份额分红数 | 现金形式发放总额         | 再投资形式发放<br>总额  | 年度利润分配合计         | 备注 |
|--------|-----------------|------------------|----------------|------------------|----|
| 2017   | -               | -                | -              | -                |    |
| 2016   | 4.000           | 1,518,844,726.95 | 363,461,514.34 | 1,882,306,241.29 |    |
| 2015   | 0.300           | 110,977,903.33   | 76,455,554.08  | 187,433,457.41   |    |
| 合计     | 4.300           | 1,629,822,630.28 | 439,917,068.42 | 2,069,739,698.70 |    |

## §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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理72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

资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金（本基金的最后运作日为2017年12月26日，清算截止日为2018年1月26日）、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（本基金的最后运作日为2017年11月13日，清算截止日为2017年12月8日）、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                    |
|-----|----------|-----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                       |
| 杨锐文 | 本基金的基金经理 | 2015年10月29日     | -    | 7年     | 工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。2010年11月加入本公司，担任研究员职务；自2014年10月起担任基金经理。 |

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遵规守信情况的说明

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、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

##### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

##### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

##### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 37 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品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。投资组合银行间债券交易虽然存在临近交易日同向交易行为，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

本年度，沪深 300 指数上涨 21.78%，价值蓝筹股迎来了“戴维斯双击”，实现了估值和业绩的“双升”。大部分蓝筹股的估值已经接近甚至超过国际同行的水平，我们预计 2017 年的这种蓝筹股表现是不可复制的。但是，A 股投资者机构化趋势是不可逆的，随着市场风格的转向带来基金超越市场的赚钱效应以及理财产品净值化的趋势，越来越多投资者会开始转向投资机构产

品。市场更多的增量资金会更加来自银行、保险、高净值客户和 QFII 等，投资群体会更加理性、更加专业，基本面驱动的投资将会持续主导市场。

本年度，我们并没有像市场大多数绩优的基金一样追逐家电、白酒等蓝筹股，我们依旧坚守于投资优质成长股。我们最看重企业的成长空间，而非短期的增速。我们希望伴随企业由小长大的过程，充分享受企业增速最高的阶段。但是，毫无疑问，我们是在逆风中前行，且面对着非常多的挑战，不过，基金业绩表现仍旧跑赢基准。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，基金仓位处于基金合同规定仓位限制中的中性偏高仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年度，本基金份额净值增长率为 30.91%，业绩比较基准收益率为 18.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

金融去杠杆是长期趋势，A 股存量资金的大格局不会变，我们不应该奢望牛市很快重返，A 股不少公司依然处于高估与被抛售的状况，因此，价值投资未来两三年仍将主导市场。但是，我们对未来市场相对乐观，主要因为是银行自查之后，风险变得可预测且可估量，排雷的步骤亦可预测，可预测的风险就不可怕了，政策对股市的边际压力最大阶段预计已经过去了。从近期证监会的变化来看，重组、再融资都逐步在加速，IPO 过会率也在急剧地下滑。这些悄然的变化都将带来市场风险偏好的恢复。

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

在过往，我们一直看好史上最严的环保核查带来的各种供给侧改革的投资机会。但是，我们现在对这种周期性的机会持有谨慎的态度。我们认为更大的机会将来自于成长股。A 股依旧是情绪化极端的市場，在这个阶段体现于对蓝筹股的强烈追捧，中小市值股票均泥沙俱下。我们认为现在的市場金矿并不在蓝筹股，而是在中小市值的股票。或许在这些股票中，未来能诞生出几倍空间的股票。我们并不希望跟随大众去追逐过热的板块，我们更希望挖掘出低估的机会。4 季度的极端蓝筹股行情，让很多投资者对中小创彻底绝望，不仅仅成交量进入地量状态，且创业板相对沪深 300 估值也达到了历史底部，我们依旧坚信机会不是简单地按市值大小划分。新经济依旧代表着未来，是必然的发展趋势。市場不会持续处于极端状态，我们相信很快能看到市場从极端回归均衡。

在新兴行业中，我们尤其看好以传媒互联网、电子为代表的科技产业的机会。过去几年，我们看到中国企业在不同科技产业中不断取得突破。A 股的高估值吸引了越来越多具有竞争力的科

技公司选择在 A 股 IPO，我们欣喜地发现新一批的 A 股科技股不再是过去那些不靠谱的伪科技股。这些科技股估值并不比市场热炒的“漂亮 50”高，但是，拥有更高的成长空间，甚至更优秀的团队。我们已经无法抵制住诱惑，勇敢去拥抱。当然，第一批吃螃蟹的人必然要承担一定的风险，这也倒逼我们要更加勤勉地研究分析。我们会尽我们所能以最苛刻的标准把风险控制的最小范围内。但是，我们不能因为恐惧风险而放弃拥抱未来。

另外，我们也看好新能源汽车、光伏、风电的机会。特斯拉的成功倒逼着传统车厂加速进入新能源汽车领域，而新能源汽车产业链如同手机产业链一样，大部分配套产业都在中国。中国企业能充分享受到全球新能源汽车的爆发增长。随着光伏、风电价格的下跌，平价上网越来越接近现实，这些行业的增速会越来越快。但是，这些产业具有一定的周期性，我们会择机选择相关优质企业投资。

而对于传统行业，我们相对看好保险、航空的机会，我们更着重于这两个行业的消费属性以及长期成长空间。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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送给基金托管人，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，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委员会的运作。研究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、行业发展及个券状况等各方面因素，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委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究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委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。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。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会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

负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### **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。

截止 2017 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 449,049,397.76 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 196,691,258.89 元，本基金的基金管理人已于 2018 年 1 月 19 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 0.65 元，详细信息请查阅相关分红公告。

#### **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 12 月 31 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

本报告期内，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2017年12月31日         | 上年度末<br>2016年12月31日         |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |                            |                             |
| 银行存款            | 210,739,708.87             | 158,247,549.68              |
| 结算备付金           | 2,626,942.96               | 4,202,087.77                |
| 存出保证金           | 958,718.67                 | 739,588.25                  |
| 交易性金融资产         | 1,618,977,151.61           | 1,262,525,281.81            |
| 其中：股票投资         | 1,618,977,151.61           | 1,262,525,281.81            |
| 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          | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | -                          | 140,000,000.00              |
| 应收证券清算款         | -                          | 963,200.25                  |
| 应收利息            | 47,563.74                  | 43,664.45                   |
| 应收股利            | -                          | -                           |
| 应收申购款           | 50,600,347.87              | 7,350.36                    |
| 递延所得税资产         | -                          | -                           |
| 其他资产            | -                          | -                           |
| 资产总计            | 1,883,950,433.72           | 1,566,728,722.57            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2016年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |                            |                             |
| 短期借款            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         | 47,571,428.77              | 69,983,456.45               |
| 应付赎回款           | 1,580,595.70               | 860,091.53                  |
| 应付管理人报酬         | 2,260,317.00               | 1,916,978.26                |
| 应付托管费           | 376,719.51                 | 319,496.39                  |
| 应付销售服务费         | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 1,918,300.20               | 1,729,250.58                |
| 应交税费            | 19,054.30                  | 19,054.30                   |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付利息          | -                | -                |
| 应付利润          | -                | -                |
| 递延所得税负债       | -                | -                |
| 其他负债          | 141,121.08       | 220,741.30       |
| 负债合计          | 53,867,536.56    | 75,049,068.81    |
| <b>所有者权益：</b> |                  |                  |
| 实收基金          | 1,381,033,499.40 | 1,471,769,891.65 |
| 未分配利润         | 449,049,397.76   | 19,909,762.11    |
| 所有者权益合计       | 1,830,082,897.16 | 1,491,679,653.76 |
| 负债和所有者权益总计    | 1,883,950,433.72 | 1,566,728,722.57 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.576 元，基金份额总额

3,179,055,571.19 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            | 542,470,891.19                            | -198,075,206.12                                |
| 1. 利息收入                | 2,205,274.10                              | 2,166,399.24                                   |
| 其中：存款利息收入              | 1,705,990.45                              | 1,888,397.09                                   |
| 债券利息收入                 | 882.26                                    | 20,538.16                                      |
| 资产支持证券利息收入             | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             | 498,401.39                                | 257,463.99                                     |
| 其他利息收入                 | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 434,035,645.02                            | -9,055,189.58                                  |
| 其中：股票投资收益              | 423,073,547.61                            | -17,228,632.70                                 |
| 基金投资收益                 | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | 151,656.60                                | 730,349.70                                     |
| 资产支持证券投资收益             | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益                | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | -                                         | -                                              |
| 股利收益                   | 10,810,440.81                             | 7,443,093.42                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 105,541,795.00                            | -192,512,348.10                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 688,177.07                                | 1,325,932.32                                   |
| <b>减：二、费用</b>          | 43,546,578.42                             | 36,010,928.88                                  |
| 1. 管理人报酬               | 26,686,254.16                             | 22,435,002.63                                  |

|                            |                       |                        |
|----------------------------|-----------------------|------------------------|
| 2. 托管费                     | 4,447,709.01          | 3,739,167.06           |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                      |
| 4. 交易费用                    | 11,859,597.79         | 9,316,146.48           |
| 5. 利息支出                    | -                     | -                      |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     | -                      |
| 6. 其他费用                    | 553,017.46            | 520,612.71             |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>498,924,312.77</b> | <b>-234,086,135.00</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                      |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>498,924,312.77</b> | <b>-234,086,135.00</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日      |                 |                  |
|----------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|------------------|
|                                        | 实收基金                                        | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,471,769,891.65                            | 19,909,762.11   | 1,491,679,653.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | 498,924,312.77  | 498,924,312.77   |
| 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）      | -90,736,392.25                              | -69,784,677.12  | -160,521,069.37  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 478,434,730.74                              | 79,517,304.44   | 557,952,035.18   |
| 2. 基金赎回款                               | -569,171,122.99                             | -149,301,981.56 | -718,473,104.55  |
| 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）                        | 1,381,033,499.40                            | 449,049,397.76  | 1,830,082,897.16 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）                        | 946,872,578.50    | 1,184,181,338.48  | 2,131,053,916.98  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                 | -234,086,135.00   | -234,086,135.00   |
| 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）      | 524,897,313.15    | 952,120,799.92    | 1,477,018,113.07  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,771,251,957.53  | 815,838,178.46    | 2,587,090,135.99  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,246,354,644.38 | 136,282,621.46    | -1,110,072,022.92 |
| 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） | -                 | -1,882,306,241.29 | -1,882,306,241.29 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,471,769,891.65  | 19,909,762.11     | 1,491,679,653.76  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
康乐

\_\_\_\_\_  
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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2005]第179号《关于同意景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)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《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,154,861,946.80元,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(2006)第8号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2006年1月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

1,155,234,378.92份基金份额,其中认购资金利息折合372,432.12份基金份额。本基金的基

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”)深证上字[2006]第 24 号文审核同意，本基金 18,634,653.00 份基金份额于 2006 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金份额拆分公告》的有关规定，本基金于 2007 年 7 月 26 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.301455159，并于 2007 年 7 月 27 日进行了变更登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具的投资范围为国内依法发行和上市交易的公司股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于股票类资产，股票投资的比例不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的原业绩比较基准为：富时中国 A200 指数(原名为新华富时 200 指数) X 80%+中国债券总指数 X 20%，根据《景顺长城基金管理有限公司关于变更景顺长城内需增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、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)业绩比较基准并相应修订基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自 2017 年 9 月 15 日起变更为：沪深 300 指数 X 80%+中国债券总指数 X 20%。

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 2018 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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与最近一期年度报告一致，会计估计变更参见 7.4.5.2。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自 2017 年 12 月 26 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 关联方关系

| 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、基金销售机构    |
| 长城证券股份有限公司(“长城证券”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 景顺资产管理有限公司             | 基金管理人的股东        |
| 大连实德集团有限公司             | 基金管理人的股东        |
| 开滦(集团)有限责任公司           | 基金管理人的股东        |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司       | 基金管理人的子公司       |

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|----------------------------------------|----------------------|---------------------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                                        | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 长城证券  | 146,636,976.39                         | 1.89%                | 1,131,922,925.75                            | 18.78%               |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日      |                |            |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 136,558.51                       | 1.89%          | -          | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                |            |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 1,054,157.92                     | 18.78%         | 398,655.38 | 23.06%           |

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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                  | 26,686,254.16                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,885,997.61                    | 3,406,928.26                         |

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                  | 4,447,709.01                         |

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0.25%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/当年天数。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |              | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31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 | 210,739,708.87                  | 1,626,582.75 | 158,247,549.68                   | 1,723,763.89 |

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

| 7.4.9.1.1 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<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300664              | 鹏鹞环保 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 新股流通受限 | 8.88 | 8.88   | 3,640        | 32,323.20 | 32,323.20 | -  |

|        |      |             |           |        |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|-------------|-----------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 603161 | 科华控股 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 新股流通受限 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 002923 | 润都股份 | 2017年12月28日 | 2018年1月5日 | 新股流通受限 | 17.01 | 17.01 | 954   | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017年12月25日 | 2018年1月3日 | 新股流通受限 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |

#### 7.4.9.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|-----------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 300730 | 科创信息 | 2017年12月25日 | 重大事项停牌 | 40.93  | 2018年1月2日 | 45.71  | 821   | 6,863.56  | 33,603.53 | -  |
| 002919 | 名臣健康 | 2017年12月28日 | 重大事项停牌 | 35.69  | 2018年1月2日 | 38.79  | 821   | 10,311.76 | 29,301.49 | -  |

注：本基金截至2017年12月31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。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 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 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属于第一层次的余额为 1,618,828,799.40 元，属于第二层次的余额为 148,352.21 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,187,112,172.69 元，第二层次 75,413,109.12 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果无影响。

(3) 除公允价值 and 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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              | 1,618,977,151.61 | 85.94         |
|    | 其中：股票             | 1,618,977,151.61 | 85.94         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -                | -             |
|    | 其中：债券             | -                | -             |
|    | 资产支持证券            | -                | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 213,366,651.83   | 11.33         |
| 8  | 其他各项资产            | 51,606,630.28    | 2.74          |
| 9  | 合计                | 1,883,950,433.72 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 963,737,801.12 | 52.66         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,747,273.20  | 1.19          |
| E  | 建筑业              | 45,566,612.00  | 2.49          |
| F  | 批发和零售业           | 58,971,033.15  | 3.22          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 161,278,727.64 | 8.81          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 47,550,598.97  | 2.60          |
| J  | 金融业              | 222,044,289.22 | 12.13         |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 31,594,759.08  | 1.73          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -             |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 28,785,394.23    | 1.57  |
| 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     | 37,700,663.00    | 2.06  |
| S | 综合            | -                | -     |
|   | 合计            | 1,618,977,151.61 | 88.46 |

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 300323 | 华灿光电 | 7,601,188  | 123,899,364.40 | 6.77         |
| 2  | 300616 | 尚品宅配 | 782,810    | 123,699,636.20 | 6.76         |
| 3  | 002841 | 视源股份 | 1,601,301  | 116,094,322.50 | 6.34         |
| 4  | 000967 | 盈峰环境 | 11,605,579 | 106,539,215.22 | 5.82         |
| 5  | 603197 | 保隆科技 | 1,878,632  | 105,823,340.56 | 5.78         |
| 6  | 002192 | 融捷股份 | 2,867,420  | 94,997,624.60  | 5.19         |
| 7  | 601336 | 新华保险 | 1,314,219  | 92,258,173.80  | 5.04         |
| 8  | 601601 | 中国太保 | 1,927,201  | 79,824,665.42  | 4.36         |
| 9  | 601111 | 中国国航 | 6,156,810  | 75,851,899.20  | 4.14         |
| 10 | 603788 | 宁波高发 | 2,127,153  | 74,982,143.25  | 4.10         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 300616 | 尚品宅配 | 156,535,918.49 | 10.49          |
| 2  | 002841 | 视源股份 | 133,009,093.21 | 8.92           |
| 3  | 000400 | 许继电气 | 127,045,589.37 | 8.52           |
| 4  | 601111 | 中国国航 | 126,102,969.87 | 8.45           |
| 5  | 600029 | 南方航空 | 125,983,847.33 | 8.45           |
| 6  | 000065 | 北方国际 | 120,683,745.80 | 8.09           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 7  | 601689 | 拓普集团 | 116,105,483.43 | 7.78 |
| 8  | 300323 | 华灿光电 | 113,939,490.76 | 7.64 |
| 9  | 300335 | 迪森股份 | 111,908,731.81 | 7.50 |
| 10 | 603197 | 保隆科技 | 111,380,182.06 | 7.47 |
| 11 | 601336 | 新华保险 | 95,259,164.32  | 6.39 |
| 12 | 603788 | 宁波高发 | 94,790,624.11  | 6.35 |
| 13 | 002714 | 牧原股份 | 92,902,930.03  | 6.23 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 92,479,640.98  | 6.20 |
| 15 | 002688 | 金河生物 | 89,899,025.58  | 6.03 |
| 16 | 600977 | 中国电影 | 84,699,807.82  | 5.68 |
| 17 | 603778 | 乾景园林 | 83,017,638.37  | 5.57 |
| 18 | 300232 | 洲明科技 | 72,994,938.56  | 4.89 |
| 19 | 000967 | 盈峰环境 | 71,462,835.51  | 4.79 |
| 20 | 300083 | 劲胜智能 | 65,275,092.00  | 4.38 |
| 21 | 600884 | 杉杉股份 | 65,198,831.92  | 4.37 |
| 22 | 600138 | 中青旅  | 62,113,892.35  | 4.16 |
| 23 | 300413 | 快乐购  | 58,556,107.34  | 3.93 |
| 24 | 600060 | 海信电器 | 57,749,377.12  | 3.87 |
| 25 | 600993 | 马应龙  | 55,308,051.01  | 3.71 |
| 26 | 300015 | 爱尔眼科 | 52,575,192.83  | 3.52 |
| 27 | 002192 | 融捷股份 | 51,322,341.11  | 3.44 |
| 28 | 601788 | 光大证券 | 50,657,550.97  | 3.40 |
| 29 | 002241 | 歌尔股份 | 50,315,023.60  | 3.37 |
| 30 | 600406 | 国电南瑞 | 50,111,840.07  | 3.36 |
| 31 | 000036 | 华联控股 | 48,837,184.49  | 3.27 |
| 32 | 000001 | 平安银行 | 47,964,369.43  | 3.22 |
| 33 | 600340 | 华夏幸福 | 44,293,790.19  | 2.97 |
| 34 | 600426 | 华鲁恒升 | 43,887,528.90  | 2.94 |
| 35 | 600115 | 东方航空 | 43,444,295.00  | 2.91 |
| 36 | 002308 | 威创股份 | 43,116,528.30  | 2.89 |
| 37 | 002850 | 科达利  | 42,772,081.81  | 2.87 |
| 38 | 002273 | 水晶光电 | 40,093,409.40  | 2.69 |
| 39 | 601688 | 华泰证券 | 39,162,094.37  | 2.63 |
| 40 | 601211 | 国泰君安 | 39,130,168.83  | 2.62 |
| 41 | 600030 | 中信证券 | 39,124,156.00  | 2.62 |
| 42 | 000725 | 京东方A | 37,146,092.00  | 2.49 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 43 | 600116 | 三峡水利 | 35,755,638.85 | 2.40 |
| 44 | 600196 | 复星医药 | 35,137,257.06 | 2.36 |
| 45 | 600759 | 洲际油气 | 34,722,156.00 | 2.33 |
| 46 | 300355 | 蒙草生态 | 33,868,546.07 | 2.27 |
| 47 | 600109 | 国金证券 | 31,351,052.80 | 2.10 |
| 48 | 000728 | 国元证券 | 31,351,007.39 | 2.10 |
| 49 | 601377 | 兴业证券 | 31,288,305.66 | 2.10 |
| 50 | 601628 | 中国人寿 | 30,459,750.63 | 2.04 |

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。

#### 8.4.2 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  | 600884 | 杉杉股份 | 143,535,297.66 | 9.62           |
| 2  | 600340 | 华夏幸福 | 127,686,509.90 | 8.56           |
| 3  | 601689 | 拓普集团 | 119,949,134.30 | 8.04           |
| 4  | 002714 | 牧原股份 | 117,324,425.15 | 7.87           |
| 5  | 000400 | 许继电气 | 116,099,980.57 | 7.78           |
| 6  | 300335 | 迪森股份 | 115,807,426.31 | 7.76           |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 110,912,579.88 | 7.44           |
| 8  | 002466 | 天齐锂业 | 97,284,379.95  | 6.52           |
| 9  | 002688 | 金河生物 | 96,042,191.79  | 6.44           |
| 10 | 300145 | 中金环境 | 93,905,016.42  | 6.30           |
| 11 | 603778 | 乾景园林 | 91,316,083.77  | 6.12           |
| 12 | 600029 | 南方航空 | 89,569,347.26  | 6.00           |
| 13 | 002664 | 长鹰信质 | 85,037,953.50  | 5.70           |
| 14 | 601111 | 中国国航 | 76,162,353.24  | 5.11           |
| 15 | 300232 | 洲明科技 | 72,604,960.18  | 4.87           |
| 16 | 300156 | 神雾环保 | 68,867,234.14  | 4.62           |
| 17 | 300015 | 爱尔眼科 | 67,807,968.80  | 4.55           |
| 18 | 300083 | 劲胜智能 | 66,082,532.71  | 4.43           |
| 19 | 300616 | 尚品宅配 | 64,205,352.35  | 4.30           |
| 20 | 002192 | 融捷股份 | 63,019,494.34  | 4.22           |
| 21 | 600993 | 马应龙  | 62,306,093.97  | 4.18           |
| 22 | 000065 | 北方国际 | 59,602,024.47  | 4.00           |
| 23 | 600060 | 海信电器 | 59,338,932.05  | 3.98           |
| 24 | 002460 | 赣锋锂业 | 58,023,842.68  | 3.89           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 25 | 000967 | 盈峰环境 | 57,933,789.35 | 3.88 |
| 26 | 300355 | 蒙草生态 | 55,895,838.52 | 3.75 |
| 27 | 300124 | 汇川技术 | 53,569,883.68 | 3.59 |
| 28 | 000725 | 京东方A | 52,656,659.60 | 3.53 |
| 29 | 000036 | 华联控股 | 51,987,008.43 | 3.49 |
| 30 | 601788 | 光大证券 | 48,875,585.00 | 3.28 |
| 31 | 600759 | 洲际油气 | 45,719,519.46 | 3.06 |
| 32 | 600525 | 长园集团 | 45,143,398.74 | 3.03 |
| 33 | 603366 | 日出东方 | 41,700,404.93 | 2.80 |
| 34 | 002850 | 科达利  | 41,542,420.02 | 2.78 |
| 35 | 300207 | 欣旺达  | 40,313,819.42 | 2.70 |
| 36 | 600030 | 中信证券 | 38,081,897.56 | 2.55 |
| 37 | 600977 | 中国电影 | 37,709,554.88 | 2.53 |
| 38 | 601211 | 国泰君安 | 36,982,358.67 | 2.48 |
| 39 | 601336 | 新华保险 | 36,556,950.50 | 2.45 |
| 40 | 002308 | 威创股份 | 36,443,811.06 | 2.44 |
| 41 | 601688 | 华泰证券 | 36,171,064.88 | 2.42 |
| 42 | 601601 | 中国太保 | 35,843,556.29 | 2.40 |
| 43 | 600115 | 东方航空 | 34,955,578.57 | 2.34 |
| 44 | 601628 | 中国人寿 | 34,853,280.56 | 2.34 |
| 45 | 601699 | 潞安环能 | 34,647,487.86 | 2.32 |
| 46 | 600021 | 上海电力 | 34,143,582.91 | 2.29 |
| 47 | 300203 | 聚光科技 | 33,378,047.90 | 2.24 |
| 48 | 000728 | 国元证券 | 33,097,797.65 | 2.22 |
| 49 | 600777 | 新潮能源 | 32,872,280.62 | 2.20 |
| 50 | 601377 | 兴业证券 | 31,516,859.75 | 2.11 |
| 51 | 600567 | 山鹰纸业 | 30,169,799.64 | 2.02 |
| 52 | 600138 | 中青旅  | 30,013,750.63 | 2.01 |

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。

### 8.4.3 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 | 3,789,347,240.69 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,961,510,713.50 |

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。

### 8.5 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。

**8.6 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。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

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。

**8.12.2**

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。

**8.12.3 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   | 958,718.67 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | -             |
| 4 | 应收利息  | 47,563.74     |
| 5 | 应收申购款 | 50,600,347.87 |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 51,606,630.28 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 101,766      | 31,238.88     | 284,094,044.30 | 8.94%      | 2,894,961,526.89 | 91.06%     |

### 9.2 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<br>比例 |
|----|----------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 栾贵超                        | 1,584,281.00 | 1.84%        |
| 2  | 王淑娟                        | 1,124,458.00 | 1.30%        |
| 3  | 云南国际信托有限公司—云霞 17 期集合资金信托计划 | 1,112,580.00 | 1.29%        |
| 4  | 云南国际信托有限公司—笙岚集合资金信托计划      | 957,900.00   | 1.11%        |
| 5  | 李英杰                        | 897,836.00   | 1.04%        |
| 6  | 刘丽                         | 880,000.00   | 1.02%        |
| 7  | 衣国霞                        | 846,012.00   | 0.98%        |
| 8  | 尹宝亮                        | 728,400.00   | 0.85%        |
| 9  | 戴荣文                        | 706,581.00   | 0.82%        |
| 10 | 傅芳平                        | 658,830.00   | 0.76%        |

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006年1月26日）基金份额总额 | 1,155,234,378.92 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 3,388,007,081.29 |
| 本报告期基金总申购份额               | 1,101,215,650.84 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 1,310,167,160.94 |
| 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              | 3,179,055,571.19 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

本基金管理人于 2017 年 12 月 29 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意许义明先生辞去本公司总经理一职，聘任康乐先生担任本公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 2 月 14 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任赵代中先生担任本公司副总经理。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国农业银行股份有限公司于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 12 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 130,000.00 元。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 |        |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1      | 1,985,321,878.09 | 25.64%       | 1,848,927.70 | 25.64%     | 未变更    |
| 招商证券股份有限公司   | 1      | 954,076,778.45   | 12.32%       | 888,539.52   | 12.32%     | 未变更    |
| 中信证券股份有限公司   | 2      | 628,464,164.10   | 8.12%        | 585,284.59   | 8.12%      | 未变更    |
| 天风证券股份有限公司   | 1      | 559,788,139.05   | 7.23%        | 521,332.65   | 7.23%      | 本期新增   |
| 恒泰证券股份有限公司   | 1      | 507,491,021.62   | 6.55%        | 472,626.91   | 6.55%      | 未变更    |
| 方正证券股份有限公司   | 1      | 341,859,696.22   | 4.42%        | 318,374.49   | 4.42%      | 未变更    |
| 瑞银证券有限责任公司   | 1      | 341,391,632.78   | 4.41%        | 317,933.58   | 4.41%      | 未变更    |
| 平安证券股份有限公司   | 2      | 321,310,107.34   | 4.15%        | 299,235.16   | 4.15%      | 未变更    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | 301,794,816.26   | 3.90%        | 281,062.93   | 3.90%      | 未变更    |
| 东兴证券股份有限公司   | 1      | 293,078,342.96   | 3.79%        | 272,945.19   | 3.79%      | 未变更    |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2      | 212,124,133.89   | 2.74%        | 197,549.36   | 2.74%      | 未变更    |
| 民生证券股份有限公司   | 1      | 205,809,070.84   | 2.66%        | 191,670.93   | 2.66%      | 未变更    |
| 国金证券股份有限公司   | 1      | 201,941,112.57   | 2.61%        | 188,068.74   | 2.61%      | 未变更    |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | 200,581,165.55   | 2.59%        | 186,801.42   | 2.59%      | 未变更    |
| 光大证券股份有限公司   | 1      | 167,058,222.94   | 2.16%        | 155,581.33   | 2.16%      | 未变更    |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1      | 150,530,839.24   | 1.94%        | 140,189.72   | 1.94%      | 未变更    |
| 长城证券股份有限公司   | 2      | 146,636,976.39   | 1.89%        | 136,558.51   | 1.89%      | 未变更    |
| 国信证券股份有限公司   | 1      | 67,900,808.04    | 0.88%        | 63,236.58    | 0.88%      | 未变更    |
| 东方证券股份有限公司   | 1      | 60,668,981.88    | 0.78%        | 56,501.07    | 0.78%      | 未变更    |
| 申万宏源证券有限公司   | 1      | 47,535,274.57    | 0.61%        | 44,269.45    | 0.61%      | 未变更    |
| 东北证券股份有限公司   | 1      | 26,460,817.52    | 0.34%        | 24,642.67    | 0.34%      | 未变更    |
| 中泰证券股份有限公司   | 1      | 21,176,936.15    | 0.27%        | 19,722.22    | 0.27%      | 未变更    |
| 国盛证券有限责任公司   | 1      | -                | -            | -            | -          | 未变更    |
| 广发证券股份有限公司   | 1      | -                | -            | -            | -          | 退租 1 个 |
| 长江证券股份有限公司   | 1      | -                | -            | -            | -          | 本期新增   |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 11.7.2 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 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3,110,442.30 | 53.78%       | 130,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 天风证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 恒泰证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 方正证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 瑞银证券有限责任公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 平安证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东兴证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中国银河证券股份有限公司 | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 民生证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国金证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 光大证券股份有限公司   | -            | -            | -              | -              | -    | -            |

|              |              |        |   |   |   |   |
|--------------|--------------|--------|---|---|---|---|
| 中国国际金融股份有限公司 | -            | -      | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司   | 2,672,996.56 | 46.22% | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 东北证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 国盛证券有限责任公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司   | -            | -      | - | - | - | - |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地维护基金份额持有人利益，以市场更为普遍接受的业绩比较基准评价基金的业绩表现，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2017 年 9 月 15 日起对景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）的业绩比较基准进行调整，并对该基金的基金合同相关条款进行修改。有关详细信息参见本公司于 2017 年 9 月 15 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于变更景顺长城内需增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、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）业绩比较基准并相应修订基金合同的公告》。

景顺长城基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日