

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2017 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 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。

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，基金管理人在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。

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、基金净值表现及利润分配情况	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.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	19

6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	67
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.....	67
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.....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	70
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
9.5 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.....	71
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79
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	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	186,572,956.00 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	2014 年 1 月 21 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	本基金以中证 500 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（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）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，结合经验判断，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%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		杨光裕	陈四清

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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	6,873,288.41	-6,529,267.29	17,219,963.37
本期利润	-130,294.89	-21,838,065.84	17,353,462.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0008	-0.4067	0.4133
本期加权平均净值利润率	-0.05%	-25.14%	21.62%
本期基金份额净值增长率	2.25%	-17.82%	42.24%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	124,327,057.45	31,851,311.81	59,547,912.55
期末可供分配基金份额利润	0.6664	0.6298	0.9831
期末基金资产净值	310,900,013.45	82,424,267.81	120,120,868.55
期末基金份额净值	1.6664	1.6298	1.9831
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	66.64%	62.98%	98.31%

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、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

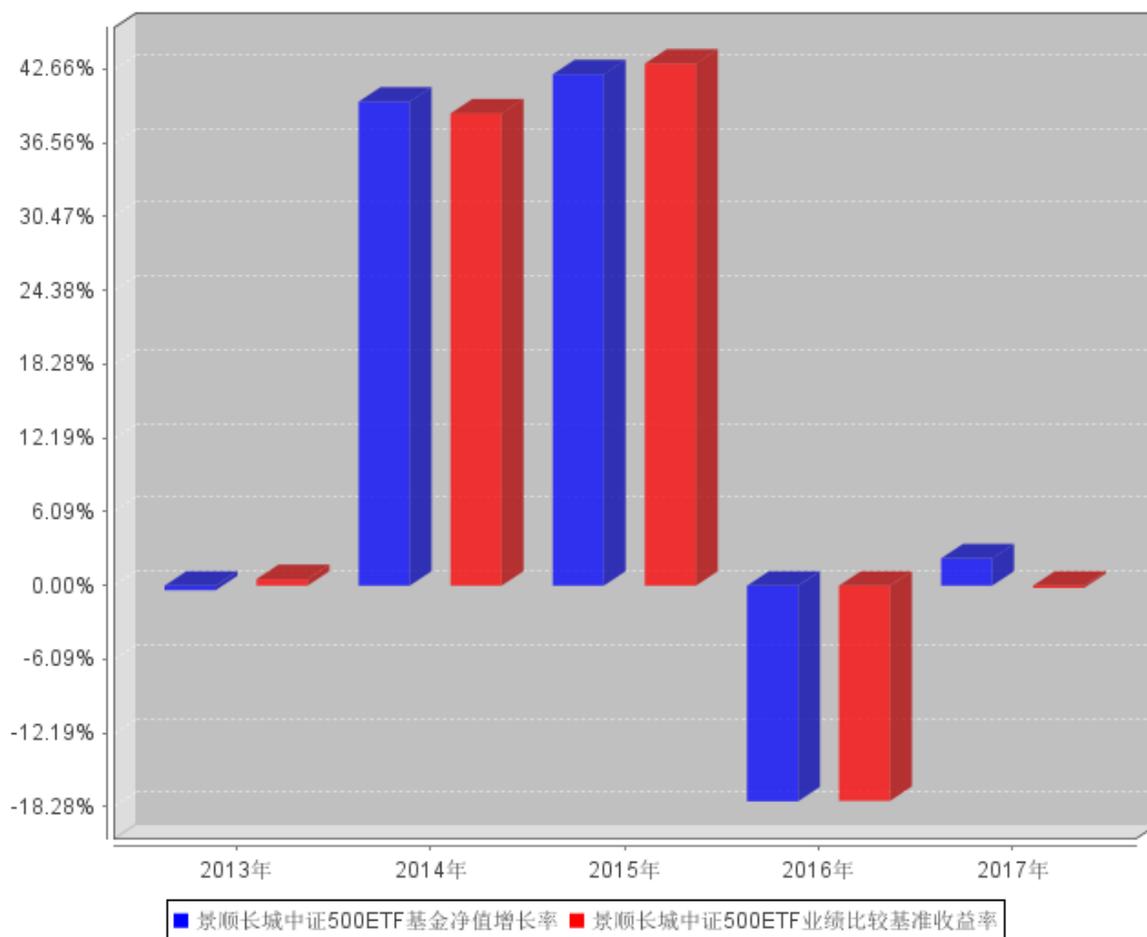
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.54%	0.96%	-5.34%	0.98%	0.80%	-0.02%
过去六个月	3.53%	0.94%	1.84%	0.96%	1.69%	-0.02%
过去一年	2.25%	0.91%	-0.20%	0.93%	2.45%	-0.02%
过去三年	19.52%	2.01%	17.44%	2.03%	2.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	66.64%	1.84%	64.13%	1.86%	2.51%	-0.02%

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



注：本基金的投资组合比例为：本基金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%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 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。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：2013 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2013 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
徐喻军	本基金的 基金经理	2014 年 12 月 27 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、《景顺长城中证 500 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组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

2017 年全年 GDP 增长 6.9%，工业增加值累计增长 6.6%，增速维持稳定。12 月制造业 PMI 指数 51.6，景气指数略有回落；12 月 PPI 同比上涨 4.9%，环比上涨 0.8%，同比涨幅回落；12 月 CPI 同比上涨 1.8%，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 年权益市场呈现出较大的分化行情，沪深 300 指数 21.78% 的升幅与创业板指数-10.67% 的跌幅相差超过 30%，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持续表现不好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年，本基金份额净值增长率为 2.25%，业绩比较基准收益率为-0.20%。2017 年，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 2018 年，经济基本面仍可能延续企稳态势，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中证 500 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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、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。

4.8 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。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 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

从 2017 年 3 月 24 日至 2017 年 5 月 11 日，从 2017 年 9 月 25 日至 2017 年 12 月 21 日，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 21582 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“景顺长城中证 500ETF”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了景顺长城中证 500ETF2017 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于景顺长城中证 500ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>景顺长城中证 500ETF 的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估景顺长城中证 500ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算景顺长城中证 500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城中证 500ETF 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的

责任	<p>重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城中证 500ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 500ETF 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮 朱宏宇
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,204,702.88	1,205,918.59
结算备付金		38,264.11	4,154.88
存出保证金		9,471.25	2,600.65
交易性金融资产	7.4.7.2	305,000,668.48	81,475,537.41
其中：股票投资		305,000,668.48	81,475,537.41
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,264.72	260.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		311,254,371.44	82,688,471.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		131,593.90	35,601.36
应付托管费		26,318.78	7,120.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	86,445.31	21,482.39

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	110,000.00	200,000.00
负债合计		354,357.99	264,204.03
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	186,572,956.00	50,572,956.00
未分配利润	7.4.7.10	124,327,057.45	31,851,311.81
所有者权益合计		310,900,013.45	82,424,267.81
负债和所有者权益总计		311,254,371.44	82,688,471.84

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6664 元，基金份额总额 186,572,956.00 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		2,368,944.99	-20,690,332.85
1.利息收入		59,548.01	14,771.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	59,518.62	14,748.38
债券利息收入		29.39	22.75
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）		9,024,427.83	-5,396,305.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,604,197.32	-5,998,562.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,315.22	15,836.25
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,404,915.29	586,420.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-7,003,583.30	-15,308,798.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	288,552.45	-
减：二、费用		2,499,239.88	1,147,732.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,329,845.81	434,535.31
2. 托管费	7.4.10.2.2	265,969.21	86,907.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	281,499.66	75,715.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	621,925.20	550,575.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-130,294.89	-21,838,065.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-130,294.89	-21,838,065.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	50,572,956.00	31,851,311.81	82,424,267.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-130,294.89	-130,294.89
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）	136,000,000.00	92,606,040.53	228,606,040.53
其中：1.基金申购款	146,000,000.00	99,354,675.03	245,354,675.03
2.基金赎回款	-10,000,000.00	-6,748,634.50	-16,748,634.50
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）	186,572,956.00	124,327,057.45	310,900,013.45

项目	上年度可比期间 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)	60,572,956.00	59,547,912.55	120,120,868.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-21,838,065.84	-21,838,065.84
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)	-10,000,000.00	-5,858,534.90	-15,858,534.90
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	-5,858,534.90	-15,858,534.90
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)	50,572,956.00	31,851,311.81	82,424,267.81

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

景顺长城中证 500 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[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 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《景顺长城中证 500 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指数基金,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 512,538,347.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同

生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 34,609.00 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[2014]第 17 号文审核同意,本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 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《景顺长城中证 500 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中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。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%,且不低于非现金基金资产的 80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(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(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中证 500 指数。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城中证 500ETF 联接基金”)。景顺长城中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，本基金的基金管理人可进行收益分配；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	6,204,702.88	1,205,918.59
定期存款	-	-
其中:存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	6,204,702.88	1,205,918.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末		
	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	322,807,352.46	305,000,668.48	-17,806,683.98
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	322,807,352.46	305,000,668.48	-17,806,683.98
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,278,638.09	81,475,537.41	-10,803,100.68
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	92,278,638.09	81,475,537.41	-10,803,100.68

注：于 2017 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元（2016 年 12 月 31 日：0.00 元）。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,243.22	257.21
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	17.20	1.90
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	4.30	1.20
合计	1,264.72	260.31

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	86,445.31	21,482.39
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	86,445.31	21,482.39

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	60,000.00	150,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	110,000.00	200,000.00

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,572,956.00	50,572,956.00

本期申购	146,000,000.00	146,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-10,000,000.00	-10,000,000.00
- 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	186,572,956.00	186,572,956.00

7.4.7.10 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	59,877,029.89	-28,025,718.08	31,851,311.81
本期利润	6,873,288.41	-7,003,583.30	-130,294.89
本期基金份额交易产生的变动数	159,476,019.62	-66,869,979.09	92,606,040.53
其中：基金申购款	171,224,805.88	-71,870,130.85	99,354,675.03
基金赎回款	-11,748,786.26	5,000,151.76	-6,748,634.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	226,226,337.92	-101,899,280.47	124,327,057.45

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	57,631.27	14,254.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,812.53	396.29
其他	74.82	97.84
合计	59,518.62	14,748.38

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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	2016年1月1日至2016年12

	12 月 31 日	月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,367,454.62	-2,796,942.34
股票投资收益——赎回差价收入	-763,257.30	-3,201,619.95
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	6,604,197.32	-5,998,562.29

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	90,231,629.41	24,395,944.43
减：卖出股票成本总额	82,864,174.79	27,192,886.77
买卖股票差价收入	7,367,454.62	-2,796,942.34

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	16,748,634.50	15,858,534.90
减：现金支付赎回款总额	320,059.50	294,060.90
减：赎回股票成本总额	17,191,832.30	18,766,093.95
赎回差价收入	-763,257.30	-3,201,619.95

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	168,044.61	124,359.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	152,700.00	108,500.00
减：应收利息总额	29.39	22.75
买卖债券差价收入	15,315.22	15,836.25

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,404,915.29	586,420.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,404,915.29	586,420.61

7.4.7.16 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,003,583.30	-15,308,798.55
——股票投资	-7,003,583.30	-15,308,798.55
——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	-7,003,583.30	-15,308,798.55

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元(上年度可比期间：0.00元)。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	288,552.45	-

合计	288,552.45	-
----	------------	---

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	281,499.66	75,715.54
银行间市场交易费用	-	-
合计	281,499.66	75,715.54

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	240,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	1,925.20	575.00
合计	621,925.20	550,575.00

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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
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
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（“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	90,901,937.79	48.40%	18,491,715.95	36.75%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31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	84,657.05	48.40%	43,693.30	50.54%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	17,221.54	36.76%	7,403.65	34.46%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,329,845.81	434,535.31
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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	265,969.21	86,907.14

注：支付基金托管人中国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 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
景顺长城中证 500ETF 联接基金	182,000,000.00	97.55%	46,000,000.00	90.96%

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 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
中国银行	6,204,702.88	57,631.27	1,205,918.59	14,254.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

7.4.12.2 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
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	95,839	1,503,351.22	1,513,297.81	-
300156	神雾环保	2017 年 7 月 17 日	重大事项停牌	24.16	2018 年 1 月 17 日	21.74	44,500	1,394,577.45	1,075,120.00	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	重大事项停牌	26.45	-	-	40,300	1,020,965.73	1,065,935.00	-
000930	中粮生化	2017 年 10 月 24 日	重大事项停牌	13.34	-	-	70,888	968,539.31	945,645.92	-
300383	光环新网	2017 年 11 月 7 日	重大事项停牌	13.19	2018 年 3 月 19 日	14.51	63,800	803,094.48	841,522.00	-
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大事项停牌	12.89	-	-	64,018	922,915.32	825,192.02	-

000547	航天发展	2017年10月30日	重大事项停牌	10.83	-	-	73,600	1,269,002.20	797,088.00	-
600614	鹏起科技	2017年12月26日	重大事项停牌	10.16	-	-	77,032	1,019,401.97	782,645.12	-
002512	达华智能	2017年12月6日	重大事项停牌	18.07	2018年3月6日	16.26	40,500	677,479.56	731,835.00	-
000979	中弘股份	2017年9月7日	重大事项停牌	1.94	2018年2月14日	1.75	370,166	789,087.82	718,122.04	-
002745	木林森	2017年12月28日	重大事项停牌	45.50	2018年1月5日	46.50	15,400	714,791.00	700,700.00	-
002004	华邦健康	2017年12月14日	重大事项停牌	6.73	2018年3月14日	7.30	103,710	977,813.24	697,968.30	-
000401	冀东水泥	2017年11月21日	重大事项停牌	13.79	2018年1月15日	15.17	49,617	702,382.98	684,218.43	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大事项停牌	9.85	2018年3月8日	8.87	69,319	645,567.16	682,792.15	-
000592	平潭发展	2017年8月9日	重大事项停牌	5.75	2018年1月29日	5.70	113,500	869,320.49	652,625.00	-
600664	哈药股份	2017年9月28日	重大事项停牌	5.81	2018年2月27日	6.00	112,270	962,383.93	652,288.70	-
600645	中源协和	2017年10月9日	重大事项停牌	28.40	2018年1月19日	25.56	22,530	673,676.87	639,852.00	-
000031	中粮地产	2017年7月24日	重大事项停牌	8.00	-	-	79,957	783,254.81	639,656.00	-
000926	福星股份	2017年12月26日	重大事项停牌	10.89	2018年1月10日	11.98	55,290	681,494.57	602,108.10	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项停牌	4.99	-	-	115,408	714,208.38	575,885.92	-
300159	新研股份	2017年11月23日	重大事项停牌	10.40	2018年3月22日	9.36	54,800	837,249.44	569,920.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年12月18日	重大事项停牌	7.62	-	-	70,800	668,935.40	539,496.00	-
000806	银河生物	2017年7月18日	重大事项停牌	10.76	2018年1月18日	10.01	48,700	663,339.60	524,012.00	-
000156	华数传媒	2017年12月26日	重大事项停牌	11.40	-	-	41,700	540,180.00	475,380.00	-
300134	大富科技	2017年12月18日	重大事项停牌	16.45	2018年3月19日	14.81	27,900	602,900.23	458,955.00	-
600187	国中水务	2017年11月9日	重大事项停牌	4.68	2018年3月20日	4.21	97,200	603,391.53	454,896.00	-
002122	天马股份	2017年12月19日	重大事项停牌	8.49	-	-	51,918	547,597.81	440,783.82	-
002358	森源电气	2017年12月	重大事项	14.86	2018年3月	15.05	28,000	556,365.56	416,080.00	-

		月 7 日	停牌		月 7 日					
000766	通化金马	2017 年 11 月 24 日	重大事项停牌	13.60	-	-	28,500	491,381.28	387,600.00	-
300010	立思辰	2017 年 11 月 17 日	重大事项停牌	11.17	2018 年 2 月 22 日	10.05	31,900	534,949.32	356,323.00	-
002345	潮宏基	2017 年 12 月 20 日	重大事项停牌	10.75	-	-	32,980	377,532.07	354,535.00	-
300032	金龙机电	2017 年 11 月 27 日	重大事项停牌	13.89	-	-	23,800	380,526.64	330,582.00	-
002344	海宁皮城	2017 年 11 月 1 日	重大事项停牌	7.93	2018 年 1 月 31 日	7.44	37,800	468,482.94	299,754.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 12 月 19 日	重大事项停牌	13.76	-	-	16,920	205,105.20	232,819.20	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事项停牌	12.50	2018 年 3 月 21 日	11.88	6,242	130,240.24	78,025.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项停牌	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 500 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，跟踪中证 500 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。

7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资 (2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理

人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,204,702.88	0.00	0.00	0.00	0.00	-	6,204,702.88
结算备付金	38,264.11	-	-	-	-	-	38,264.11
存出保证金	9,471.25	-	-	-	-	-	9,471.25
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	305,000,668.48	305,000,668.48
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,264.72	1,264.72
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	0.00	-	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	6,252,438.24	0.00	0.00	0.00	0.00	305,001,933.20	311,254,371.44
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-	0.00

应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	131,593.90	131,593.90
应付托管费	-	-	-	-	-	26,318.78	26,318.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	86,445.31	86,445.31
应付利息	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	354,357.99	354,357.99
利率敏感度缺口	6,252,438.24	0.00	0.00	0.00	0.00	-	-
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,205,918.59	-	-	-	-	-	1,205,918.59
结算备付金	4,154.88	-	-	-	-	-	4,154.88
存出保证金	2,600.65	-	-	-	-	-	2,600.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	81,475,537.41	81,475,537.41
应收利息	-	-	-	-	-	260.31	260.31
资产总计	1,212,674.12	-	-	-	-	81,475,797.72	82,688,471.84
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,601.36	35,601.36
应付托管费	-	-	-	-	-	7,120.28	7,120.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	21,482.39	21,482.39
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	264,204.03	264,204.03
利率敏感度缺口	1,212,674.12	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

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

本基金采用完全复制法，跟踪中证 500 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。本基金投资组合中，中证 500 指数成份股和备选成份股股票投资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)。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	305,000,668.48	98.10	81,475,537.41	98.85
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	305,000,668.48	98.10	81,475,537.41	98.85

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
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12月31日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	13,219,566.27	5,087,388.90
	沪深 300 指数下降 5%	-13,219,566.27	-5,087,388.90

7.4.14 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 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 283,108,501.75 元，属于第二层次的余额为 21,892,166.73 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 75,222,410.08 元，第二层次 6,253,127.33 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、交易不活跃期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中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) 基金申购款

于 2017 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 245,354,675.03 元，其中包括以股票支付的申购款 228,032,184.20 元和以现金支付的申购款 17,322,490.83 元（2016 年度：本基金申购基金份额的对价总额为零元）。

(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，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。

(4) 除上述 (1)、(2) 和 (3) 所述事项外，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	305,000,668.48	97.99
	其中：股票	305,000,668.48	97.99
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	6,242,966.99	2.01
8	其他各项资产	10,735.97	0.00
9	合计	311,254,371.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,113,473.16	1.64
B	采矿业	10,486,944.50	3.37
C	制造业	180,914,918.53	58.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,632,095.03	3.10
E	建筑业	6,956,582.10	2.24
F	批发和零售业	16,202,102.86	5.21
G	交通运输、仓储和邮政业	9,888,846.81	3.18
H	住宿和餐饮业	377,793.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,189,799.45	8.10
J	金融业	5,698,326.24	1.83
K	房地产业	18,107,929.66	5.82
L	租赁和商务服务业	5,131,042.02	1.65
M	科学研究和技术服务业	639,852.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	3,398,268.10	1.09

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	363,818.00	0.12
Q	卫生和社会工作	562,156.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	4,007,466.87	1.29
S	综合	1,562,452.00	0.50
	合计	304,233,866.33	97.86

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	666,265.26	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	766,802.15	0.25

8.2.3 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所有股票投资明细

8.3.1 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	600516	方大炭素	78,100	2,255,528.00	0.73
2	600201	生物股份	65,459	2,077,668.66	0.67
3	600176	中国巨石	127,474	2,076,551.46	0.67
4	002405	四维图新	74,679	1,970,778.81	0.63
5	000661	长春高新	9,815	1,796,145.00	0.58
6	002422	科伦药业	62,800	1,563,720.00	0.50
7	002271	东方雨虹	38,532	1,539,738.72	0.50
8	600525	长园集团	95,839	1,513,297.81	0.49
9	002001	新和成	39,600	1,507,176.00	0.48
10	600584	长电科技	69,294	1,478,041.02	0.48
11	000786	北新建材	65,138	1,465,605.00	0.47
12	000998	隆平高科	54,909	1,412,259.48	0.45
13	002340	格林美	194,442	1,398,037.98	0.45
14	300274	阳光电源	73,820	1,385,601.40	0.45
15	600521	华海药业	45,488	1,370,098.56	0.44
16	600438	通威股份	113,000	1,368,430.00	0.44
17	603019	中科曙光	32,800	1,319,872.00	0.42
18	600426	华鲁恒升	82,556	1,314,291.52	0.42
19	002049	紫光国芯	26,500	1,271,735.00	0.41
20	600315	上海家化	34,300	1,265,327.00	0.41
21	000039	中集集团	55,200	1,261,320.00	0.41
22	002092	中泰化学	93,700	1,247,147.00	0.40
23	600079	人福医药	69,000	1,230,960.00	0.40
24	300266	兴源环境	45,500	1,228,500.00	0.40
25	000050	深天马A	61,200	1,206,252.00	0.39
26	000830	鲁西化工	74,607	1,187,743.44	0.38
27	600298	安琪酵母	36,000	1,177,920.00	0.38
28	002583	海能达	63,600	1,177,236.00	0.38
29	600642	申能股份	198,800	1,164,968.00	0.37
30	600256	广汇能源	228,000	1,153,680.00	0.37
31	601168	西部矿业	138,800	1,138,160.00	0.37
32	002050	三花智控	61,750	1,132,495.00	0.36
33	002179	中航光电	28,757	1,132,450.66	0.36
34	000009	中国宝安	156,400	1,130,772.00	0.36
35	600291	西水股份	47,700	1,121,904.00	0.36
36	600392	盛和资源	58,927	1,119,613.00	0.36
37	000977	浪潮信息	56,300	1,119,244.00	0.36

38	002410	广联达	57,000	1,117,200.00	0.36
39	002384	东山精密	39,013	1,110,309.98	0.36
40	600004	白云机场	75,300	1,106,910.00	0.36
41	000418	小天鹅 A	16,034	1,087,906.90	0.35
42	600879	航天电子	138,592	1,086,561.28	0.35
43	000488	晨鸣纸业	64,797	1,080,165.99	0.35
44	600388	龙净环保	62,300	1,077,790.00	0.35
45	300156	神雾环保	44,500	1,075,120.00	0.35
46	002311	海大集团	45,860	1,073,124.00	0.35
47	002573	清新环境	46,900	1,066,037.00	0.34
48	601233	桐昆股份	47,400	1,066,026.00	0.34
49	002366	台海核电	40,300	1,065,935.00	0.34
50	300055	万邦达	50,400	1,059,912.00	0.34
51	000513	丽珠集团	15,907	1,057,020.15	0.34
52	002078	太阳纸业	113,226	1,050,737.28	0.34
53	300088	长信科技	133,852	1,048,061.16	0.34
54	600022	山东钢铁	478,110	1,023,155.40	0.33
55	600499	科达洁能	91,800	1,018,062.00	0.33
56	000690	宝新能源	126,751	1,014,008.00	0.33
57	603589	口子窖	21,800	1,003,890.00	0.32
58	600872	中炬高新	40,450	1,001,542.00	0.32
59	600600	青岛啤酒	25,300	995,049.00	0.32
60	601699	潞安环能	87,100	991,198.00	0.32
61	600811	东方集团	216,250	990,425.00	0.32
62	000887	中鼎股份	53,900	979,363.00	0.32
63	600875	东方电气	87,200	979,256.00	0.31
64	002019	亿帆医药	43,900	976,775.00	0.31
65	002176	江特电机	85,600	968,992.00	0.31
66	600056	中国医药	38,898	968,171.22	0.31
67	000656	金科股份	194,347	962,017.65	0.31
68	002407	多氟多	47,100	961,782.00	0.31
69	600885	宏发股份	23,200	959,784.00	0.31
70	600166	福田汽车	339,900	955,119.00	0.31
71	000930	中粮生化	70,888	945,645.92	0.30
72	000066	中国长城	128,621	937,647.09	0.30
73	600839	四川长虹	268,800	935,424.00	0.30
74	002517	恺英网络	41,800	928,378.00	0.30
75	600718	东软集团	63,300	927,978.00	0.30
76	600643	爱建集团	83,678	927,152.24	0.30

77	002038	双鹭药业	29,900	926,003.00	0.30
78	000997	新大陆	51,452	922,534.36	0.30
79	002439	启明星辰	39,200	915,320.00	0.29
80	600755	厦门国贸	90,502	914,070.20	0.29
81	600183	生益科技	52,910	913,226.60	0.29
82	002273	水晶光电	38,688	912,649.92	0.29
83	600418	江淮汽车	96,462	912,530.52	0.29
84	600325	华发股份	123,312	907,576.32	0.29
85	002244	滨江集团	113,224	900,130.80	0.29
86	600260	凯乐科技	30,908	899,731.88	0.29
87	600266	北京城建	68,400	898,776.00	0.29
88	600808	马钢股份	217,200	897,036.00	0.29
89	002359	北讯集团	39,600	892,980.00	0.29
90	000970	中科三环	62,000	891,560.00	0.29
91	600787	中储股份	80,024	880,264.00	0.28
92	000878	云南铜业	61,900	878,361.00	0.28
93	600138	中青旅	42,026	877,082.62	0.28
94	000581	威孚高科	36,500	876,000.00	0.28
95	002223	鱼跃医疗	43,826	858,989.60	0.28
96	600060	海信电器	57,100	857,642.00	0.28
97	600673	东阳光科	125,800	849,150.00	0.27
98	002670	国盛金控	43,640	848,798.00	0.27
99	300383	光环新网	63,800	841,522.00	0.27
100	600460	士兰微	54,442	840,040.06	0.27
101	002195	二三四五	143,700	839,208.00	0.27
102	002285	世联行	74,403	829,593.45	0.27
103	000566	海南海药	64,018	825,192.02	0.27
104	000825	太钢不锈	165,800	822,368.00	0.26
105	002408	齐翔腾达	64,563	818,658.84	0.26
106	600160	巨化股份	76,900	817,447.00	0.26
107	600094	大名城	116,000	810,840.00	0.26
108	300197	铁汉生态	66,400	806,760.00	0.26
109	300146	汤臣倍健	53,500	803,570.00	0.26
110	600435	北方导航	65,020	801,696.60	0.26
111	000960	锡业股份	60,700	801,240.00	0.26
112	300182	捷成股份	93,000	800,730.00	0.26
113	002640	跨境通	41,800	800,052.00	0.26
114	000547	航天发展	73,600	797,088.00	0.26
115	300115	长盈精密	39,480	792,363.60	0.25

116	600884	杉杉股份	40,872	792,099.36	0.25
117	600978	宜华生活	86,300	788,782.00	0.25
118	600655	豫园股份	73,272	786,941.28	0.25
119	600614	鹏起科技	77,032	782,645.12	0.25
120	600062	华润双鹤	31,600	782,100.00	0.25
121	601000	唐山港	165,947	781,610.37	0.25
122	600143	金发科技	118,600	779,202.00	0.25
123	000703	恒逸石化	36,100	778,677.00	0.25
124	000981	银亿股份	88,000	777,040.00	0.25
125	600282	南钢股份	160,500	776,820.00	0.25
126	000807	云铝股份	75,900	776,457.00	0.25
127	000999	华润三九	28,500	775,200.00	0.25
128	600179	安通控股	30,900	764,775.00	0.25
129	600503	华丽家族	116,600	763,730.00	0.25
130	002183	怡亚通	108,000	761,400.00	0.24
131	600970	中材国际	76,650	758,068.50	0.24
132	000778	新兴铸管	145,200	757,944.00	0.24
133	002013	中航机电	70,004	755,343.16	0.24
134	601231	环旭电子	47,500	749,075.00	0.24
135	002051	中工国际	40,540	747,152.20	0.24
136	002589	瑞康医药	54,770	736,656.50	0.24
137	002048	宁波华翔	30,911	735,681.80	0.24
138	002221	东华能源	60,004	732,648.84	0.24
139	002512	达华智能	40,500	731,835.00	0.24
140	000988	华工科技	43,959	728,840.22	0.23
141	002127	南极电商	59,600	726,524.00	0.23
142	000732	泰禾集团	36,200	724,724.00	0.23
143	600409	三友化工	75,094	720,151.46	0.23
144	600125	铁龙物流	66,487	719,389.34	0.23
145	000979	中弘股份	370,166	718,122.04	0.23
146	600240	华业资本	82,981	711,976.98	0.23
147	000598	兴蓉环境	130,400	708,072.00	0.23
148	600161	天坛生物	24,527	706,132.33	0.23
149	002373	千方科技	48,200	706,130.00	0.23
150	002268	卫士通	30,520	702,570.40	0.23
151	002745	木林森	15,400	700,700.00	0.23
152	002004	华邦健康	103,710	697,968.30	0.22
153	002491	通鼎互联	55,100	694,260.00	0.22
154	000729	燕京啤酒	102,600	691,524.00	0.22

155	002030	达安基因	36,898	685,564.84	0.22
156	000401	冀东水泥	49,617	684,218.43	0.22
157	000006	深振业 A	69,319	682,792.15	0.22
158	000078	海王生物	115,550	681,745.00	0.22
159	002400	省广股份	126,888	676,313.04	0.22
160	600597	光明乳业	44,600	675,690.00	0.22
161	600410	华胜天成	64,223	675,625.96	0.22
162	600566	济川药业	17,700	675,255.00	0.22
163	600635	大众公用	140,800	673,024.00	0.22
164	002281	光迅科技	22,869	672,348.60	0.22
165	300166	东方国信	53,518	671,650.90	0.22
166	600346	恒力股份	54,300	669,519.00	0.22
167	002354	天神娱乐	38,980	666,558.00	0.21
168	000685	中山公用	64,444	660,551.00	0.21
169	002440	闰土股份	33,500	659,615.00	0.21
170	600037	歌华有线	50,700	658,593.00	0.21
171	002152	广电运通	88,400	657,696.00	0.21
172	000028	国药一致	10,838	652,989.50	0.21
173	000592	平潭发展	113,500	652,625.00	0.21
174	600664	哈药股份	112,270	652,288.70	0.21
175	600307	酒钢宏兴	227,900	651,794.00	0.21
176	600122	宏图高科	67,211	651,274.59	0.21
177	000012	南玻 A	76,885	649,678.25	0.21
178	000089	深圳机场	74,600	649,020.00	0.21
179	600572	康恩贝	91,399	646,190.93	0.21
180	600348	阳泉煤业	87,500	645,750.00	0.21
181	600500	中化国际	75,800	641,268.00	0.21
182	600380	健康元	57,268	640,828.92	0.21
183	002056	横店东磁	59,864	640,544.80	0.21
184	600717	天津港	61,000	639,890.00	0.21
185	600645	中源协和	22,530	639,852.00	0.21
186	000031	中粮地产	79,957	639,656.00	0.21
187	000975	银泰资源	47,860	639,409.60	0.21
188	601200	上海环境	25,600	638,464.00	0.21
189	600171	上海贝岭	39,202	637,816.54	0.21
190	600267	海正药业	42,100	637,394.00	0.21
191	002131	利欧股份	245,073	637,189.80	0.20
192	002431	棕榈股份	75,750	636,300.00	0.20
193	601880	大连港	225,199	628,305.21	0.20

194	600863	内蒙华电	211,400	627,858.00	0.20
195	002506	协鑫集成	146,900	627,263.00	0.20
196	600881	亚泰集团	118,210	624,148.80	0.20
197	300058	蓝色光标	112,800	622,656.00	0.20
198	300324	旋极信息	42,500	621,775.00	0.20
199	600511	国药股份	22,286	619,550.80	0.20
200	000636	风华高科	52,143	619,458.84	0.20
201	002665	首航节能	92,435	615,617.10	0.20
202	002028	思源电气	38,720	613,712.00	0.20
203	300002	神州泰岳	99,900	611,388.00	0.20
204	600026	中远海能	99,570	609,368.40	0.20
205	002477	雏鹰农牧	136,877	607,733.88	0.20
206	002280	联络互动	79,200	606,672.00	0.20
207	002191	劲嘉股份	65,274	603,784.50	0.19
208	600416	湘电股份	48,232	602,417.68	0.19
209	000926	福星股份	55,290	602,108.10	0.19
210	600120	浙江东方	24,434	601,320.74	0.19
211	002249	大洋电机	86,257	601,211.29	0.19
212	600737	中粮糖业	74,700	593,865.00	0.19
213	600967	内蒙一机	49,201	592,872.05	0.19
214	600936	广西广电	85,100	583,786.00	0.19
215	600466	蓝光发展	62,100	580,635.00	0.19
216	000400	许继电气	43,994	580,280.86	0.19
217	600633	浙数文化	37,900	576,080.00	0.19
218	000939	凯迪生态	115,408	575,885.92	0.19
219	600835	上海机电	23,494	575,603.00	0.19
220	002709	天赐材料	12,500	574,875.00	0.18
221	002635	安洁科技	21,950	572,675.50	0.18
222	600575	皖江物流	141,400	572,670.00	0.18
223	600751	天海投资	93,600	571,896.00	0.18
224	000612	焦作万方	60,781	571,341.40	0.18
225	300159	新研股份	54,800	569,920.00	0.18
226	600216	浙江医药	42,200	567,168.00	0.18
227	002505	大康农业	199,670	567,062.80	0.18
228	000667	美好置业	186,300	566,352.00	0.18
229	603369	今世缘	36,500	566,115.00	0.18
230	300244	迪安诊断	23,800	562,156.00	0.18
231	300026	红日药业	131,502	560,198.52	0.18
232	600064	南京高科	39,361	558,532.59	0.18

233	600598	北大荒	51,800	558,404.00	0.18
234	300133	华策影视	51,500	558,260.00	0.18
235	000860	顺鑫农业	29,026	557,589.46	0.18
236	300199	翰宇药业	34,100	555,148.00	0.18
237	600151	航天机电	73,055	554,487.45	0.18
238	300113	顺网科技	30,300	554,187.00	0.18
239	000712	锦龙股份	32,600	553,548.00	0.18
240	002371	北方华创	13,352	553,306.88	0.18
241	000758	中色股份	86,000	552,980.00	0.18
242	600478	科力远	74,900	552,762.00	0.18
243	000596	古井贡酒	8,354	548,607.18	0.18
244	002353	杰瑞股份	41,800	548,416.00	0.18
245	300253	卫宁健康	81,430	546,395.30	0.18
246	002603	以岭药业	35,000	544,600.00	0.18
247	300287	飞利信	73,100	541,671.00	0.17
248	002444	巨星科技	39,111	540,905.13	0.17
249	603766	隆鑫通用	76,948	540,174.96	0.17
250	300116	坚瑞沃能	70,800	539,496.00	0.17
251	600823	世茂股份	109,200	539,448.00	0.17
252	002701	奥瑞金	85,720	535,750.00	0.17
253	600039	四川路桥	131,439	534,956.73	0.17
254	002807	江阴银行	64,300	532,404.00	0.17
255	600908	无锡银行	67,300	529,651.00	0.17
256	002128	露天煤业	47,631	527,751.48	0.17
257	000027	深圳能源	86,600	524,796.00	0.17
258	000806	银河生物	48,700	524,012.00	0.17
259	002390	信邦制药	62,000	523,900.00	0.17
260	600086	东方金钰	49,149	523,436.85	0.17
261	600017	日照港	134,280	521,006.40	0.17
262	000021	深科技	53,530	520,846.90	0.17
263	002299	圣农发展	36,100	519,840.00	0.17
264	300376	易事特	68,400	517,788.00	0.17
265	002147	新光圆成	39,960	517,082.40	0.17
266	002002	鸿达兴业	75,277	514,894.68	0.17
267	603077	和邦生物	257,143	514,286.00	0.17
268	002155	湖南黄金	52,500	509,250.00	0.16
269	600158	中体产业	49,101	504,758.28	0.16
270	600648	外高桥	27,200	503,200.00	0.16
271	600801	华新水泥	35,365	499,707.45	0.16

272	002266	浙富控股	115,245	499,010.85	0.16
273	600563	法拉电子	9,819	498,903.39	0.16
274	000681	视觉中国	25,500	497,250.00	0.16
275	300001	特锐德	36,300	496,947.00	0.16
276	600366	宁波韵升	28,345	496,604.40	0.16
277	600848	上海临港	22,100	492,830.00	0.16
278	600312	平高电气	49,300	492,507.00	0.16
279	601678	滨化股份	60,539	491,576.68	0.16
280	000528	柳 工	57,300	488,769.00	0.16
281	002672	东江环保	30,045	488,231.25	0.16
282	002308	威创股份	39,893	486,694.60	0.16
283	002032	苏 泊 尔	12,000	484,560.00	0.16
284	600317	营口港	141,300	479,007.00	0.15
285	000563	陕国投 A	112,500	478,125.00	0.15
286	000718	苏宁环球	110,400	478,032.00	0.15
287	002489	浙江永强	79,194	475,955.94	0.15
288	000762	西藏矿业	30,296	475,647.20	0.15
289	000156	华数传媒	41,700	475,380.00	0.15
290	600594	益佰制药	46,100	471,142.00	0.15
291	000727	华东科技	197,800	470,764.00	0.15
292	002018	华信国际	66,300	468,741.00	0.15
293	600393	粤泰股份	73,800	467,892.00	0.15
294	600108	亚盛集团	113,400	466,074.00	0.15
295	000877	天山股份	44,795	465,868.00	0.15
296	600651	飞乐音响	50,500	462,075.00	0.15
297	002368	太极股份	18,180	461,226.60	0.15
298	600859	王府井	22,564	460,305.60	0.15
299	300134	大富科技	27,900	458,955.00	0.15
300	002428	云南锗业	37,996	458,611.72	0.15
301	600187	国中水务	97,200	454,896.00	0.15
302	002463	沪电股份	85,299	454,643.67	0.15
303	600545	卓郎智能	41,395	454,517.10	0.15
304	002251	步 步 高	25,162	454,174.10	0.15
305	600270	外运发展	26,260	453,772.80	0.15
306	600611	大众交通	91,037	453,364.26	0.15
307	600169	太原重工	130,600	451,876.00	0.15
308	601928	凤凰传媒	55,600	450,916.00	0.15
309	600993	马应龙	21,947	449,474.56	0.14
310	000937	冀中能源	77,200	449,304.00	0.14

311	600729	重庆百货	17,800	446,068.00	0.14
312	000501	鄂武商 A	27,929	445,746.84	0.14
313	002437	誉衡药业	64,675	445,610.75	0.14
314	600316	洪都航空	31,300	443,208.00	0.14
315	002122	天马股份	51,918	440,783.82	0.14
316	002375	亚厦股份	58,500	439,920.00	0.14
317	000090	天健集团	43,543	437,171.72	0.14
318	603000	人民网	40,200	435,366.00	0.14
319	002663	普邦股份	78,415	435,203.25	0.14
320	000587	金洲慈航	61,834	432,838.00	0.14
321	600259	广晟有色	11,000	432,190.00	0.14
322	600770	综艺股份	56,800	431,680.00	0.14
323	600141	兴发集团	25,500	430,950.00	0.14
324	002250	联化科技	40,474	429,833.88	0.14
325	600694	大商股份	12,700	428,371.00	0.14
326	601717	郑煤机	65,010	427,765.80	0.14
327	600557	康缘药业	31,434	423,730.32	0.14
328	002277	友阿股份	72,166	423,614.42	0.14
329	600565	迪马股份	105,800	423,200.00	0.14
330	600098	广州发展	59,500	420,665.00	0.14
331	600582	天地科技	90,400	420,360.00	0.14
332	002064	华峰氨纶	85,400	418,460.00	0.13
333	603188	亚邦股份	25,200	418,068.00	0.13
334	002106	莱宝高科	41,000	416,970.00	0.13
335	002358	森源电气	28,000	416,080.00	0.13
336	002233	塔牌集团	34,681	413,050.71	0.13
337	002434	万里扬	39,300	412,650.00	0.13
338	600874	创业环保	31,679	412,143.79	0.13
339	601311	骆驼股份	30,876	409,107.00	0.13
340	300297	蓝盾股份	42,800	408,312.00	0.13
341	600765	中航重机	33,889	407,345.78	0.13
342	002022	科华生物	29,800	405,578.00	0.13
343	000848	承德露露	42,659	403,554.14	0.13
344	000600	建投能源	52,200	402,462.00	0.13
345	000519	中兵红箭	40,727	401,160.95	0.13
346	000426	兴业矿业	40,688	399,963.04	0.13
347	000969	安泰科技	44,784	398,129.76	0.13
348	601016	节能风电	121,000	398,090.00	0.13
349	600587	新华医疗	23,696	397,855.84	0.13

350	000829	天音控股	41,868	397,746.00	0.13
351	600338	西藏珠峰	9,500	395,675.00	0.13
352	002123	梦网集团	38,100	394,335.00	0.13
353	601689	拓普集团	15,900	393,366.00	0.13
354	000541	佛山照明	42,672	392,582.40	0.13
355	002657	中科金财	17,200	392,504.00	0.13
356	000543	皖能电力	78,141	392,267.82	0.13
357	603883	老百姓	6,200	390,538.00	0.13
358	002276	万马股份	45,252	390,072.24	0.13
359	600155	宝硕股份	38,000	388,740.00	0.13
360	600073	上海梅林	47,800	388,136.00	0.12
361	000766	通化金马	28,500	387,600.00	0.12
362	600277	亿利洁能	59,800	385,112.00	0.12
363	600687	刚泰控股	32,500	383,825.00	0.12
364	000572	海马汽车	83,800	383,804.00	0.12
365	000158	常山北明	48,110	381,993.40	0.12
366	002073	软控股份	47,700	381,600.00	0.12
367	002332	仙琚制药	46,695	381,498.15	0.12
368	600971	恒源煤电	36,380	379,443.40	0.12
369	002242	九阳股份	22,349	379,262.53	0.12
370	000061	农产品	49,400	378,404.00	0.12
371	002503	搜于特	68,198	377,816.92	0.12
372	600754	锦江股份	11,700	377,793.00	0.12
373	002690	美亚光电	19,600	377,692.00	0.12
374	600058	五矿发展	31,200	376,896.00	0.12
375	002317	众生药业	29,673	376,253.64	0.12
376	600580	卧龙电气	46,877	375,484.77	0.12
377	002261	拓维信息	48,497	375,366.78	0.12
378	600284	浦东建设	40,353	375,282.90	0.12
379	002063	远光软件	35,122	373,346.86	0.12
380	600300	维维股份	85,180	372,236.60	0.12
381	603816	顾家家居	6,300	371,511.00	0.12
382	600773	西藏城投	31,804	371,470.72	0.12
383	000062	深圳华强	15,800	371,142.00	0.12
384	600869	智慧能源	64,572	370,643.28	0.12
385	601002	晋亿实业	34,477	369,938.21	0.12
386	601001	大同煤业	60,900	368,445.00	0.12
387	000680	山推股份	72,204	367,518.36	0.12
388	600422	昆药集团	40,164	367,500.60	0.12

389	300273	和佳股份	40,190	364,121.40	0.12
390	603377	东方时尚	9,100	363,818.00	0.12
391	002642	荣之联	27,750	363,802.50	0.12
392	600578	京能电力	98,200	363,340.00	0.12
393	000669	金鸿控股	24,770	362,880.50	0.12
394	002254	泰和新材	31,159	362,690.76	0.12
395	002681	奋达科技	32,320	360,691.20	0.12
396	600289	ST 信通	36,246	360,285.24	0.12
397	603515	欧普照明	8,400	359,856.00	0.12
398	002482	广田集团	44,765	359,015.30	0.12
399	002699	美盛文化	19,800	358,578.00	0.12
400	300202	聚龙股份	19,900	357,205.00	0.11
401	600536	中国软件	21,567	356,933.85	0.11
402	300010	立思辰	31,900	356,323.00	0.11
403	002345	潮宏基	32,980	354,535.00	0.11
404	002544	杰赛科技	22,500	353,925.00	0.11
405	000049	德赛电池	8,937	353,815.83	0.11
406	600458	时代新材	34,953	351,976.71	0.11
407	600759	洲际油气	82,413	351,079.38	0.11
408	600428	中远海特	62,543	350,866.23	0.11
409	300257	开山股份	24,973	349,622.00	0.11
410	600623	华谊集团	40,900	348,877.00	0.11
411	300039	上海凯宝	54,613	347,338.68	0.11
412	601777	力帆股份	47,529	345,060.54	0.11
413	600006	东风汽车	58,200	340,470.00	0.11
414	002479	富春环保	34,700	336,937.00	0.11
415	600335	国机汽车	29,951	336,649.24	0.11
416	002005	德豪润达	77,100	336,156.00	0.11
417	300291	华录百纳	29,600	335,960.00	0.11
418	600750	江中药业	13,116	334,195.68	0.11
419	002707	众信旅游	30,500	332,145.00	0.11
420	000652	泰达股份	75,165	331,477.65	0.11
421	600059	古越龙山	35,300	331,467.00	0.11
422	000777	中核科技	22,245	331,450.50	0.11
423	600395	盘江股份	48,200	331,134.00	0.11
424	300032	金龙机电	23,800	330,582.00	0.11
425	002041	登海种业	25,640	329,474.00	0.11
426	600280	中央商场	41,841	329,288.67	0.11
427	603658	安图生物	6,100	324,642.00	0.10

428	002011	盾安环境	40,092	322,339.68	0.10
429	600517	置信电气	49,303	318,990.41	0.10
430	001696	宗申动力	50,400	318,528.00	0.10
431	000897	津滨发展	94,199	318,392.62	0.10
432	600639	浦东金桥	18,612	315,473.40	0.10
433	000990	诚志股份	18,200	314,132.00	0.10
434	603328	依顿电子	21,800	312,830.00	0.10
435	600657	信达地产	55,510	309,745.80	0.10
436	600195	中牧股份	15,676	308,973.96	0.10
437	603198	迎驾贡酒	17,500	307,825.00	0.10
438	600329	中新药业	20,655	307,139.85	0.10
439	600757	长江传媒	44,169	306,974.55	0.10
440	603556	海兴电力	8,400	305,760.00	0.10
441	300147	香雪制药	33,560	301,033.20	0.10
442	002269	美邦服饰	91,400	300,706.00	0.10
443	002344	海宁皮城	37,800	299,754.00	0.10
444	603444	吉比特	1,600	294,288.00	0.09
445	600862	中航高科	30,400	294,272.00	0.09
446	600880	博瑞传播	55,716	293,623.32	0.09
447	600894	广日股份	31,343	293,057.05	0.09
448	000552	靖远煤电	83,220	292,934.40	0.09
449	002342	巨力索具	48,871	292,737.29	0.09
450	600628	新世界	28,267	287,475.39	0.09
451	603355	莱克电气	5,800	285,824.00	0.09
452	002588	史丹利	42,052	281,327.88	0.09
453	002118	紫鑫药业	37,320	280,646.40	0.09
454	000099	中信海直	30,890	278,627.80	0.09
455	002093	国脉科技	29,291	277,971.59	0.09
456	300043	星辉娱乐	45,300	277,236.00	0.09
457	000662	天夏智慧	18,400	273,608.00	0.09
458	600184	光电股份	14,780	270,769.60	0.09
459	002190	成飞集成	12,500	270,500.00	0.09
460	603888	新华网	11,350	268,427.50	0.09
461	601127	小康股份	13,200	265,452.00	0.09
462	000816	智慧农业	82,650	265,306.50	0.09
463	603868	飞科电器	3,500	265,125.00	0.09
464	002392	北京利尔	52,002	262,090.08	0.08
465	002325	洪涛股份	54,350	259,249.50	0.08
466	600748	上实发展	40,246	257,976.86	0.08

467	600292	远达环保	28,348	253,714.60	0.08
468	600640	号百控股	17,328	253,335.36	0.08
469	600776	东方通信	34,681	250,743.63	0.08
470	600743	华远地产	68,325	250,069.50	0.08
471	600481	双良节能	59,022	236,678.22	0.08
472	601020	华钰矿业	11,500	235,980.00	0.08
473	002168	深圳惠程	16,920	232,819.20	0.07
474	002414	高德红外	13,592	228,481.52	0.07
475	600053	九鼎投资	9,500	226,955.00	0.07
476	600996	贵广网络	22,800	225,720.00	0.07
477	002551	尚荣医疗	24,060	220,389.60	0.07
478	002416	爱施德	22,600	214,022.00	0.07
479	603568	伟明环保	10,050	211,552.50	0.07
480	000761	本钢板材	39,800	206,960.00	0.07
481	603225	新凤鸣	5,700	204,060.00	0.07
482	600826	兰生股份	15,282	201,263.94	0.06
483	603806	福斯特	5,900	201,190.00	0.06
484	000536	华映科技	40,300	199,082.00	0.06
485	600126	杭钢股份	28,300	194,421.00	0.06
486	603228	景旺电子	3,600	193,572.00	0.06
487	000987	越秀金控	19,400	191,090.00	0.06
488	603169	兰石重装	22,400	187,936.00	0.06
489	600618	氯碱化工	16,417	177,796.11	0.06
490	603001	奥康国际	11,696	169,241.12	0.05
491	603528	多伦科技	18,100	159,823.00	0.05
492	601811	新华文轩	11,500	154,445.00	0.05
493	000025	特力A	3,800	146,338.00	0.05
494	600917	重庆燃气	12,500	139,250.00	0.04
495	601969	海南矿业	15,700	138,945.00	0.04
496	601128	常熟银行	17,800	126,914.00	0.04
497	002815	崇达技术	3,900	123,084.00	0.04
498	603877	太平鸟	4,200	113,862.00	0.04
499	600939	重庆建工	14,500	107,590.00	0.03
500	603569	长久物流	4,400	106,436.00	0.03
501	603025	大豪科技	3,600	105,912.00	0.03
502	002818	富森美	3,200	96,992.00	0.03
503	000693	*ST 华泽	6,242	78,025.00	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.09
2	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.06
3	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.02
4	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
5	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
6	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
7	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
8	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
9	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
10	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
11	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
12	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
13	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
14	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
15	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	600642	申能股份	1,300,303.01	1.58
2	002049	紫光国芯	1,291,932.00	1.57
3	600438	通威股份	1,208,349.00	1.47
4	000009	中国宝安	1,153,301.00	1.40
5	600256	广汇能源	1,139,134.00	1.38
6	000778	新兴铸管	1,079,570.98	1.31
7	002583	海能达	1,045,675.00	1.27
8	600839	四川长虹	1,044,280.00	1.27
9	600004	白云机场	1,043,511.00	1.27
10	000977	浪潮信息	1,040,903.00	1.26
11	000050	深天马 A	1,035,449.00	1.26

12	603799	华友钴业	1,022,741.00	1.24
13	600885	宏发股份	1,005,082.00	1.22
14	000039	中集集团	983,985.68	1.19
15	600718	东软集团	954,257.00	1.16
16	300266	兴源环境	926,018.00	1.12
17	600875	东方电气	920,964.00	1.12
18	300058	蓝色光标	919,800.43	1.12
19	601168	西部矿业	918,704.00	1.11
20	000887	中鼎股份	911,449.00	1.11

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	300136	信维通信	3,219,001.00	3.91
2	601012	隆基股份	3,084,399.00	3.74
3	600487	亨通光电	2,844,566.27	3.45
4	002460	赣锋锂业	2,789,929.00	3.38
5	603799	华友钴业	1,790,978.00	2.17
6	002508	老板电器	1,710,235.60	2.07
7	600522	中天科技	1,680,622.00	2.04
8	600219	南山铝业	1,551,752.88	1.88
9	002572	索菲亚	1,527,565.00	1.85
10	600682	南京新百	1,436,822.00	1.74
11	600436	片仔癀	1,351,340.00	1.64
12	300296	利亚德	1,334,741.92	1.62
13	002217	合力泰	1,132,883.00	1.37
14	300122	智飞生物	1,082,341.00	1.31
15	600699	均胜电子	1,076,217.36	1.31
16	600809	山西汾酒	1,029,556.00	1.25
17	002602	世纪华通	977,820.00	1.19
18	000959	首钢股份	860,032.00	1.04
19	600528	中铁工业	831,245.30	1.01
20	600497	驰宏锌锗	790,363.00	0.96

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	102,552,537.26
卖出股票收入（成交）总额	90,231,629.41

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。

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

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。

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	9,471.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,264.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,735.97

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

8.12.5.1 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	600525	长园集团	1,513,297.81	0.49	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	300730	科创信息	34,112.55	0.01	重大事项停牌
---	--------	------	-----------	------	--------

§ 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

9.1.1 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
239	780,639.98	185,445,368.00	99.40%	1,127,588.00	0.60%

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
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	182,000,000.00	97.55%

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 比例
1	中国银行股份有限公司—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	182,000,000.00	97.55%
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000.00	1.07%
3	福建道冲投资管理有限公司—道冲 补天 1 号私募基金	1,409,934.00	0.76%
4	杜月仙	100,000.00	0.05%
5	沈健美	78,000.00	0.04%
6	张舒云	77,321.00	0.04%
7	邱雨	71,800.00	0.04%
8	郭志峰	59,000.00	0.03%
9	高伟煊	49,000.00	0.03%
10	马宝茹	44,900.00	0.02%
11	孙伟	31,600.00	0.02%

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（2013 年 12 月 26 日）基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	50,572,956.00
本报告期基金总申购份额	146,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	186,572,956.00

§ 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：

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 4 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 60,000.00 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	
中国银河证券股份有限公司		196,901,934.68	51.60%	90,245.41	51.60%	-
长城证券股份有限公司		290,901,937.79	48.40%	84,657.05	48.40%	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 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、本基金本期交易单元未发生变更。

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
中国银河证 券股份有限 公司	168,044.61	100.00%	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源西部证券有限公司						
中信建投证券股份有限公司						
海通证券股份有限公司						
长江证券股份有限公司						
东兴证券股份有限公司						
平安证券股份有限公司						
东方证券股份有限公司						
广发证券股份有限公司						
浙商证券股份有限公司						
东吴证券股份有限公司						
招商证券股份有限公司						
华泰证券股份有限公司						

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 500 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	景顺长城中证 500 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 2 月 9 日
4	景顺长城中证 500 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 2 月 9 日
5	景顺长城中证 500 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	2017 年 3 月 29 日

	摘要	金管理人网站	
6	景顺长城中证 500 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
7	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
8	景顺长城中证 500 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
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
10	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 7 月 8 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳前海微众银行股份有限公司认购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 7 月 19 日
12	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 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 7 月 20 日
13	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 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 8 月 10 日
14	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 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 8 月 10 日
15	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 8 月 26 日
16	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 8 月 26 日
17	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 3 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 10 月 25 日
18	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 10 月 25 日
19	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 10 月 27 日

20	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 10 月 31 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于子公司景顺长城资产管理(深圳)有限公司增加注册资本及修改《公司章程》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 11 月 30 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海好买基金销售有限公司开通基金转换业务并开展转换费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 6 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金首次申购最低金额、定期定额投资最低金额和最低持有份额数额限制的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 7 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 21 日
25	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 12 月 21 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 22 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务形式的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 23 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 26 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 29 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下产品执行增值税政策的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2017 年 12 月 30 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20170101—20171231	46,000,000.00	146,000,000.00	10,000,000.00	182,000,000.00	97.55%

产品特有风险

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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

2018 年 3 月 28 日