

景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 其他指标..... | 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §5 托管人报告 | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 17 |
| 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..... | 17 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 17 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 18 |
| 6.1 资产负债表..... | 18 |
| 6.2 利润表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 20 |
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 44 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 44 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 45 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 49 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 50 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 50 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 51 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 51 |
| 10.8 其他重大事件..... | 53 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58 |

| | |
|--|-----------|
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 58 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 58 |
| §12 备查文件目录..... | 59 |
| 12.1 备查文件目录..... | 59 |
| 12.2 存放地点..... | 59 |
| 12.3 查阅方式..... | 59 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城环保优势股票 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 001975 |
| 交易代码 | 001975 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 3 月 15 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 665,383,712.96 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金依托景顺长城研究团队的研究成果，持续深度挖掘具有环保优势的上市公司，分享其在中国经济增长的大背景下的绿色、高效可持续增长，以实现基金资产的长期资本增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略：本基金通过定性与定量相结合的积极投资策略，自下而上地精选价值被低估并且具有良好基本面的具备环保优势的股票构建投资组合。</p> <p>（1）环保优势企业的界定</p> <p>随着经济社会的发展，人类社会与环境的协调发展，生态环境的保护和建设日益重要。本基金将充分挖掘经济社会发展中具备 1、环保产业链优势；2、绿色经济优势；3、效率社会优势；4、可持续发展优势的四大环保优势企业的主题投资机会，通过投资以上主题企业，推动经济社会发展与环境保护矛盾得到有效化解，推动人类社会与自然环境和谐共存。</p> <p>（2）个股投资策略</p> <p>按照上述“环保优势企业的界定”中，本基金将采取“自下而上”的方式，依靠定量与定性相结合的方法精选个股，充分发挥基金管理人的研究优势，利用基金</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出具有竞争优势的上市公司股票进行投资。</p> <p>3、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、中小企业私募债投资策略：对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证环保产业指数收益率*40% + 沪深 300 指数收益率*40% + 中证全债指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于证券投资基金中风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|------------------------------|-----------------------|
| 名称 | | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-66275853 |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100033 |
| 法定代表人 | | 杨光裕 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfm.com |

| | |
|-------------|------------|
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |
|-------------|------------|

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,014,335.55 |
| 本期利润 | -93,608,406.23 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1828 |
| 本期加权平均净值利润率 | -11.33% |
| 本期基金份额净值增长率 | -6.93% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 281,487,820.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4230 |
| 期末基金资产净值 | 983,337,391.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.478 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2018年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 47.80% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

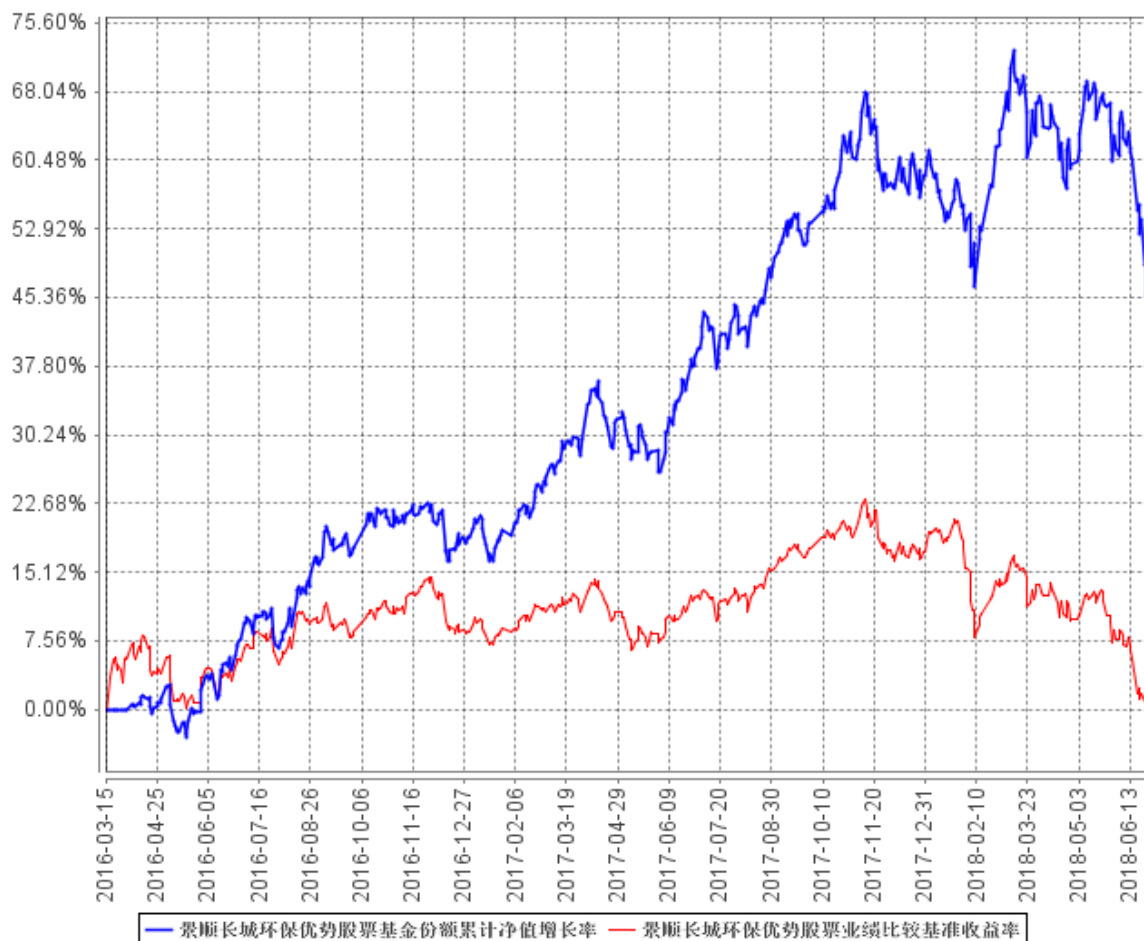
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -9.44% | 1.53% | -7.24% | 1.07% | -2.20% | 0.46% |
| 过去三个月 | -11.34% | 1.31% | -11.32% | 0.89% | -0.02% | 0.42% |
| 过去六个月 | -6.93% | 1.36% | -14.06% | 0.91% | 7.13% | 0.45% |
| 过去一年 | 6.48% | 1.16% | -10.29% | 0.77% | 16.77% | 0.39% |
| 自基金合同 | 47.80% | 0.99% | 0.81% | 0.75% | 46.99% | 0.24% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

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



注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%。权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将基金资产的 5%-20% 投资于现金和债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2016 年 3 月 15 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截至2018年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理70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TMT150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、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金。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、股票投资部投资副总监 | 2016 年 3 月 15 日 | - | 8 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、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 65 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，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。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易和反向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动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

上半年，沪深 300 下跌 12.9%。由于中美贸易战、去杠杆带来的毁约事件激增、地产周期下行等多重利空叠加，A 股在本季度急剧地下跌。除了医药、餐饮旅游和食品饮料等少数消费股依旧保持强势之外，其他行业几乎全面沦陷。现在的市场处于一片的悲观情绪中，但是，我们并没有那么悲观。

尽管市场风格不断切换，我们依旧致力于战胜市场，体现专业投资机构的能力。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仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年上半年，本基金份额净值增长率为-6.93%，业绩比较基准收益率为-14.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

时代在变迁，我们希望沿着产业趋势主轴去投资，希望以不变的产业趋势去应对变化的市场。实际上，我们并不知道市场是如何演变，但是，我们相信寻找符合产业趋势的优势企业的投资路径能让我们在逆水行舟之时不至于太差，在顺水行舟之时能扬帆乘风起。

现在的指数回到了股灾的起点，估值比股灾的起点更低。当前的估值水平已经处于历史最低水平，中证 1000 基本与 08 年最底部估值是一样的。市场一片低迷，大多数人都用最悲观的视觉看待市场，而我们看到的却是希望。的确，我们不知道明天或者下周是涨还是跌，但是，如果把周期拉到 1-3 年，我们预测目前市场处于投资胜率较高区域。

今年以来，去杠杆带来违约率急剧提升，让市场过度担心去杠杆会带来系统性风险。实际上，去杠杆过程中出现局部风险是很正常的，并且也会是常态事件。过去，过小的信用利差抬升了市场的无风险利率，去杠杆带来的信用利差提升将会有效降低市场的无风险利率。市场的无风险利率下降一定是有利于新增资金进入资本市场的。实际上，去杠杆对 A 股资金面的影响也是微弱的，更多是心理层面上的影响。然而，理财产品打破刚兑以及去杠杆带来的影响都将影响理财产品的供给，这必然会导致更多的社会资金从理财产品逐步流入权益市场。去杠杆对 A 股是短空长多的事情，根本没必要过分担心。

棚改货币化推动的地产销售超预期增长的确是不可持续，宏观经济也毫无疑问会逐步走向增速下降通道。但是，宏观经济强弱不代表股市表现的强弱。过去十年，尽管经济增长很多，但是，上证指数几乎没有上涨。上证表现不佳很大程度是受到经济结构转型以及制造业投资回报率下行十年所影响。另外，上证的企业主要是由传统的资金消耗型企业构成，毕竟股市反应的是企业未来的现金流创造能力，这也影响了上证指数的表现。过去两年，供给侧改革逆转了传统行业的盈利水平，去杠杆消灭了资金二道贩子，降低了社会实际的资金成本，这些都是有利于企业创造现金流的。

中美贸易战将会是一场持久战，这也是市场的共识。两国关系未来可能是“W”型走势，期间可能不断伴随着两国政治经济高层的互相试探、利益博弈和沟通谈判。这也是中国崛起过程中不得不面对的问题。当然，如果谈判能达成停战协议固然更好，但是，达不成也无大碍。中美未来几年都是在竞争中合作，合作中竞争，这种矛盾的主基调不会改变，也很难改变中国崛起的趋势。中国人的拼搏精神不是其他国家所能比拟，中国人在快速学习，在快速累积自身优势。人口结构

是不利因素，但是，中国人口基数足够大，叠加中国人异常的勤奋，影响是相对微弱的。尽管中国的人口红利在衰退，但是，工程师红利依然在发挥作用。因此，我们坚信中国的科技创新依旧会迸发出强大的动能。

我们始终坚持投资于符合趋势的真正的高成长个股，通过这样的锚来抵抗住我们内心的恐惧，希望在变化的市场依赖于企业价值做出正确的判断。投资需要乐观的态度，我们只能寄望于大时代的发展，迎接并伴随时代的变化，希望通过时刻紧随时代的变化实现持有人的资产增值。

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债金融估值中心有限公司、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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 125,346,725.45 | 52,879,666.09 |
| 结算备付金 | | 2,076,253.34 | 1,337,658.24 |
| 存出保证金 | | 275,611.06 | 146,811.77 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 866,261,100.11 | 530,380,382.28 |
| 其中：股票投资 | | 866,261,100.11 | 530,380,382.28 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,248,802.11 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 27,874.39 | 11,871.27 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 3,982,419.50 | 2,416,157.47 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 999,218,785.96 | 587,172,547.12 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 9,067,338.78 |
| 应付赎回款 | | 13,345,000.12 | 6,059,419.84 |
| 应付管理人报酬 | | 1,298,940.75 | 742,703.71 |
| 应付托管费 | | 216,490.14 | 123,783.96 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 802,843.75 | 606,941.87 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 218,119.63 | 79,107.83 |
| 负债合计 | | 15,881,394.39 | 16,679,295.99 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 665,383,712.96 | 359,293,048.09 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 317,953,678.61 | 211,200,203.04 |
| 所有者权益合计 | | 983,337,391.57 | 570,493,251.13 |
| 负债和所有者权益总计 | | 999,218,785.96 | 587,172,547.12 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.478 元，基金份额总额 665,383,712.96 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | -83,890,610.15 | 23,012,285.74 |
| 1.利息收入 | | 467,774.88 | 87,055.83 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 413,506.60 | 79,160.65 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 54,268.28 | 7,895.18 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 7,606,703.57 | 6,090,041.38 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 3,262,748.89 | 5,586,960.89 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 4,343,954.68 | 503,080.49 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -94,622,741.78 | 16,370,248.33 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 2,657,653.18 | 464,940.20 |
| 减：二、费用 | | 9,717,796.08 | 1,964,854.27 |

| | | | |
|---------------------|------------|-------------------|------------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6, 109, 426. 75 | 1, 065, 470. 77 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1, 018, 237. 77 | 177, 578. 43 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 2, 382, 469. 76 | 530, 473. 50 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 207, 661. 80 | 191, 331. 57 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -93, 608, 406. 23 | 21, 047, 431. 47 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -93, 608, 406. 23 | 21, 047, 431. 47 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城环保优势股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|--------------------|----------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 359, 293, 048. 09 | 211, 200, 203. 04 | 570, 493, 251. 13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -93, 608, 406. 23 | -93, 608, 406. 23 |
| 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） | 306, 090, 664. 87 | 200, 361, 881. 80 | 506, 452, 546. 67 |
| 其中：1.基金申购款 | 770, 054, 690. 78 | 492, 512, 596. 08 | 1, 262, 567, 286. 86 |
| 2. 基金赎回款 | -463, 964, 025. 91 | -292, 150, 714. 28 | -756, 114, 740. 19 |
| 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） | 665, 383, 712. 96 | 317, 953, 678. 61 | 983, 337, 391. 57 |

| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 80,627,584.12 | 15,352,427.12 | 95,980,011.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 21,047,431.47 | 21,047,431.47 |
| 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) | 99,255,698.52 | 33,423,269.28 | 132,678,967.80 |
| 其中：1.基金申购款 | 176,539,945.29 | 56,260,098.60 | 232,800,043.89 |
| 2.基金赎回款 | -77,284,246.77 | -22,836,829.32 | -100,121,076.09 |
| 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) | 179,883,282.64 | 69,823,127.87 | 249,706,410.51 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| _____ | _____ | _____ |
| 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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城环保优势股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可 2015 1622 号文《关于准予景顺长城环保优势股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2016 年 1 月 12 日至 2016 年 3 月 11 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60467014_H02 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 3 月 15 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的

扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 256,455,323.47 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 131,541.79 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 256,586,865.26 元，折合 256,586,865.26 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金将基金资产的 80%-95% 投资于股票资产，投资于具有环保优势的上市公司发行的股票占非现金资产的比例不低于 80%。权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，将基金资产的 5%-20% 投资于现金和债券等固定收益类品种，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：中证环保产业指数收益率×40%+沪深 300 指数收益率×40%+中证全债指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2018 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

(2) 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税

应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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

（3）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 125,346,725.45 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 125,346,725.45 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------|------------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 945,076,986.38 | 866,261,100.11 | -78,815,886.27 |
| 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 | 945,076,986.38 | 866,261,100.11 | -78,815,886.27 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末的各项买入返售金融资产期末余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 26,920.65 |
| 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 | 840.87 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 1.27 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 111.60 |
| 合计 | 27,874.39 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 802,118.44 |
| 银行间市场应付交易费用 | 725.31 |
| 合计 | 802,843.75 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 30,601.14 |
| 预提费用 | 187,518.49 |
| 合计 | 218,119.63 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 359,293,048.09 | 359,293,048.09 |
| 本期申购 | 770,054,690.78 | 770,054,690.78 |

| | | |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -463,964,025.91 | -463,964,025.91 |
| - 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 | 665,383,712.96 | 665,383,712.96 |

注：本期申购份额包含基金转入份额；本期赎回份额包含基金转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | 149,287,981.90 | 61,912,221.14 | 211,200,203.04 |
| 本期利润 | 1,014,335.55 | -94,622,741.78 | -93,608,406.23 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 131,185,502.79 | 69,176,379.01 | 200,361,881.80 |
| 其中：基金申购款 | 328,778,052.82 | 163,734,543.26 | 492,512,596.08 |
| 基金赎回款 | -197,592,550.03 | -94,558,164.25 | -292,150,714.28 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 281,487,820.24 | 36,465,858.37 | 317,953,678.61 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 382,724.28 |
| 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 | 12,875.83 |
| 其他 | 17,906.49 |
| 合计 | 413,506.60 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 641,133,161.94 |
| 减：卖出股票成本总额 | 637,870,413.05 |
| 买卖股票差价收入 | 3,262,748.89 |

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 4,343,954.68 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 4,343,954.68 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -94,622,741.78 |
| ——股票投资 | -94,622,741.78 |
| ——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 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税 | - |
| 合计 | -94,622,741.78 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,145,759.14 |
| 基金转换费收入 | 511,894.04 |
| 合计 | 2,657,653.18 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 2,382,469.76 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 2,382,469.76 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 债券托管账户维护费 | 18,600.00 |
| 银行划款手续费 | 10,183.31 |
| 其他费用 | 360.00 |
| 其他 | - |
| 合计 | 207,661.80 |

6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|--------------------|
| 景顺长城基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记人、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 |
| 长城证券 | 19,893,564.88 | 1.17% | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量 的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 长城证券 | 18,526.83 | 1.17% | 18,526.83 | 2.31% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 |

| | | 量的比例 | | 总额的比例 |
|------|---|------|---|-------|
| 长城证券 | - | - | - | - |

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月 30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,109,426.75 | 1,065,470.77 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,468,247.13 | 420,430.02 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。基金管理费每日计提，按月支付。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,018,237.77 | 177,578.43 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。基金托管费每日计提，按月支付。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

本基金基金管理人本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 125,346,725.45 | 382,724.28 | 37,185,385.15 | 75,180.72 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603693 | 江苏新能 | 2018年6月25日 | 2018年7月3日 | 新股流通受限 | 9.00 | 9.00 | 5,384 | 48,456.00 | 48,456.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 603706 | 东方环宇 | 2018年6月29日 | 2018年7月9日 | 新股流通受限 | 13.09 | 13.09 | 1,765 | 23,103.85 | 23,103.85 | - |
| 603105 | 芯能科技 | 2018年6月29日 | 2018年7月9日 | 新股流通受限 | 4.83 | 4.83 | 3,410 | 16,470.30 | 16,470.30 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投

资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 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公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%（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该比例限制), 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%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 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 6.4.12。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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内, 对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制, 并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险, 及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值, 并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2018年6月30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------|-------|--------|------|------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 125,346,725.45 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | 125,346,725.45 |
| 结算备付金 | 2,076,253.34 | - | - | - | - | - | 2,076,253.34 |
| 存出保证金 | 275,611.06 | - | - | - | - | - | 275,611.06 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 866,261,100.11 | 866,261,100.11 |
| 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 | - | - | - | - | - | 1,248,802.11 | 1,248,802.11 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 27,874.39 | 27,874.39 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 67,983.17 | - | - | - | - | 3,914,436.33 | 3,982,419.50 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 127,766,573.02 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 871,452,212.94 | 999,218,785.96 |
| 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 | - | - | - | - | - | 13,345,000.12 | 13,345,000.12 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,298,940.75 | 1,298,940.75 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 216,490.14 | 216,490.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 802,843.75 | 802,843.75 |
| 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 | - | - | - | - | - | 218,119.63 | 218,119.63 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 15,881,394.39 | 15,881,394.39 |
| 利率敏感度缺口 | 127,766,573.02 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | - |
| 上年度末 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 | 52,879,666.09 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | 52,879,666.09 |
| 结算备付金 | 1,337,658.24 | - | - | - | - | - | 1,337,658.24 |
| 存出保证金 | 146,811.77 | - | - | - | - | - | 146,811.77 |

| | | | | | | | |
|-----------|---------------|------|------|------|------|----------------|----------------|
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 530,380,382.28 | 530,380,382.28 |
| 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 | - | - | - | - | - | 11,871.27 | 11,871.27 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 2,087.47 | - | - | - | - | 2,414,070.00 | 2,416,157.47 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 54,366,223.57 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 532,806,323.55 | 587,172,547.12 |
| 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 | - | - | - | - | - | 9,067,338.78 | 9,067,338.78 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 6,059,419.84 | 6,059,419.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 742,703.71 | 742,703.71 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 123,783.96 | 123,783.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 606,941.87 | 606,941.87 |
| 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 | - | - | - | - | - | 79,107.83 | 79,107.83 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 16,679,295.99 | 16,679,295.99 |
| 利率敏感度缺口 | 54,366,223.57 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - | - |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低

其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2018年6月30日 | | 上年度末 2017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 | 866,261,100.11 | 88.09 | 530,380,382.28 | 92.97 |
| 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 | 866,261,100.11 | 88.09 | 530,380,382.28 | 92.97 |

6.4.13.4.3.2 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（2018年6月30日） | 上年度末（2017年12月31日） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 43,104,192.11 | 24,247,016.08 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -43,104,192.11 | -24,247,016.08 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

2. 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 866,173,069.96 元，划分为第二层次的余额为人民币 88,030.15 元，无划分为第三层次的余额(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划分为第一层次的余额为人民币 530,232,030.07 元，第二层次的余额为人民币 148,352.21 元，无划分为第三层次的余额)。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具；本基金本期无净转入（转出）第三层次。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 866,261,100.11 | 86.69 |
| | 其中：股票 | 866,261,100.11 | 86.69 |
| 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 | 127,422,978.79 | 12.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,534,707.06 | 0.55 |
| 9 | 合计 | 999,218,785.96 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 45,826,784.00 | 4.66 |
| C | 制造业 | 532,333,898.81 | 54.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 71,559.85 | 0.01 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 63,473,354.42 | 6.45 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 90,595,504.19 | 9.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 95,375,105.63 | 9.70 |
| 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 | 450,157.95 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 81,226.14 | 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 | 38,053,509.12 | 3.87 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 866,261,100.11 | 88.09 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|---------------|--------------|
| 1 | 002841 | 视源股份 | 1,213,317 | 64,803,260.97 | 6.59 |
| 2 | 601601 | 中国太保 | 2,003,579 | 63,813,991.15 | 6.49 |
| 3 | 300413 | 快乐购 | 1,672,993 | 63,473,354.42 | 6.45 |
| 4 | 300323 | 华灿光电 | 4,607,024 | 59,522,750.08 | 6.05 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 12,694,400 | 45,826,784.00 | 4.66 |
| 6 | 603788 | 宁波高发 | 1,760,900 | 43,388,576.00 | 4.41 |
| 7 | 600115 | 东方航空 | 6,385,263 | 42,270,441.06 | 4.30 |
| 8 | 300203 | 聚光科技 | 1,582,465 | 40,511,104.00 | 4.12 |
| 9 | 002672 | 东江环保 | 3,085,200 | 40,385,268.00 | 4.11 |
| 10 | 601111 | 中国国航 | 4,493,122 | 39,943,854.58 | 4.06 |
| 11 | 603103 | 横店影视 | 1,238,721 | 38,053,509.12 | 3.87 |
| 12 | 300482 | 万孚生物 | 463,100 | 32,417,000.00 | 3.30 |
| 13 | 603197 | 保隆科技 | 1,203,321 | 31,948,172.55 | 3.25 |
| 14 | 600196 | 复星医药 | 726,401 | 30,065,737.39 | 3.06 |
| 15 | 002192 | 融捷股份 | 1,231,524 | 29,864,457.00 | 3.04 |
| 16 | 002223 | 鱼跃医疗 | 1,426,700 | 27,806,383.00 | 2.83 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 17 | 300633 | 开立医疗 | 765,780 | 26,082,466.80 | 2.65 |
| 18 | 603686 | 龙马环卫 | 1,049,100 | 25,640,004.00 | 2.61 |
| 19 | 002798 | 帝欧家居 | 742,090 | 21,965,864.00 | 2.23 |
| 20 | 300298 | 三诺生物 | 740,315 | 15,309,714.20 | 1.56 |
| 21 | 300207 | 欣旺达 | 1,675,500 | 15,096,255.00 | 1.54 |
| 22 | 002273 | 水晶光电 | 1,059,018 | 13,629,561.66 | 1.39 |
| 23 | 300616 | 尚品宅配 | 110,768 | 12,073,712.00 | 1.23 |
| 24 | 000001 | 平安银行 | 1,235,400 | 11,229,786.00 | 1.14 |
| 25 | 601336 | 新华保险 | 242,721 | 10,407,876.48 | 1.06 |
| 26 | 601318 | 中国平安 | 169,400 | 9,923,452.00 | 1.01 |
| 27 | 600029 | 南方航空 | 991,859 | 8,381,208.55 | 0.85 |
| 28 | 300750 | 宁德时代 | 10,261 | 738,381.56 | 0.08 |
| 29 | 300463 | 迈克生物 | 26,200 | 653,166.00 | 0.07 |
| 30 | 603259 | 药明康德 | 4,741 | 450,157.95 | 0.05 |
| 31 | 002572 | 索菲亚 | 7,477 | 240,609.86 | 0.02 |
| 32 | 300747 | 锐科激光 | 1,543 | 123,995.48 | 0.01 |
| 33 | 601330 | 绿色动力 | 4,971 | 81,226.14 | 0.01 |
| 34 | 603650 | 彤程新材 | 2,376 | 50,988.96 | 0.01 |
| 35 | 603693 | 江苏新能 | 5,384 | 48,456.00 | 0.00 |
| 36 | 603706 | 东方环宇 | 1,765 | 23,103.85 | 0.00 |
| 37 | 603105 | 芯能科技 | 3,410 | 16,470.30 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 300203 | 聚光科技 | 58,196,781.79 | 10.20 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 55,886,305.84 | 9.80 |
| 3 | 601601 | 中国太保 | 53,257,503.59 | 9.34 |
| 4 | 002672 | 东江环保 | 51,230,951.12 | 8.98 |
| 5 | 300323 | 华灿光电 | 50,518,652.62 | 8.86 |
| 6 | 000998 | 隆平高科 | 46,707,388.47 | 8.19 |
| 7 | 600115 | 东方航空 | 46,118,134.55 | 8.08 |
| 8 | 300413 | 快乐购 | 42,958,720.21 | 7.53 |
| 9 | 601111 | 中国国航 | 40,303,159.37 | 7.06 |
| 10 | 603103 | 横店影视 | 38,384,316.52 | 6.73 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 600703 | 三安光电 | 35,498,970.68 | 6.22 |
| 12 | 300482 | 万孚生物 | 33,750,707.55 | 5.92 |
| 13 | 002273 | 水晶光电 | 32,044,353.22 | 5.62 |
| 14 | 300298 | 三诺生物 | 31,732,106.62 | 5.56 |
| 15 | 002841 | 视源股份 | 31,647,931.58 | 5.55 |
| 16 | 002223 | 鱼跃医疗 | 29,745,493.58 | 5.21 |
| 17 | 002555 | 三七互娱 | 26,576,249.47 | 4.66 |
| 18 | 300633 | 开立医疗 | 26,338,380.25 | 4.62 |
| 19 | 603686 | 龙马环卫 | 25,894,842.55 | 4.54 |
| 20 | 002798 | 帝欧家居 | 25,317,331.86 | 4.44 |
| 21 | 600977 | 中国电影 | 24,694,628.10 | 4.33 |
| 22 | 002192 | 融捷股份 | 23,181,807.87 | 4.06 |
| 23 | 603788 | 宁波高发 | 23,050,294.82 | 4.04 |
| 24 | 600196 | 复星医药 | 22,478,208.66 | 3.94 |
| 25 | 002303 | 美盈森 | 22,036,159.89 | 3.86 |
| 26 | 601336 | 新华保险 | 21,919,693.00 | 3.84 |
| 27 | 002572 | 索菲亚 | 18,537,346.11 | 3.25 |
| 28 | 300207 | 欣旺达 | 15,245,203.00 | 2.67 |
| 29 | 002456 | 欧菲科技 | 14,698,791.09 | 2.58 |
| 30 | 603197 | 保隆科技 | 13,976,301.00 | 2.45 |
| 31 | 002120 | 韵达股份 | 11,719,037.97 | 2.05 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 000998 | 隆平高科 | 42,807,634.00 | 7.50 |
| 2 | 600977 | 中国电影 | 40,074,665.34 | 7.02 |
| 3 | 300616 | 尚品宅配 | 35,545,898.25 | 6.23 |
| 4 | 000967 | 盈峰环境 | 31,150,952.36 | 5.46 |
| 5 | 600703 | 三安光电 | 29,967,124.44 | 5.25 |
| 6 | 601336 | 新华保险 | 26,701,387.51 | 4.68 |
| 7 | 002273 | 水晶光电 | 24,810,729.98 | 4.35 |
| 8 | 002555 | 三七互娱 | 23,992,093.67 | 4.21 |
| 9 | 002572 | 索菲亚 | 22,937,157.11 | 4.02 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 10 | 300422 | 博世科 | 22,838,084.09 | 4.00 |
| 11 | 002456 | 欧菲科技 | 21,374,795.26 | 3.75 |
| 12 | 002303 | 美盈森 | 20,562,351.72 | 3.60 |
| 13 | 600426 | 华鲁恒升 | 19,421,281.92 | 3.40 |
| 14 | 600029 | 南方航空 | 18,178,147.91 | 3.19 |
| 15 | 603799 | 华友钴业 | 17,467,378.26 | 3.06 |
| 16 | 300203 | 聚光科技 | 17,123,749.71 | 3.00 |
| 17 | 002241 | 歌尔股份 | 14,141,804.74 | 2.48 |
| 18 | 300323 | 华灿光电 | 14,077,344.00 | 2.47 |
| 19 | 300298 | 三诺生物 | 13,787,976.02 | 2.42 |
| 20 | 601111 | 中国国航 | 13,734,158.42 | 2.41 |
| 21 | 000065 | 北方国际 | 13,685,523.66 | 2.40 |
| 22 | 300232 | 洲明科技 | 12,712,007.80 | 2.23 |
| 23 | 002120 | 韵达股份 | 12,037,845.44 | 2.11 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,068,373,872.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 641,133,161.94 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

- 1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。
- 2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。
- 3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1. 东江环保股份有限公司（以下简称“东江环保”，股票代码：002672）于 2018 年 6 月 25

日收到江西省丰城市环保局下发的《行政处罚事先（听证）告知书》（丰环罚告字（2018）18 号），因其控股子公司江西东江技术有限公司（以下简称“江西东江”）二燃室温度经常低于环评要求的 ≥ 1100 度的要求，存在不正常运行污染防治设施的情形，江西东江被罚款五十万元。

本基金投研人员认为，由于中央环保督查组今年重点督查危废产业，不少危废处理企业因违规经营被关停，致使全国各地的危废处理能力大幅收缩，另一方面，由于环保部门严格管理产废企业合规处理危险废弃物，危废产生量急剧上升，危废行业供需结构迅速逆转，形成很大的供需缺口。预计供需紧张状态未来 3-5 年都难以改观。作为业内运营水准较高、较为规范的企业，东江环保预计充分享受这次行业红利。东江环保也是业内少数全部基地正常运营并通过环保督查的危废处理企业，这也说明东江环保的运营质量。

6 月 25 日，东江环保收到江西省丰城市环保局下发的《行政处罚事先（听证）告知书》（丰环罚告字（2018）18 号），公司对此次指控全部否认，后续处理结果仍待观察。公司作为业内公认的行业龙头，项目运营有口皆碑，此次事件更多反应公司管理存在瑕疵，而不能说明公司的运营质量。此次事件不涉及违规处理危险废弃物，预计不会影响江西子公司的正常经营，也不破坏我们的逻辑判断。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对东江环保进行了投资。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 275,611.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,248,802.11 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,874.39 |
| 5 | 应收申购款 | 3,982,419.50 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,534,707.06 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 71,230 | 9,341.34 | 337,226,628.33 | 50.68% | 328,157,084.63 | 49.32% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 651,629.22 | 0.10% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金 | - |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年3月15日）基金份额总额 | 256,586,865.26 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 359,293,048.09 |
| 本报告期基金总申购份额 | 770,054,690.78 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 463,964,025.91 |
| 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 | 665,383,712.96 |

注：本期申购份额包含基金转入份额；本期赎回份额包含基金转出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、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。

2、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。

3、本基金管理人于 2018 年 5 月 31 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，聘任黎海威先生担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2018 年 6 月 2 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，同意刘奇伟先生辞去本公司副总经理一职。

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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|----------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|--------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中泰证券股份有限公司 | 3 | 441,393,495.91 | 25.86% | 411,075.46 | 25.86% | 新增 2 个 |
| 光大证券股份有限公司 | 2 | 356,273,197.70 | 20.87% | 331,798.55 | 20.87% | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1 | 350,871,302.69 | 20.55% | 326,769.17 | 20.55% | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | 114,982,436.38 | 6.74% | 107,084.28 | 6.74% | - |
| 长江证券股份有限公司 | 1 | 102,101,437.33 | 5.98% | 95,088.94 | 5.98% | 本期新增 |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 96,073,790.93 | 5.63% | 89,472.52 | 5.63% | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | 81,551,496.02 | 4.78% | 75,948.36 | 4.78% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 65,237,787.19 | 3.82% | 60,758.25 | 3.82% | - |
| 天风证券股份有限公司 | 1 | 47,454,100.95 | 2.78% | 44,194.31 | 2.78% | 本期新增 |
| 国信证券股份有限公司 | 2 | 20,626,096.91 | 1.21% | 19,209.24 | 1.21% | - |
| 长城证券股份有限公司 | 2 | 19,893,564.88 | 1.17% | 18,526.83 | 1.17% | 本期新增 |
| 西部证券股份有限公司 | 2 | 6,689,731.26 | 0.39% | 6,230.39 | 0.39% | 本期新增 |
| 西藏东方财富证券股份有限公司 | 2 | 4,039,357.00 | 0.24% | 3,761.88 | 0.24% | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 东北证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
|------------|---|---|---|---|---|---|

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------------------|--|--|--|--|--|--|
| 份有限公司 | | | | | | |
| 中银国际证 券有限责任 公司 | | | | | | |
| 招商证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 天风证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 国信证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 长城证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 西部证券股 份有限公司 | | | | | | |
| 西藏东方财 富证券股份 有限公司 | | | | | | |
| 东北证券股 份有限公司 | | | | | | |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 1 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加大泰金石基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年1月20日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加洪泰财富(青岛)基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年1月22日 |
| 3 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2017 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 | 2018年1月22日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增洪泰财富(青岛)基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年1月22日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年2月6日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京创金启富投资管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 2 月 13 日 |
| 7 | 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 | 2018 年 2 月 14 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海有鱼基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 2 月 28 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海有鱼基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 2 月 28 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 | 2018 年 3 月 22 日 |
| 11 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金托管协议 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 13 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 14 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2017 年年度报告摘要 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 28 日 |
| 15 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 继续参加中国工商银行个人电子银行基金 申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 28 日 |
| 16 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2017 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 | 2018 年 3 月 28 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 3 月 30 日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基 | 2018 年 4 月 2 日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 有限公司基金申购费率优惠活动的公告 | 金管理人网站 | |
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳盈信基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月11日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳盈信基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月11日 |
| 21 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2018 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 | 2018年4月21日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海钜派钰茂基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月23日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海钜派钰茂基金销售有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月23日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月24日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于存量客户非居民涉税信息收集功能上线的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月25日 |
| 26 | 景顺长城基金管理有限公司关于实施存量非居民金融账户涉税信息尽职调查的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月25日 |
| 27 | 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 | 2018年4月26日 |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月27日 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华鑫证券有限责任公司基金申购及定期定额投 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018年4月27日 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| | 资申购费率优惠活动的公告 | | |
| 30 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2018 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 | 2018 年 4 月 28 日 |
| 31 | 景顺长城环保优势股票型证券投资基金 2018 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 | 2018 年 4 月 28 日 |
| 32 | 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 | 2018 年 5 月 18 日 |
| 33 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 5 月 21 日 |
| 34 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增四川天府银行股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 5 月 23 日 |
| 35 | 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 | 2018 年 5 月 31 日 |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司基金认/申购(含定期定额投资申购) 费率优惠活动的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 5 月 31 日 |
| 37 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增扬州国信嘉利基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 5 月 31 日 |
| 38 | 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 | 2018 年 6 月 2 日 |
| 39 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联公司承销证券的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 6 月 13 日 |
| 40 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站 | 2018 年 6 月 20 日 |
| 41 | 景顺长城基金管理有限公司关于 | 中国证券报, 上海证 | 2018 年 6 月 20 日 |

| | | | |
|----|--|--------------------------|-----------------|
| | 旗下部分基金参加民商基金销售（上海）有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 券报，证券时报，基金管理人网站 | |
| 42 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2018 年 6 月 29 日 |
| 43 | 景顺长城基金管理有限公司关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2018 年 6 月 29 日 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性新规》”）的要求，景顺长城基金管理有限公司对包括本基金在内的旗下 62 只公开募集开放式证券投资基金基金合同及托管协议进行修改。并按照法规要求对适用基金持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入该基金的基金财产。修改后的基金合同、托管协议及赎回费相关规则调整等事宜已于 2018 年 3 月 31 日起生效。有关详细信息参见本公司于 2018 年 3 月 23 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下 62 只基金修改基金合同及托管协议的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城环保优势股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城环保优势股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日