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 2018年半年度报告摘要

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8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城中证500ETF联接
场内简称	无
基金主代码	001455
交易代码	001455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	399,305,637.92份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF,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	本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标ETF,或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金管理人会在10个交易日内对投资组合进行适当调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。 在正常情况下,本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
业绩比较基准	95%×中证500指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为ETF联接基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为股票型指数基金,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,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

2.2.1 目标基金产品说明

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@igwfmc.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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	-1,150,538.62
本期利润	-45,848,170.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1155
本期基金份额净值增长率	-14.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2948
期末基金资产净值	281,594,623.21
期末基金份额净值	0.705

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	-8.20%	1.72%	-8.86%	1.77%	0.66%	-0.05%
过去三个月	-12.64%	1.28%	-13.96%	1.31%	1.32%	-0.03%
过去六个月	-14.23%	1.33%	-15.71%	1.37%	1.48%	-0.04%
过去一年	-11.43%	1.13%	-14.21%	1.16%	2.78%	-0.03%
过去三年	-29.50%	1.56%	-39.40%	1.80%	9.90%	-0.24%
自基金合同生效起至今	-29.50%	1.56%	-40.48%	1.82%	10.98%	-0.26%

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:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,同时不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自2015年6月29日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至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、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
徐喻军	本基金的基金经理	2015年6月29日	-	8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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

2018年6月工业增加值累计增长6.7%,增速略有下降。6月PMI指数51.5,景气指数略有回落;6月PPI同比上涨4.7%,环比上涨0.3%,同比涨幅提升;6月CPI同比上涨1.9%,涨幅持平,通胀预期维持平稳。6月M2增速略有回落至8.0%,M1增速回升至6.6%,考虑到经济下行压力加大,货币政策由合理稳定转为合理充裕,央行通过降准缓解经济下行压力。6月末外汇储备3.1万亿美元,汇率受到内外部环境因素影响呈现贬值趋势。受金融去杠杆、中美贸易战和社融增速明显下滑影响,上半年权益市场情绪低落,上证综指、沪深300、创业板指分别下跌13.90%、12.90%和8.33%。

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-14.23%,业绩比较基准收益率为-15.71%。报告期内,本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,跟踪误差(年化)控制在4%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年下半年的宏观经济,紧信用环境下社融增速仍存在下行压力,基建增速大概率维持低位,地产投资增速存在回落压力,经济增速面临较大的下滑压力。中美贸易冲突加剧,对进出口的负面影响仍有待进一步观察。食品价格维持低位,CPI压力并不大。长期来看,改革创新是保持经济增长的根本动力,在供给侧改革和产业升级的背景下,我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。

本基金是景顺长城中证500ETF的联接基金,主要投资于景顺长城中证500ETF。报告期内,本基金根据申赎情况进行日常操作,力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

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联接基金(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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	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	17,877,709.90	16,466,295.36
结算备付金	-	-
存出保证金	5,024.15	6,663.71
交易性金融资产	263,875,569.96	304,164,604.00
其中:股票投资	127,569.96	879,804.00
基金投资	263,748,000.00	303,284,800.00
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,194.76	3,282.63
应收股利	-	-
应收申购款	170,569.39	35,654.69
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	281,932,068.16	320,676,500.39
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	8.80	-
应付赎回款	142,998.02	31,568.01
应付管理人报酬	7,031.23	7,480.96
应付托管费	1,406.22	1,496.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,942.08	5,563.06
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	179,058.60	60,081.69
负债合计	337,444.95	106,189.91
所有者权益:		
实收基金	399,305,637.92	389,944,230.17
未分配利润	-117,711,014.71	-69,373,919.69
所有者权益合计	281,594,623.21	320,570,310.48
负债和所有者权益总计	281,932,068.16	320,676,500.39

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.705元,基金份额总额399,305,637.92份。

6.2 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联接基金

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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-45,579,757.73	-13,779,296.88
1.利息收入	62,183.84	69,703.24
其中:存款利息收入	62,183.84	69,703.24
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-970,187.99	-3,315,599.23
其中:股票投资收益	-254,419.15	-2,396,153.84
基金投资收益	-719,476.92	-920,075.66
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,708.08	630.27
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-44,697,632.34	-10,541,511.47
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	25,878.76	8,110.58
减:二、费用	268,413.23	476,644.32
1. 管理人报酬	44,097.05	47,051.55
2. 托管费	8,819.42	9,410.32
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	35,998.53	245,495.09
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	179,498.23	174,687.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-45,848,170.96	-14,255,941.20
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-45,848,170.96	-14,255,941.20

6.3 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联接基金

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)	389,944,230.17	-69,373,919.69	320,570,310.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-45,848,170.96	-45,848,170.96
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)	9,361,407.75	-2,488,924.06	6,872,483.69
其中:1.基金申购款	43,390,613.49	-9,384,222.88	34,006,390.61
2.基金赎回款	-34,029,205.74	6,895,298.82	-27,133,906.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	399,305,637.92	-117,711,014.71	281,594,623.21
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)	99,485,351.48	-18,564,649.66	80,920,701.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-14,255,941.20	-14,255,941.20
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)	303,595,744.48	-49,384,226.57	254,211,517.91
其中:1.基金申购款	317,222,927.73	-51,903,765.74	265,319,161.99
2.基金赎回款	-13,627,183.25	2,519,539.17	-11,107,644.08
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)	403,081,095.96	-82,204,817.43	320,876,278.53

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"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[2015]899号《关于准予景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币213,813,305.77元,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(2015)第720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联接基金基金合同》于2015年6月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,867,925.87份基金份额,其中认购资金利息折合54,620.10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。

本基金是景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"目标ETF")的联接基金。目标ETF是主要采用完全复制法实现对中证500指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%,年化跟踪误差控制在4%以内。

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联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股,投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,同时不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中证500指数 X 95%+银行活期存款税后利率 X 5%。

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8月23日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(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联接基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局、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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司("长城证券")	基金管理人的股东
景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金("目标ETF")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
长城证券	11,472,173.90	47.10%	2,650,473.43	1.15%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	10,684.60	47.10%	3,192.15	45.98%
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	2,468.19	1.15%	2,468.19	45.40%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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	44,097.05	47,051.55
其中:支付销售机构的客户维护费	72,089.95	85,343.06

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费,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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.5%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 - 基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值) X 0.5% /当年天数。

6.4.8.2.2 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	8,819.42	9,410.32

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,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扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.1%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 - 基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值) X 0.1% /当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	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
中国银行	17,877,709.90	61,870.52	18,290,003.99	61,384.37

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末,本基金持有186,000,000.00份目标ETF基金份额,占其份额的比例为97.60%(2017年12月31日:本基金持有182,000,000.00份目标ETF基金份额,占其总份额的比例为97.55%)。

6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

单位:人民币元

项目	本期费用 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
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	730,669.30	506,772.19
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	146,133.86	101,354.44

注:1. 本项所列示的费用是根据本基金所持有的目标基金招募说明书列明的计算方法对目标基金收取的管理费、托管费进行的估算;

2.上述费用已在本基金所持有目标基金的净值中体现,不构成本基金的费用。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300146	汤臣倍健	2018年1月31日	重大事项停牌	15.35	2018年7月31日	16.50	1,200	20,118.00	18,420.00	-
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项停牌	12.99	2018年7月9日	11.60	800	10,312.00	10,392.00	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项停牌	1.92	2018年8月16日	1.83	5,300	10,706.00	10,176.00	-
000825	太钢不锈	2018年4月16日	重大事项停牌	5.49	-	-	1,800	10,800.00	9,882.00	-
300266	兴源环境	2018年2月5日	重大事项停牌	16.64	2018年7月2日	17.99	500	9,995.00	8,320.00	-
002051	中工国际	2018年4月9日	重大事项停牌	12.75	-	-	500	7,810.00	6,375.00	-
600751	海航科技	2018年1月12日	重大事项停牌	5.51	-	-	1,000	6,490.00	5,510.00	-
000939	凯迪生态	2017年11月16日	重大事项停牌	4.06	2018年7月2日	4.74	1,300	6,487.00	5,278.00	-
600158	中体产业	2018年3月27日	重大事项停牌	10.03	2018年7月16日	11.61	500	5,820.00	5,015.00	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大事项停牌	10.29	-	-	400	5,904.00	4,116.00	-
600086	东方金钰	2018年1月19日	重大事项停牌	7.27	-	-	500	5,020.00	3,635.00	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大事项停牌	3.78	2018年7月2日	3.92	900	3,924.00	3,402.00	-
002359	北讯集团	2018年5月21日	重大事项停牌	16.71	-	-	200	4,930.00	3,342.00	-
600759	洲际油气	2018年3月27日	重大事项停牌	3.59	-	-	900	3,546.00	3,231.00	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项停牌	15.74	2018年7月2日	16.88	200	3,752.00	3,148.00	-
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项停牌	4.71	-	-	600	3,824.00	2,826.00	-
600335	国机汽车	2018年4月3日	重大事项停牌	9.07	-	-	300	3,159.00	2,721.00	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大事项停牌	17.56	2018年8月1日	16.12	140	2,530.00	2,458.40	-
002431	棕榈股份	2018年5月30日	重大事项停牌	5.95	-	-	400	2,896.00	2,380.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项停牌	5.73	2018年8月13日	5.57	400	2,276.00	2,292.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项停牌	3.75	-	-	600	2,634.00	2,250.00	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事项停牌	5.39	-	-	400	2,560.00	2,156.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项停牌	8.38	-	-	252	2,656.04	2,111.76	-
000669	金鸿控股	2018年5月18日	重大事项停牌	6.61	2018年8月6日	6.53	280	2,204.00	1,850.80	-
002665	首航节能	2018年5月29日	重大事项停牌	5.42	-	-	300	1,935.00	1,626.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项停牌	3.01	-	-	400	1,460.00	1,204.00	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大事项停牌	4.48	2018年7月2日	4.46	200	1,386.00	896.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于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属于第一层次的余额为263,750,556.00元,属于第二层次的余额为125,013.96元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次303,919,637.00元,第二层次244,967.00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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票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2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017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)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。

§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	127,569.96	0.05
	其中:股票	127,569.96	0.05
2	基金投资	263,748,000.00	93.55
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	17,877,709.90	6.34
8	其他各项资产	178,788.30	0.06
9	合计	281,932,068.16	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	1,204.00	0.00
B	采矿业	3,231.00	0.00
C	制造业	65,335.40	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,128.80	0.00
E	建筑业	11,581.00	0.00
F	批发和零售业	10,481.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,453.76	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,131.00	0.00
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	8,320.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,704.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	127,569.96	0.05

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前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300146	汤臣倍健	1,200	18,420.00	0.01
2	000566	海南海药	800	10,392.00	0.00
3	600022	山东钢铁	5,300	10,176.00	0.00
4	000825	太钢不锈	1,800	9,882.00	0.00
5	300266	兴源环境	500	8,320.00	0.00
6	002051	中工国际	500	6,375.00	0.00
7	600751	海航科技	1,000	5,510.00	0.00
8	000939	凯迪生态	1,300	5,278.00	0.00
9	600158	中体产业	500	5,015.00	0.00
10	002147	新光圆成	400	4,116.00	0.00

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

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	600516	方大炭素	125,432.00	0.04
2	600176	中国巨石	109,928.00	0.03
3	000661	长春高新	102,385.00	0.03
4	600201	生物股份	95,161.00	0.03
5	002405	四维图新	90,789.00	0.03
6	002422	科伦药业	88,302.00	0.03
7	603019	中科曙光	84,993.00	0.03
8	600525	长园集团	83,903.00	0.03
9	000830	鲁西化工	83,708.00	0.03
10	000513	丽珠集团	83,210.00	0.03
11	000418	小天鹅A	81,749.00	0.03
12	000786	北新建材	80,742.00	0.03
13	002271	东方雨虹	79,024.00	0.02
14	600584	长电科技	78,902.00	0.02
15	600426	华鲁恒升	78,055.00	0.02
16	002001	新 和 成	75,000.00	0.02
17	002340	格林美	70,520.00	0.02
18	600315	上海家化	70,187.00	0.02
19	002078	太阳纸业	69,534.00	0.02
20	600521	华海药业	66,891.00	0.02

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	600516	方大炭素	84,098.00	0.03
2	000661	长春高新	76,565.00	0.02
3	600176	中国巨石	74,167.60	0.02
4	002405	四维图新	65,283.00	0.02
5	002422	科伦药业	64,686.00	0.02
6	603019	中科曙光	63,005.00	0.02
7	600201	生物股份	61,209.00	0.02
8	000513	丽珠集团	58,643.00	0.02
9	600525	长园集团	57,785.00	0.02
10	000418	小天鹅A	55,391.00	0.02
11	600584	长电科技	53,151.00	0.02
12	000786	北新建材	52,891.00	0.02
13	600426	华鲁恒升	51,483.00	0.02
14	600521	华海药业	50,149.00	0.02
15	002340	格林美	49,068.00	0.02
16	000830	鲁西化工	48,745.00	0.02
17	002271	东方雨虹	48,136.00	0.02
18	002410	广联达	47,179.00	0.01
19	600315	上海家化	46,755.00	0.01
20	000592	平潭发展	45,920.00	0.01

注:卖出金额为成交金额(成交单价乘以成交数量),未考虑相关交易费用。

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	14,419,701.53
卖出股票收入(成交)总额	9,939,908.10

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式	景顺长城基金管理有限公司	263,748,000.00	93.66

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率和交易成本。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1

1.海南海药股份有限公司(以下简称"海南海药",股票代码:000566)于2018年5月16日收到中国证券监督管理委员会海南监管局《中国证券监督管理委员会海南监管局行政处罚决定书》([2018]2号)。海南海药因未按规定披露重大担保事项以及未按规定披露关联交易事项,中国证券监督管理委员会海南监管局决定对海南海药给予警告,并处以30万元罚款。

本基金投研人员认为,因本报告期末海南海药属于中证500指数成分股,而本基金为景顺长城中证500ETF的联接基金,因此被动持有海南海药。

2.凯迪生态环境科技股份有限公司(以下简称"*ST凯迪",股票代码:000939)于2018年5月7日收到中国证券监督管理委员会调查通知书,因公司相关行为涉嫌信息披露违规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对该公司立案调查。

本基金投研人员认为,本报告期末*ST凯迪调出了中证500指数,但由于该股票处于停牌状态,因此被动持有*ST凯迪。

3.其余八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。

7.13.2

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。

7.13.3 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	5,024.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,194.76
5	应收申购款	170,569.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	178,788.30

7.13.4 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。

7.13.5 期末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	300146	汤臣倍健	18,420.00	0.01	重大事项停牌
2	000566	海南海药	10,392.00	0.00	重大事项停牌
3	600022	山东钢铁	10,176.00	0.00	重大事项停牌
4	000825	太钢不锈	9,882.00	0.00	重大事项停牌
5	300266	兴源环境	8,320.00	0.00	重大事项停牌
6	002051	中工国际	6,375.00	0.00	重大事项停牌
7	600751	海航科技	5,510.00	0.00	重大事项停牌
8	000939	凯迪生态	5,278.00	0.00	重大事项停牌
9	600158	中体产业	5,015.00	0.00	重大事项停牌
10	002147	新光圆成	4,116.00	0.00	重大事项停牌

§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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
8,225	48,547.80	310,632,019.11	77.79%	88,673,618.81	22.21%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年6月29日)基金份额总额	213,867,925.87
本报告期期初基金份额总额	389,944,230.17
本报告期基金总申购份额	43,390,613.49
减:本报告期基金总赎回份额	34,029,205.74
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	399,305,637.92

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
海通证券股份有限公司	3	12,886,441.23	52.90%	12,001.78	52.90%	-
长城证券股份有限公司	3	11,472,173.90	47.10%	10,684.60	47.10%	-
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
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	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	310,632,019.11	-	-	310,632,019.11	77.79%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额的20%的情况,可能会出现如下风险:
1、大额申购风险
在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。
2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:
(1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;
(2)如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
(3)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;
(4)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
(5)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
(6)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。
本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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》。

景顺长城基金管理有限公司

2018年8月25日