景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

2017年 12 月 31 日
基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,基金管理人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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城公司治理混合
场内简称	无
基金主代码	260111
交易代码	260111
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年 10 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	145,520,902.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有良好公司治理的上市公司的股票,以及因治理结构改善而使公司内部管理得到明显提升的上市公司的股票,在控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金依据以宏观经济分析模型(MEM)为基础的资产配置模型决定基金的资产配置,运用景顺长城"股票研究数据库(SRD)"等分析系统,基于公司治理评价体系和FVMC等连锁模型作为个股选择的依据,同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整,以谋求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数× 80%+中证全债指数× 20%。
风险收益特征	本基金是风险程度高的投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨柳阳	邪明
	联系电话	0755- 82370388	010- 66105799
	电子邮箱	investor@gwfmc.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755- 22381339	010- 66105798

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	38, 135, 546.55	- 8, 944, 173.04	47, 502, 501.27
本期利润	47, 347, 131.29	- 8, 312, 551.64	34, 092, 277.07
加权平均基金份额本期利润	0.3147	- 0.1890	0.7082
本期基金份额净值增长率	31.20%	- 15.81%	18.86%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.3500	0.0286	0.5000
期末基金资产净值	196, 459, 204.93	157, 937, 391.11	54, 999, 379.31
期末基金份额净值	1.350	1.029	1.500

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

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

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

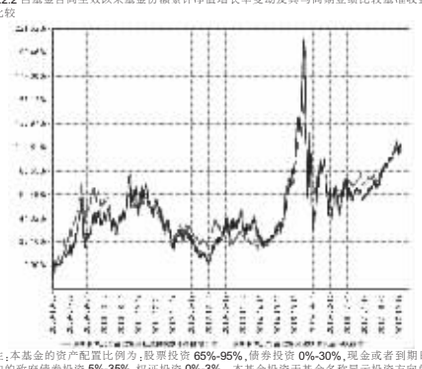
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

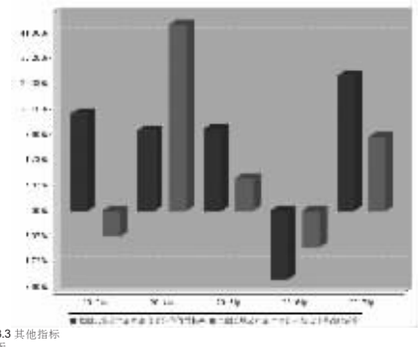
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.88%	0.73%	3.92%	0.64%	1.96%	0.09%
过去六个月	12.88%	0.64%	7.89%	0.56%	4.99%	0.08%
过去一年	31.20%	0.61%	17.08%	0.51%	14.12%	0.10%
过去三年	31.29%	2.22%	15.30%	1.35%	15.99%	0.87%
过去五年	90.44%	1.92%	54.79%	1.24%	35.65%	0.68%
自基金合同生效起至今	113.42%	1.73%	106.35%	1.29%	7.07%	0.44%

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



注:本基金的资产配置比例为:股票投资 65%-95%,债券投资 0%-30%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资 5%-35%,权证投资 0%-3%。本基金投资于基金名称显示投资方向的股票不低于基金股票投资的 80%;本基金自 2008 年 10 月 22 日合同生效日起至 2009 年 4 月 21 日为建仓期。建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 其他指标
无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	-	-	-	-	
2016	2.500	4, 278, 139.60	3, 194, 104.09	7, 472, 243.69	
2015	-	-	-	-	
合计	2.500	4, 278, 139.60	3, 194, 104.09	7, 472, 243.69	

§ 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、景顺长城内需增长灵活配置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、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、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、景顺长城景益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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
江科宏	本基金的基金经理	2015年 1 月 27 日	-	10年	经济学硕士,CFA、2007年至2010年担任本公司风险管理经理职务。2011 年 2 月重新加入本公司,担任研究员等职务;自 2012 年 6 月起担任基金经理。
徐榆军	本基金的基金经理	2017 年 1 月 6 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。
万梦	本基金的基金经理	2017 年 4 月 1 日	-	6年	工学硕士,曾任职于戈隆(中国)有限公司。2011 年 9 月加入本公司,先后担任研究部行业研究员、固定收益部研究员和基金经理助理职务;自 2015 年 7 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、《景顺长城公司治理混合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在位调整,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,经济整体呈现稳定迹象。12 月 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。货币政策基调购房风险,市场流动性继续维持中性。12 月 M2 增速回落至 8.2%,M1 增速也回落至 11.8%,货币供应继续保持较紧的状态;12 月末外汇储备 3.1 万亿美元,逐月都有所增加,汇率受到内外部环境因素影响稳步上升。房地产行业今年以来出现分化,12 月末的 70 个大中城市新建住宅价格指数同比上涨 5.6%,环比上涨 0.5%,涨幅维持平稳略有回落;三四线城市地产销售景气度大幅好于一二线城市,截至 12 月的全国房地产销售面积累计同比上升 7.7%,销售额累计同比上升 13.7%。

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%,业绩稳定的监管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。长期看,真正具备竞争力、估值相对便宜的公司长期股价是能够战胜市场指数的。本基金继续以基本面选股为主,重点关注具有良好治理结构的公司,今年以来主要配置估值合理、业绩表现稳健的价值蓝筹股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年度,本基金份额净值增长率为 31.20%,业绩比较基准收益率为 17.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计经济在积极财政政策支持下会继续保持平稳,但面临的内外部压力依然很大,通胀、汇率都有不确定性因素。房地产调控将对资本市场产生较大影响,中长期看整体流动性可能会持续紧缩,在防风险、抑制资产泡沫的中性货币政策基调下,以及金融监管不断强化的背景下,整个市场的估值体系有可能会持续修正。但是,少数具备竞争优势的行业龙头公司反而有可能从估值折价转为估值溢价,这种修正是产业及资本市场发展成熟的自然结果。本基金操作思路上,依然以基本面选股为主,持续看好盈利能力强、管理优秀以及估值合理的行业龙头公司,力争获取长期投资回报。

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评估及验证,并根据评估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价政策及程序的合规性,控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后,基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对,法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止 2017 年 12 月 31 日,本基金可供分配利润为 50,938,302.37 元,根据基金合同约定本次应分配金额为 25,469,151.19 元,本基金的基金管理人已于 2018 年 1 月 19 日完成权益登记,每 10 份基金份额派发红利 1.8 元,详细信息请查阅相关分红公告。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对景顺长城公司治理混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,景顺长城公司治理混合型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城公司治理混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,景顺长城公司治理混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城公司治理混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

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

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:景顺长城公司治理混合型证券投资基金
报告截止日:2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	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	8, 766, 792.19	12, 612, 024.77
结算备付金	559, 601.25	71, 770.73
存出保证金	12, 422.88	14, 610.27
交易性金融资产	169, 792, 504.09	124, 900, 178.60
其中:股票投资	140, 541, 504.09	107, 130, 578.60
基金投资	-	-
债券投资	29, 251, 000.00	17, 769, 600.00
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	18, 000, 147.00	19, 800, 149.70
应收证券清算款	-	762, 736.74
应收利息	352, 496.62	182, 597.25
应收股利	-	-
应收申购款	26, 487.57	3, 220.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	197, 510, 451.60	158, 347, 288.31
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	533, 722.03	3, 186.95
应付管理人报酬	247, 899.06	92, 819.35
应付托管费	41, 316.51	15, 469.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	157, 506.97	143, 917.05
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	70, 802.10	154, 503.96
负债合计	1, 051, 246.67	409, 897.20
所有者权益:		
实收基金	145, 520, 902.56	153, 544, 331.33
未分配利润	50, 938, 302.37	4, 393, 059.78
所有者权益合计	196, 459, 204.93	157, 937, 391.11
负债和所有者权益总计	197, 510, 451.60	158, 347, 288.31

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.350 元,基金份额总额 145,520,902.56 份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城公司治理混合型证券投资基金
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	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	51, 976, 327.26	- 6, 820, 702.15
1.利息收入	1, 371, 105.92	91, 769.11
其中:存款利息收入	71, 249.86	59, 251.63
债券利息收入	937, 198.16	5, 364.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	362, 657.90	27, 153.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	41, 219, 043.36	- 7, 645, 714.97
其中:股票投资收益	38, 964, 275.16	- 7, 812, 516.43
基金投资收益	-	-
债券投资收益	29, 401.59	55, 381.06
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	2, 225, 366.61	111, 420.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9, 211, 584.74	631, 621.40
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	174, 593.24	101, 622.31
减:二、费用	4, 629, 195.97	1, 491, 849.49
1. 管理人报酬	2, 670, 081.70	690, 374.83
2. 托管费	445, 013.61	115, 062.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1, 107, 372.94	467, 487.17
5. 利息支出	5, 006.94	-
其中:卖出回购金融资产支出	5, 006.94	-
6. 其他费用	401, 720.78	218, 925.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	47, 347, 131.29	- 8, 312, 551.64
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	47, 347, 131.29	- 8, 312, 551.64

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城公司治理混合型证券投资基金
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)	153, 544, 331.33	4, 393, 059.78	157, 937, 391.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	47, 347, 131.29	47, 347, 131.29
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)	- 8, 023, 428.77	- 801, 888.70	- 8, 825, 317.47
其中:1.基金申购款	122, 461, 151.78	13, 957, 836.31	136, 418, 988.09
2.基金赎回款	- 130, 484, 580.55	- 14, 759, 725.01	- 145, 244, 305.56
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)	145, 520, 902.56	50, 938, 302.37	196, 459, 204.93

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	445, 013.61	115, 062.49

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外,本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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
中国工商银行	8, 766, 792.19	59, 466.70	12, 612, 024.77	56, 953.57

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002859	洁美科技	2017年 3 月 24 日	2018年 4 月 9 日	新股流通受限	29.82	33.80	6, 666	198, 780.12	225, 310.80	-
002859	洁美科技	2017年 3 月 24 日	2018年 4 月 9 日	新股流通受限	-	33.80	9, 999	-	337, 966.20	-
300713	英可瑞	2017年 10 月 23 日	2018年 11 月 1 日	新股流通受限	40.29	74.87	7, 008	282, 352.32	524, 688.96	-
002892	科力尔	2017年 8 月 10 日	2018年 8 月 17 日	新股流通受限	17.56	32.16	11, 000	193, 160.00	353, 760.00	-
002860	星帅尔	2017年 3 月 31 日	2018年 4 月 12 日	新股流通受限	19.81	39.79	7, 980	158, 083.80	317, 524.20	-
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	-
002466	天齐锂业	2017年 12 月 26 日	2018年 1 月 3 日	配股流通受限	11.06	53.21	255	2, 820.30	13, 568.55	-

注:基金司作为特定投资者,认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份,所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2017年 10 月 31 日	重大事项停牌	31.76	2018年 1 月 8 日	30.15	130, 800	3, 605, 971.64	4, 154, 208.00	-
600309	万华化学	2017年 12 月 5 日	重大事项停牌	37.68	-	-	42, 820	1, 233, 231.70	1, 613, 457.60	-
600525	长园集团	2017年 12 月 25 日	重大事项停牌	15.51	2018年 1 月 10 日	17.30	43, 200	715, 630.80	670, 032.00	-
601600	中国铝业	2017年 9 月 12 日	重大事项停牌	6.67	2018年 2 月 26 日	7.28	53, 700	424, 988.00	358, 179.00	-
300116	坚瑞沃能	2017年 12 月 18 日	重大事项停牌	7.65	-	-	29, 600	235, 655.00