景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015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：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2015年8月29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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
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2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城沪深300指数增强
场内简称	无
基金主代码	000311
交易代码	000311
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	373,479,935.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	1.资产配置策略:本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的90%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将资持各类资产配置的基本稳定，在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 2.股票投资策略:本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 3.债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资，通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期，进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 4.权证、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数成形的指数成分股，备选成分股相关的衍生工具。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、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 5.中小企业私募债券的投资策略: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，本基金会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。
业绩比较基准	95%×沪深300 指数收益率+1.5× 银年收益率，评价时按期间折算).
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨峥阳	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金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

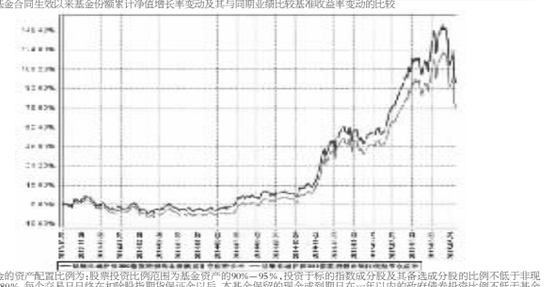
金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	288,219,814.47
本期利润	281,163,114.01
加权平均基金份额本期利润	0.5741
本期基金份额净值增长率	32.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.8103
期末基金资产净值	781,115,408.44
期末基金份额净值	2.091

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	-6.11%	3.24%	-7.06%	3.32%	0.95%	-0.08%
过去三个月	13.03%	2.49%	10.38%	2.48%	2.65%	0.01%
过去六个月	32.76%	2.13%	26.21%	2.15%	6.55%	-0.02%
过去一年	115.79%	1.75%	102.62%	1.75%	13.17%	0.00%
自基金合同生效起至今	109.10%	1.50%	88.20%	1.50%	20.90%	0.00%

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:股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2013年10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。

§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1.亿元人民币，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。
截止2015年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理46只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城稳健基建股票型证券投资基金、景顺长城小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中型股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、景顺长城品质保证股票型证券投资基金、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5年全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、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城银islamic开放式证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业股票型证券投资基金、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、景顺长城研究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、景顺长城景丰官市场基金、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、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、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城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股票证券投资基金、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，即通过整个投资流程产生体人员的共同努力，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(协理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
黎海威	景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金经理；量化及ETF投资部投资总监	2013年10月29日	-	12	经济学硕士，CFA，曾担任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）量化投资，主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司(海通国际投资管理有限公司)量化总监。2012年8月加入本公司，担任量化及ETF投资部投资总监；自2013年10月起担任基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理，其"任职日期"按基金合同生效日填写，"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日)；对此后的非首任基金经理，"任职日期"指根据公司决定聘任后的公告日期，"离任日期"指根据公司决定的解聘日期(公告前一日)；
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城沪深300指数增强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
本基金于本报告期内未发现异常交易行为。
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1次，为公司旗下景顺长城量化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。
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
2015年上半年经济数据略微好转，PMI数据小幅好转，但经济依然缺乏增长动力，投资增速进一步下滑，进出口数据不佳，消费数据疲软，基建和房地产投资增速表现较差，通胀小幅回升，但仍在可控范围内。
上半年央行数次进行降准降息托底经济，并通过公开市场操作宽松资金面，资金利率回落至近年低点。与此同时，股票市场的波动性变大，进入6月份后，调整幅度加大。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2015年上半年，本基金份额净值增长率为32.76%，高于业绩比较基准收益率6.55%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望未来，经济增长动能依然不足，经济结构依然需要调整，但随着政府在财政政策、货币政策等方面的放松，将对短期经济起到一定的支持作用。
我们坚持在风险可控的前提下以量化基本面选股为主来产生超额收益，并在各类因子之间，尤其是在成长和价值之间进行了平衡的配置。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。
估值小组成员包括公司投资、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。
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，基金托管人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帐目的核对同时进行。
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小组的运作，对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员负责其方面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、行业发展及个股状况等各方面因素，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小组提出有关估值方法或估值模型的建议，风险管理人员根据投资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小组，估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组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，并对有关信息披露文件进行合规性审查。
基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。
2.基金经理参与或决定估值的程度
基金经理需要时出席估值小组会议，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，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。
3.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突
估值小组要求基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。
本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。
4.已签约的任何定价服务的性质与程度
本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。
本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。
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。
截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——景顺长城基金管理有限公司2015年1月1日至2015年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。
5.3 托管人对本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
本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体：景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金
报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产：			
银行存款		79,115,319.34	60,761,002.65
结算备付金		824,127.44	584,736.51
存出保证金		470,144.34	79,004.10
交易性金融资产		680,837,930.30	510,692,538.13
其中：股票投资		680,837,930.30	510,692,538.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		10,152.36	7,947.33
应收股利		-	-
应收申购款		108,167,043.87	34,144,345.16
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		869,424,717.65	606,269,573.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		41,391,640.30	32,267,309.10
应付赎回款		44,296,069.60	21,722,252.97
应付管理人报酬		687,595.36	279,585.11
应付托管费		137,519.08	55,917.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,403,506.83	599,494.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		392,978.04	282,495.78
负债合计		88,309,309.21	55,207,054.87
所有者权益：			
实收基金		373,479,935.87	349,773,069.67
未分配利润		407,635,472.57	201,289,449.34
所有者权益合计		781,115,408.44	551,062,519.01
负债和所有者权益总计		869,424,717.65	606,269,573.88

注:报告截止日2015年6月30日，基金份额净值2.091元，基金份额总额373,479,935.87份。

6.2 利润表
会计主体：景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		291,621,674.77	-13,293,145.78
1.利息收入		281,176.97	83,012.92
其中：存款利息收入		281,176.97	83,012.92
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)		295,141,529.86	-4,857,557.78
其中：股票投资收益		288,512,437.76	-8,864,287.69
基金投资收益		-	-
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		6,629,092.10	4,006,729.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-7,056,700.46	-8,735,938.58
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,255,668.40	217,337.66
减：二、费用		10,458,560.76	3,719,145.43
1.管理人报酬		4,535,435.51	1,501,660.07
2.托管费		907,087.11	300,332.03
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		4,729,798.21	1,638,293.84
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		286,239.93	278,859.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		281,163,114.01	-17,012,291.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		281,163,114.01	-17,012,291.21

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金
本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	349,773,069.67	201,289,449.34	551,062,519.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	281,163,114.01	281,163,114.01
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)	23,706,866.20	-74,817,090.78	-51,110,224.58
其中：1.基金申购款	1,398,662,362.16	1,173,010,670.55	2,571,673,032.71
2.基金赎回款	-1,374,955,495.96	-1,247,827,761.33	-2,622,783,257.29
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)	373,479,935.87	407,635,472.57	781,115,408.44
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	394,320,063.81	7,459,154.35	401,779,218.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,012,291.21	-17,012,291.21
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)	-131,774,690.50	1,381,546.67	-130,393,143.83
其中：1.基金申购款	44,996,147.76	-1,523,839.36	43,472,308.40
2.基金赎回款	-176,770,838.26	2,905,386.03	-173,865,452.23
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)	262,545,373.31	-8,171,590.19	254,373,783.12

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：
_____许文明_____ _____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
景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金(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[2013]1028号文《关于核准景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金募集的批复》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《景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人于2013年9月23日至2013年10月25日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第60467014_H04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2013年10月29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381,986,684.48元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币155,294.37元，以上实收基金(本息)合计为人民币382,141,978.85元，折合382,141,978.85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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。(以下简称"中国农业银行")
本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、回购协议、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例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保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+1.5%(指年收益率，评价时按期间折算)。
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》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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
本基金2015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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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与最近一期年度报告相一致，会计估计变更的说明参见6.4.5.2。
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
根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的规定，自2015年3月24日起，本基金持有的交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。
6.4.5.3 差错更正的说明
无。
6.4.6 税项
6.4.6.1 印花税
证券(股票)交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。
股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。
6.4.6.2 营业税、企业所得税
以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征收营业税。
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。
股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。
6.4.6.3 个人所得税
个人所得税税率为20%。
基金取得的股息、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已扣代缴个人所得税。
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，减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，减按25%计入应纳税所得额。
股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。
暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。
6.4.7 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、注册登记人、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司("长城证券")	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	14,014,808.35	0.46%	-	-

6.4.8.1.2 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。
6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金
金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	12,759.12	0.46%	8,466.65	0.60%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。
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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,535,435.51	1,501,660.07
其中：支付销售机构的客户维护费	1,746,582.83	522,832.23

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提，计算方法如下：
H=E×1.00%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	907,087.11	300,332.03

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提，计算方法如下：
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
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
本基金基金管理人于本期及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
本基金的其他关联方于本期末和上年度末未持有本基金份额。
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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国农业银行	79,115,319.34	247,107.70	18,201,089.20	74,970.46

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。
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。
6.4.9 期末(2015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
本基金本于期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。
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
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	71.48	2015年8月5日	69.20	58,187	3,517,332.97	4,159,206.76	-
600886	国投电力	2015年6月24日	重大事项	14.87	-	-	221,562	2,265,217.54	3,294,626.94	-
601111	中国国航	2015年6月30日	重大事项	15.36	2015年7月29日	13.78	174,589	1,607,055.30	2,681,687.04	-
002320	海峡股份	2015年6月26日	重大事项	27.43	-	-	64,046	1,068,095.13	1,756,781.78	-
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项	17.51	-	-	93,753	1,572,673.65	1,641,615.03	-
002238	天威视讯	2015年6月29日	重大事项	23.76	-	-	36,534	698,531.69	868,047.84	-
002557	洽洽食品	2015年6月29日	重大事项	16.38	2015年8月24日	14.