

# 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF） 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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。

安永华明会计师事务所（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 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 基金简称         | 景顺长城鼎益股票（LOF）      |
| 场内简称         | 景顺鼎益               |
| 基金主代码        | 162605             |
| 前端交易代码       | 162605             |
| 后端交易代码       | 162606             |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式（LOF）      |
| 基金合同生效日      | 2005 年 3 月 16 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   | 3,522,748,081.65 份 |
| 基金合同存续期      | 不定期                |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所            |
| 上市日期         | 2005-05-25         |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。   |
| 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，并运用景顺长城股票研究数据库（SRD）及 GVI 等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时，本基金运用多因素模型等分析工具，结合基金管理人的主观判断，根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。 |
| 业绩比较基准 | 富时中国 A200 指数×80%+同业存款利率×20%。   |
| 风险收益特征 | 本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。  |

### 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       | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨皞阳                | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 0755-82370388      | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | investor@igwfm.com | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4008888606         | 95566                |
| 传真      |      | 0755-22381339      | 010-66594942         |

### 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.igwfm.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 | 2014 年           | 2013 年           | 2012 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 166,964,885.96   | 1,079,602,896.19 | -688,496,135.18  |
| 本期利润          | 379,892,056.58   | 1,052,058,801.88 | 297,551,705.06   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0893           | 0.2069           | 0.0533           |
| 本期基金份额净值增长率   | 10.46%           | 23.31%           | 6.69%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末          | 2013 年末          | 2012 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1360          | -0.1832          | -0.3975          |
| 期末基金资产净值      | 4,054,340,811.66 | 4,836,695,281.04 | 4,587,085,069.10 |
| 期末基金份额净值      | 1.151            | 1.042            | 0.845            |

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。

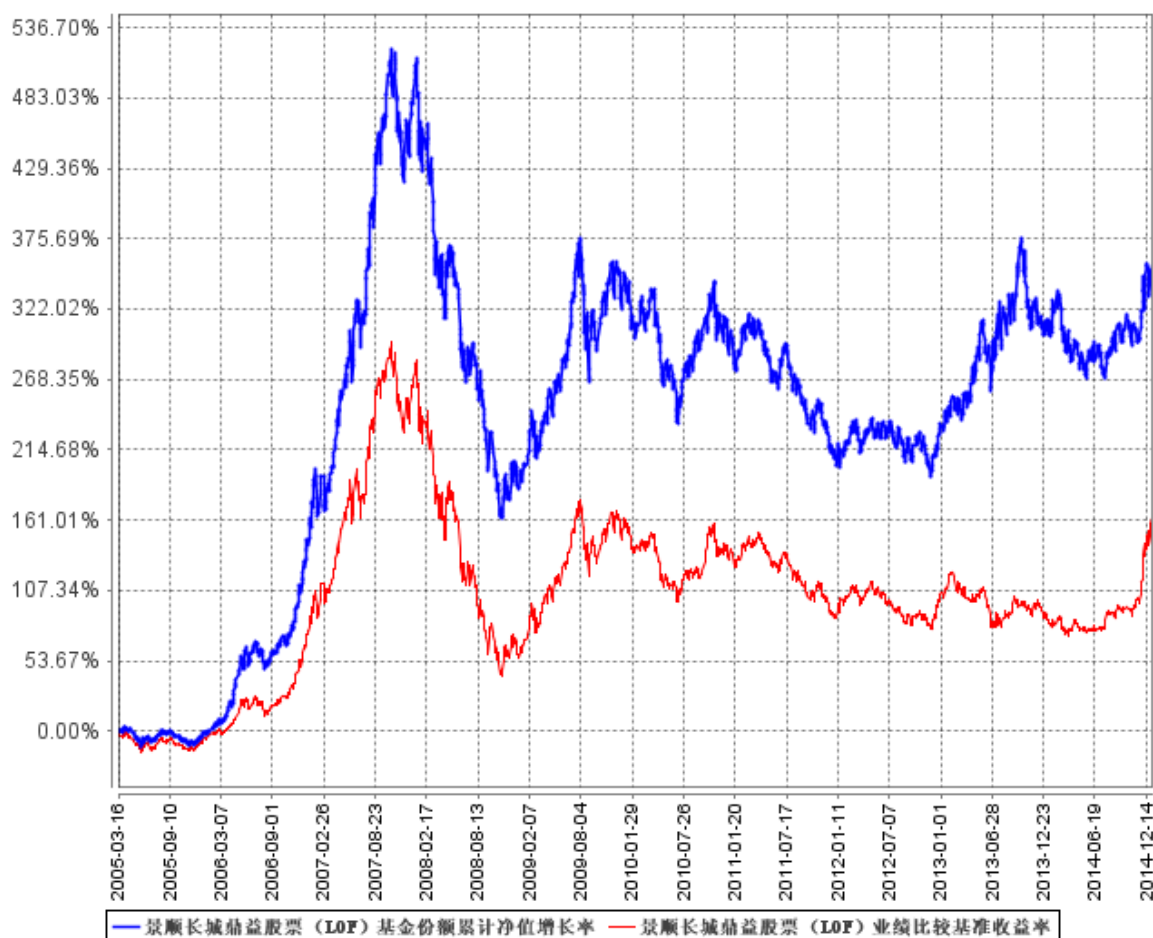
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

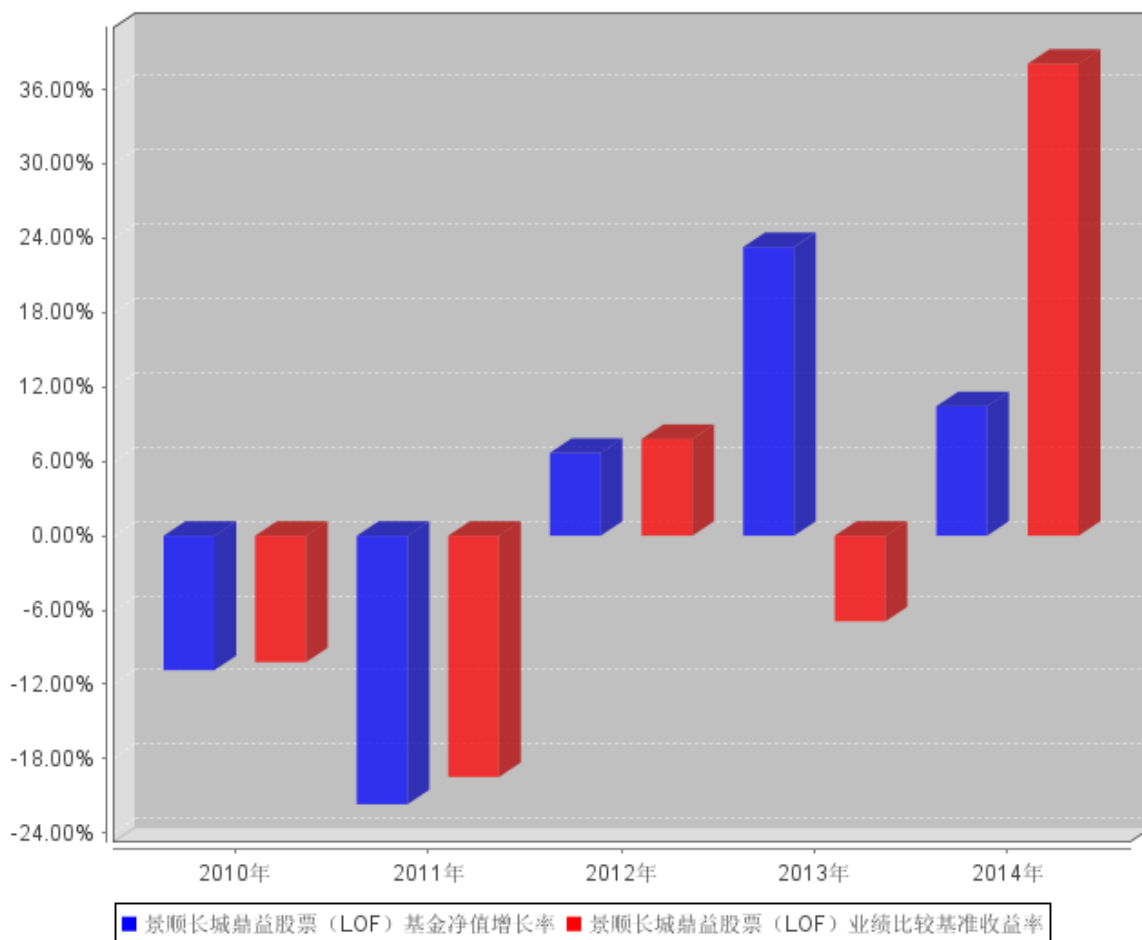
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 11.21%   | 1.45%       | 35.96%     | 1.39%         | -24.75% | 0.06% |
| 过去六个月      | 15.56%   | 1.21%       | 47.27%     | 1.11%         | -31.71% | 0.10% |
| 过去一年       | 10.46%   | 1.18%       | 38.10%     | 0.99%         | -27.64% | 0.19% |
| 过去三年       | 45.33%   | 1.30%       | 38.60%     | 1.04%         | 6.73%   | 0.26% |
| 过去五年       | 1.50%    | 1.28%       | 0.23%      | 1.08%         | 1.27%   | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 356.07%  | 1.48%       | 162.89%    | 1.43%         | 193.18% | 0.05% |

### 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：对于股票的投资不少于基金财产的 60%；持有现金和到期日在 1 年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2005 年 3 月 16 日合同生效日起至 2005 年 6 月 15 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 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、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。

截止2014年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理39只开放式基金，包括管

理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、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（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、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中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、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、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（ETF）、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、景顺长城品质投资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（ETF）、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置型证券投资基金、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（ETF）、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。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 |        |  |
| 张继荣 | 景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理，景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金），景顺长城优 | 2009 年 9 月 19 日 | -    | 14     | 工学博士。曾担任大鹏证券行业分析师，融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理，银华基金投资管理部策略分析师、基金经理等职务。2009 年 3 月加入本公司，自 2009 年 8 月起担任基金经理。 |

|  |                        |  |  |  |  |
|--|------------------------|--|--|--|--|
|  | 质成长股票型证券投资基金基金经理，研究部总监 |  |  |  |  |
|--|------------------------|--|--|--|--|

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、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）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

所有投资对象的交易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，未发现异常交易情况。

## 4.3.3 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。

## 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

2014 年上证指数累计上涨 52.87%，创下 5 年来的最佳表现；深成指上涨 35.62%。而创业板

指、中小板指显出疲态，分别上涨了 12.83%和 9.67%。在下半年的这波蓝筹行情中，大盘蓝筹股的表现要比中小盘题材股出色许多，其中上证 50 指数上涨了 63.93%。股市大幅上涨的原因有很多，最为重要原因有两个。一是中国股市的估值很低，蓝筹股经过了持续多年的估值下行后，其所隐含的投资收益率和分红收益率相对债券、理财产品、货币基金等具有明显的吸引力。二是有明显的增量资金进入股市。居民的资产重新分配，部分进入股市；迅猛增长的融资资金放大赚钱效应；以及沪港通和保险等资金持续增加。

本基金在市场大幅波动的过程中结构调整过慢，中小市值股票的配置较重，没能跑赢基准。本基金 2014 年主要配置地产、家电、TMT、保险等行业，下半年增加了部分保险和公用事业的配置，减少了 TMT 和医药等的配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年度，本基金份额净值增长率为 10.46%，低于业绩比较基准收益率 27.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年中国经济仍处于逐步寻底的过程中，伴随实体经济需求的回落、刚性兑付的逐渐打破，货币政策将继续保持适当宽松的状态，国内无风险利率仍有一定下行空间，对资本市场估值提升有利。我们认为居民、沪港通和保险资金流入股市的过程还将继续，股票市场对投资者的吸引力在不断增加。

我们认为低估值的金融、地产、家电、汽车等行业价值重估过程仍没有结束，但是经过短期快速上涨以后，部分行业的估值水平已明显超过过去 5 年的平均水平，需要一定时间去消化。2015 年国企改革、一路一带、互联网化、信息安全等符合国家战略发展方向的主题投资都有较好的表现机会。经过 2014 年第四季度极端的行情后，部分优质成长股已经具有明显的吸引力，业绩增速预期 30%-50%，2015 年预期估值 25 倍左右，且市场空间仍然看不到天花板，本基金将继续精选这类股票。

#### 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片、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账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。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

基金经理在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

估值小组秉承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。

## 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，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

#### 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”）在景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

本报告期内，安永华明会计师事务所（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：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|----|-----|--------------------|---------------------|
|----|-----|--------------------|---------------------|

|                 |  |                    |                    |
|-----------------|--|--------------------|--------------------|
| <b>资产：</b>      |  |                    |                    |
| 银行存款            |  | 159,050,620.86     | 79,431,740.77      |
| 结算备付金           |  | 8,522,113.74       | 7,839,414.85       |
| 存出保证金           |  | 1,343,242.51       | 1,651,710.63       |
| 交易性金融资产         |  | 3,866,257,117.27   | 4,179,219,380.01   |
| 其中：股票投资         |  | 3,816,227,117.27   | 3,880,714,380.01   |
| 基金投资            |  | -                  | -                  |
| 债券投资            |  | 50,030,000.00      | 298,505,000.00     |
| 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        |  | -                  | 599,000,348.50     |
| 应收证券清算款         |  | 46,847,376.43      | 12,714,235.77      |
| 应收利息            |  | 2,309,510.02       | 5,346,587.43       |
| 应收股利            |  | -                  | -                  |
| 应收申购款           |  | 28,484.73          | 40,674.73          |
| 递延所得税资产         |  | -                  | -                  |
| 其他资产            |  | -                  | -                  |
| 资产总计            |  | 4,084,358,465.56   | 4,885,244,092.69   |
| <b>负债和所有者权益</b> |  | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 |  | <b>2014年12月31日</b> | <b>2013年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |  |                    |                    |
| 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         |  | -                  | 31,384,747.50      |
| 应付赎回款           |  | 18,992,393.48      | 4,286,957.75       |
| 应付管理人报酬         |  | 5,190,015.85       | 6,182,165.09       |
| 应付托管费           |  | 865,002.65         | 1,030,360.85       |
| 应付销售服务费         |  | -                  | -                  |
| 应付交易费用          |  | 4,739,769.73       | 5,430,670.17       |
| 应交税费            |  | 8,092.80           | 8,092.80           |
| 应付利息            |  | -                  | -                  |
| 应付利润            |  | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         |  | -                  | -                  |
| 其他负债            |  | 222,379.39         | 225,817.49         |
| 负债合计            |  | 30,017,653.90      | 48,548,811.65      |
| <b>所有者权益：</b>   |  |                    |                    |
| 实收基金            |  | 3,522,748,081.65   | 4,643,942,276.93   |
| 未分配利润           |  | 531,592,730.01     | 192,753,004.11     |
| 所有者权益合计         |  | 4,054,340,811.66   | 4,836,695,281.04   |
| 负债和所有者权益总计      |  | 4,084,358,465.56   | 4,885,244,092.69   |

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.151 元，基金份额总额 3,522,748,081.65 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-----|---|--|
| <b>一、收入</b>                |     | 480,499,758.40                            | 1,180,614,411.65                               |
| 1. 利息收入                    |     | 14,837,968.27                             | 11,643,504.03                                  |
| 其中：存款利息收入                  |     | 3,748,724.37                              | 4,000,826.41                                   |
| 债券利息收入                     |     | 6,112,750.32                              | 2,882,816.48                                   |
| 资产支持证券利息收入                 |     | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |     | 4,976,493.58                              | 4,759,861.14                                   |
| 其他利息收入                     |     | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |     | 252,635,980.29                            | 1,196,109,670.19                               |
| 其中：股票投资收益                  |     | 216,166,246.96                            | 1,172,000,206.96                               |
| 基金投资收益                     |     | -   | -  |
| 债券投资收益                     |     | 1,548,200.00                              | 1,645,960.00                                   |
| 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                       |     | 34,921,533.33                             | 22,463,503.23                                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |     | 212,927,170.62                            | -27,544,094.31                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |     | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         |     | 98,639.22                                 | 405,331.74                                     |
| <b>减：二、费用</b>              |     | 100,607,701.82                            | 128,555,609.77                                 |
| 1. 管理人报酬                   |     | 64,733,544.79                             | 75,530,217.91                                  |
| 2. 托管费                     |     | 10,788,924.09                             | 12,588,369.58                                  |
| 3. 销售服务费                   |     | -   | -  |
| 4. 交易费用                    |     | 24,526,356.89                             | 39,893,957.50                                  |
| 5. 利息支出                    |     | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |     | -   | -  |
| 6. 其他费用                    |     | 558,876.05                                | 543,064.78                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |     | 379,892,056.58                            | 1,052,058,801.88                               |
| 减：所得税费用                    |     | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>     |     | 379,892,056.58                            | 1,052,058,801.88                               |

|    |  |  |  |
|----|--|--|--|
| 列) |  |  |  |
|----|--|--|--|

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 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）                        | 4,643,942,276.93                            | 192,753,004.11   | 4,836,695,281.04  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 379,892,056.58   | 379,892,056.58    |
| 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）      | -1,121,194,195.28                           | -41,052,330.68   | -1,162,246,525.96 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 64,956,617.21                               | 1,794,918.12     | 66,751,535.33     |
| 2. 基金赎回款                               | -1,186,150,812.49                           | -42,847,248.80   | -1,228,998,061.29 |
| 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）                        | 3,522,748,081.65                            | 531,592,730.01   | 4,054,340,811.66  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 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）                        | 5,425,776,037.84                            | -838,690,968.74  | 4,587,085,069.10  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 1,052,058,801.88 | 1,052,058,801.88  |
| 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）      | -781,833,760.91                             | -20,614,829.03   | -802,448,589.94   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 108,506,644.87                              | 10,179,512.77    | 118,686,157.64    |
| 2. 基金赎回款                               | -890,340,405.78                             | -30,794,341.80   | -921,134,747.58   |
| 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) | 4,643,942,276.93 | 192,753,004.11 | 4,836,695,281.04 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 许义明 \_\_\_\_\_
\_\_\_\_\_ 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2005]7 号文《关于同意景顺长城鼎益股票型开放式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作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 3 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 445,627,301.07 份基金份额。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A200 指数\*80%+同业存款利率\*20%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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>》及其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定或修订了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》和《企



业会计准则第 30 号——财务报表列报》等 7 项会计准则；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### 7.4.3 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 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。

#### 7.4.6.2 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。

### 7.4.6.3 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。

### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称              | 与本基金的关系        |
|--------------------|----------------|
| 景顺长城基金管理有限公司       | 基金管理人、基金销售机构   |
| 中国银行               | 基金托管人、基金销售机构   |
| 长城证券有限责任公司（“长城证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 景顺资产管理有限公司         | 基金管理人股东        |
| 开滦(集团)有限责任公司       | 基金管理人股东        |
| 大连实德集团有限公司         | 基金管理人股东        |
| 景顺长城资产管理（深圳）有限公司   | 基金管理人的子公司      |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                      | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |                      |
|-------|--|----------------------|---|----------------------|
|       | 成交金额                                   | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额  | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 长城证券  | 1,880,720,977.15                       | 11.82%               | 4,041,853,092.58                            | 15.65%               |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金于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。

**7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日      |                |              |                  |
|-------|----------------------------------|----------------|--------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 1,712,210.49                     | 11.82%         | 473,048.28   | 10.00%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |                |              |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 长城证券  | 3,669,848.68                     | 15.66%         | 1,089,362.87 | 20.12%           |

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。

**7.4.8.2 关联方报酬****7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的管理费                  | 64,733,544.79                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 14,065,962.65                   | 16,427,974.02                        |

注：1) 基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

2) 于 2014 年 12 月 31 日，应付基金管理费的金额为人民币 5,190,015.85 元（2013 年 12 月 31 日，应付基金管理费的金额为人民币 6,182,165.09 元。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>12月31日 |
|----|---------------------------------|--------------------------------------|
|    | 当期发生的基金应支付的托管费                  | 10,788,924.09                        |

注：1) 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

2) 于 2014 年 12 月 31 日，应付基金托管费的金额为人民币 865,002.65 元（2013 年 12 月 31 日：应付基金托管费的金额为人民币 1,030,360.85 元。

#### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日      |               |      |       |      |       |      |
|---|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易<br>的各关联方名称                          | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|   | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国银行  | -             | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易<br>的各关联方名称                          | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|   | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 中国银行  | 50,387,289.04 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 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期及上年度可比期间均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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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<br>名称 | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |              |
|-----------|--|--------------|---|--------------|
|           | 期末余额                                   | 当期利息收入       | 期末余额  | 当期利息收入       |
| 中国银行      | 159,050,620.86                         | 3,556,366.25 | 79,431,740.77                               | 3,808,013.73 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.9 期末（2014 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 600077               | 宋都股份 | 2014 年 12 月 30 日 | 2015 年 12 月 28 日 | 非公开发行  | 4.75 | 4.76   | 15,157,894 | 71,999,996.50 | 72,151,575.44 | -  |

##### 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 |
|--------|------|------------------|------|--------|-----------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 300071 | 华谊嘉信 | 2014 年 12 月 29 日 | 重大事项 | 16.40  | 2015 年 1 月 30 日 | 16.00  | 2,000,000 | 17,085,737.57 | 32,800,000.00 | -  |

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层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。

#### 各层次金融工具公允价值

于 2014 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 3,711,275,541.83 元，划分为第二层次的余额为人民币 154,981,575.44 元，无划分为第三层次的余额（于 2013 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 3,515,425,584.81 元，划分为第二层次的余额为人民币 663,793,795.20 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。

对于特殊事项停牌的股票，本基金从进行估值调整之日起将相关股票公允价值所属层次从第一层次转入第二层次，于股票复牌并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃的情况，本基金根据估值调整中输入值的可观察性和重要性以及对公允价值的影响程度，于本报告期内将相关债券的公允价值从第一层次转入至第二层次。如上述影响因素消失，债券公允价值则从第二层次转入至第一层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金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。

### 7.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目    | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资  | 3,816,227,117.27 | 93.44         |
|    | 其中：股票 | 3,816,227,117.27 | 93.44         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | 50,030,000.00    | 1.22   |
|   | 其中：债券             | 50,030,000.00    | 1.22   |
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -                | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 167,572,734.60   | 4.10   |
| 7 | 其他各项资产            | 50,528,613.69    | 1.24   |
| 8 | 合计                | 4,084,358,465.56 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -            |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,231,551,220.32 | 30.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 183,007,466.58   | 4.51         |
| E  | 建筑业              | 285,805,229.10   | 7.05         |
| F  | 批发和零售业           | 106,661,648.59   | 2.63         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 251,624,948.82   | 6.21         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 384,890,640.30   | 9.49         |
| J  | 金融业              | 417,493,371.93   | 10.30        |
| K  | 房地产业             | 751,329,049.70   | 18.53        |
| L  | 租赁和商务服务业         | 116,561,265.28   | 2.87         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 31,770.00        | 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        | 87,270,506.65    | 2.15         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 3,816,227,117.27 | 94.13        |

### 8.3 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  | 601318 | 中国平安 | 3,519,958  | 262,976,062.18 | 6.49         |
| 2  | 600340 | 华夏幸福 | 5,045,506  | 219,984,061.60 | 5.43         |
| 3  | 000002 | 万科A  | 15,502,049 | 215,478,481.10 | 5.31         |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 6,812,297  | 186,929,429.68 | 4.61         |
| 5  | 600674 | 川投能源 | 8,828,146  | 183,007,466.58 | 4.51         |
| 6  | 002415 | 海康威视 | 7,541,515  | 168,703,690.55 | 4.16         |
| 7  | 601628 | 中国人寿 | 4,524,665  | 154,517,309.75 | 3.81         |
| 8  | 300020 | 银江股份 | 5,313,105  | 146,482,304.85 | 3.61         |
| 9  | 000039 | 中集集团 | 6,621,141  | 144,936,776.49 | 3.57         |
| 10 | 000090 | 天健集团 | 10,431,160 | 143,950,008.00 | 3.55         |

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年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 328,615,180.03 | 6.79           |
| 2  | 300017 | 网宿科技 | 225,781,388.14 | 4.67           |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 198,739,099.36 | 4.11           |
| 4  | 000402 | 金融街  | 186,960,262.18 | 3.87           |
| 5  | 300020 | 银江股份 | 179,858,592.19 | 3.72           |
| 6  | 600373 | 中文传媒 | 157,009,464.08 | 3.25           |
| 7  | 002285 | 世联行  | 147,124,932.43 | 3.04           |
| 8  | 600549 | 厦门钨业 | 146,360,320.51 | 3.03           |
| 9  | 600340 | 华夏幸福 | 145,366,955.25 | 3.01           |
| 10 | 000002 | 万科A  | 142,598,765.03 | 2.95           |
| 11 | 600674 | 川投能源 | 138,999,292.15 | 2.87           |
| 12 | 300043 | 互动娱乐 | 135,883,516.95 | 2.81           |
| 13 | 000090 | 天健集团 | 128,589,256.20 | 2.66           |



|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 14 | 300212 | 易华录  | 117,731,029.03 | 2.43 |
| 15 | 601628 | 中国人寿 | 116,704,724.89 | 2.41 |
| 16 | 000039 | 中集集团 | 115,926,347.71 | 2.40 |
| 17 | 600703 | 三安光电 | 115,253,554.48 | 2.38 |
| 18 | 600026 | 中海发展 | 115,182,254.93 | 2.38 |
| 19 | 600594 | 益佰制药 | 114,448,913.46 | 2.37 |
| 20 | 002038 | 双鹭药业 | 114,008,956.03 | 2.36 |
| 21 | 600030 | 中信证券 | 102,632,246.72 | 2.12 |
| 22 | 601098 | 中南传媒 | 101,289,463.92 | 2.09 |
| 23 | 000541 | 佛山照明 | 98,860,091.14  | 2.04 |
| 24 | 002400 | 省广股份 | 98,840,836.61  | 2.04 |

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额       | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 293,620,883.43 | 6.07           |
| 2  | 300017 | 网宿科技 | 238,430,910.33 | 4.93           |
| 3  | 300168 | 万达信息 | 225,086,206.74 | 4.65           |
| 4  | 300002 | 神州泰岳 | 200,669,955.09 | 4.15           |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 189,101,000.37 | 3.91           |
| 6  | 300026 | 红日药业 | 165,506,106.55 | 3.42           |
| 7  | 600373 | 中文传媒 | 161,983,342.34 | 3.35           |
| 8  | 002456 | 欧菲光  | 161,973,724.84 | 3.35           |
| 9  | 300070 | 碧水源  | 146,937,907.85 | 3.04           |
| 10 | 600549 | 厦门钨业 | 144,701,196.35 | 2.99           |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 144,292,703.02 | 2.98           |
| 12 | 000402 | 金融街  | 137,015,408.20 | 2.83           |
| 13 | 002570 | 贝因美  | 135,007,542.57 | 2.79           |
| 14 | 000651 | 格力电器 | 131,617,907.50 | 2.72           |
| 15 | 002038 | 双鹭药业 | 131,504,914.50 | 2.72           |
| 16 | 000671 | 阳光城  | 129,561,543.24 | 2.68           |
| 17 | 000333 | 美的集团 | 128,050,954.46 | 2.65           |
| 18 | 600690 | 青岛海尔 | 120,055,269.67 | 2.48           |
| 19 | 002375 | 亚厦股份 | 119,738,586.17 | 2.48           |
| 20 | 002305 | 南国置业 | 118,024,026.76 | 2.44           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 21 | 000776 | 广发证券 | 113,743,448.54 | 2.35 |
| 22 | 600585 | 海螺水泥 | 113,650,635.30 | 2.35 |
| 23 | 000541 | 佛山照明 | 109,239,850.25 | 2.26 |
| 24 | 600406 | 国电南瑞 | 108,413,566.93 | 2.24 |
| 25 | 600741 | 华域汽车 | 107,571,006.02 | 2.22 |
| 26 | 600594 | 益佰制药 | 106,263,171.35 | 2.20 |
| 27 | 600030 | 中信证券 | 98,634,634.34  | 2.04 |
| 28 | 000831 | 五矿稀土 | 97,483,384.21  | 2.02 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 7,748,603,173.21 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,242,386,203.53 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 50,030,000.00 | 1.23         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,030,000.00 | 1.23         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | -             | -            |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 50,030,000.00 | 1.23         |

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 140404 | 14 农发 04 | 500,000 | 50,030,000.00 | 1.23         |

## 8.7 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。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

1、中国平安保险（集团）股份有限公司（下称“中国平安”，股票代码：601318）控股子公司平安证券因其推荐海联讯 IPO 的过程中，出具的保荐书存在虚假记载以及未审慎审查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性，于 2014 年 12 月 8 日收到《中国证监会行政处罚决定书》。该处罚决定书对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2867 万元，并处以 440 万元罚款。

本基金投研人员认为：中国平安子公司平安证券受到行政处罚，体现出其原有业务流程存在一定的瑕疵。但是经过内部整改，我们预计其流程管理已经有所完善。而且中国平安作为综合金融的上市公司，其子公司平安证券只是其中一个业务板块，对整个上市公司的经营影响有限，

并不影响对中国平安具备投资价值的判断。

本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中国平安进行了投资。

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。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,343,242.51  |
| 2  | 应收证券清算款 | 46,847,376.43 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 2,309,510.02  |
| 5  | 应收申购款   | 28,484.73     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 50,528,613.69 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 186,132      | 18,926.07     | 6,968,491.46 | 0.20%      | 3,515,779,590.19 | 99.80%     |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份）    | 占上市总份额比例 |
|----|-------|------------|----------|
| 1  | 张萍    | 500,747.00 | 0.78%    |
| 2  | 李喜仪   | 460,000.00 | 0.71%    |
| 3  | 张爱招   | 425,100.00 | 0.66%    |
| 4  | 牟德武   | 387,465.00 | 0.60%    |
| 5  | 郭文飞   | 376,691.00 | 0.59%    |
| 6  | 王华安   | 367,946.00 | 0.57%    |
| 7  | 关少兰   | 317,200.00 | 0.49%    |
| 8  | 叶郁荪   | 278,000.00 | 0.43%    |
| 9  | 袁传智   | 255,771.00 | 0.40%    |
| 10 | 蔡雪琴   | 252,300.00 | 0.39%    |

注：持有人为场内持有人。

## 9.3 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 | 2,521.45  | 0.00%    |

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2005年3月16日）基金份额总额 | 445,627,301.07   |
| 本报告期期初基金份额总额              | 4,643,942,276.93 |
| 本报告期基金总申购份额               | 64,956,617.21    |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 1,186,150,812.49 |
| 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              | 3,522,748,081.65 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于 2014 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，聘任王鹏辉先生担任本公司副总经理。

2、本基金管理人于 2014 年 3 月 28 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，同意邓体顺先生辞去本公司副总经理一职。

3、本基金管理人于 2014 年 7 月 9 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，聘任周伟达先生担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2014 年 12 月 20 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，聘任康乐先生担任本公司副总经理。

5、本基金管理人于 2015 年 1 月 23 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，同意王鹏辉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。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。

6、2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任中国银行行长。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 10 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 110,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易              |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注  |
|--------------|--------|-------------------|--------------|--------------|------------|-----|
|              |        | 成交金额              | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |     |
| 长江证券股份有限公司   |        | 12,990,253,114.15 | 18.79%       | 2,722,331.60 | 18.79%     | 未变更 |
| 中信建投证券股份有限公司 |        | 22,923,642,036.54 | 18.37%       | 2,661,679.33 | 18.37%     | 未变更 |
| 海通证券股份有限公司   |        | 22,465,266,182.79 | 15.49%       | 2,244,378.29 | 15.49%     | 未变更 |
| 长城证券有限责任公司   |        | 21,880,720,977.15 | 11.82%       | 1,712,210.49 | 11.82%     | 未变更 |
| 中国国际金融有限公司   |        | 11,412,744,779.44 | 8.88%        | 1,286,162.35 | 8.88%      | 未变更 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1      | 810,505,168.09    | 5.09%        | 737,885.25   | 5.09%      | 未变更 |
| 招商证券股份有限公司   | 2      | 761,559,305.23    | 4.78%        | 693,323.30   | 4.78%      | 未变更 |
| 平安证券有限责任公司   | 1      | 565,035,145.27    | 3.55%        | 514,406.84   | 3.55%      | 新增  |
| 东兴证券股份有限公司   | 1      | 548,868,829.98    | 3.45%        | 499,688.63   | 3.45%      | 新增  |
| 华泰证券股份有限公司   | 1      | 451,296,130.53    | 2.84%        | 410,858.30   | 2.84%      | 未变更 |
| 东方证券股份有限公司   | 1      | 450,292,392.09    | 2.83%        | 409,945.45   | 2.83%      | 未变更 |
| 宏源证券股份有限公司   | 1      | 389,419,028.84    | 2.45%        | 354,529.49   | 2.45%      | 未变更 |
| 广发证券股份有限公司   | 1      | 267,753,600.95    | 1.68%        | 243,762.87   | 1.68%      | 未变更 |
| 英大证券有限责任公司   | 1      | -                 | -            | -            | -          | 未变更 |
| 浙商证券股份有限公司   | 1      | -                 | -            | -            | -          | 未变更 |

|              |   |   |   |   |   |    |
|--------------|---|---|---|---|---|----|
| 中航证券有限<br>公司 | 1 | - | - | - | - | 已退 |
|--------------|---|---|---|---|---|----|

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称             | 债券交易 |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------------------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|                  | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 长江证券股份<br>有限公司   | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信建投证券<br>股份有限公司 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 海通证券股份<br>有限公司   | -    | -            | 2,710,000,000.00 | 26.85%         | -    | -            |
| 长城证券有限<br>责任公司   | -    | -            | 4,122,400,000.00 | 40.85%         | -    | -            |
| 中国国际金融<br>有限公司   | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 招商证券股份<br>有限公司   | -    | -            | -                | -              | -    | -            |
| 平安证券有限           | -    | -            | 1,920,000,000.00 | 19.02%         | -    | -            |



|                |   |   |                  |        |   |   |
|----------------|---|---|------------------|--------|---|---|
| 责任公司           |   |   |                  |        |   |   |
| 东兴证券股份<br>有限公司 | - | - | 90,000,000.00    | 0.89%  | - | - |
| 华泰证券股份<br>有限公司 | - | - | 1,250,000,000.00 | 12.39% | - | - |
| 东方证券股份<br>有限公司 | - | - | -                | -      | - | - |
| 宏源证券股份<br>有限公司 | - | - | -                | -      | - | - |
| 广发证券股份<br>有限公司 | - | - | -                | -      | - | - |
| 英大证券有限<br>责任公司 | - | - | -                | -      | - | - |
| 浙商证券股份<br>有限公司 | - | - | -                | -      | - | - |
| 中航证券有限<br>公司   | - | - | -                | -      | - | - |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

景顺长城基金管理有限公司  
2015年3月31日