# 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 29 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商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。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**
1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3
**§2 基金简介 ..... 5**
2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6
**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7
**§4 管理人报告 ..... 8**
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 11
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 14
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 ..... 14
**§5 托管人报告 ..... 14**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 14
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 ..... 14
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 ..... 14
**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 15**
6.1 资产负债表 ..... 15
6.2 利润表 ..... 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 18
**§7 投资组合报告 ..... 36**
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 ..... 37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 ..... 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 40
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 ..... 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 40
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 ..... 41
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 ..... 41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 41
7.12 投资组合报告附注 ..... 41

**§8 基金份额持有人信息.....42**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....43
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.....43
**§9 开放式基金份额变动.....43**
**§10 重大事件揭示.....43**
10.1 基金份额持有人大会决议.....43
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.....43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....44
10.4 基金投资策略的改变.....44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....44
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.....44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....44
10.8 其他重大事件.....47
**§11 影响投资者决策的其他重要信息.....50**
**§12 备查文件目录.....50**
12.1 备查文件目录.....50
12.2 存放地点.....50
12.3 查阅方式.....50

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 景顺长城中国回报混合 |
| 场内简称 | 无 |
| 基金主代码 | 000772 |
| 交易代码 | 000772 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 6 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 | 2,702,529,191.26 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，寻求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的绝对回报。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略：本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。<br>2、股票投资策略：本基金挖掘受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票，通过定量和定性相结合的方法，通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出主题特征明显、成长性好的优质股票构建股票投资组合。本基金通过认真、细致的宏观研究、行业研究及个股研究，将推动中国经济发展的驱动力转化为基金持有人的长期投资收益。在股票投资方面，本基金利用基金管理人股票研究数据库（SRD）对企业内在价值进行深入细致的分析，并进一步挖掘出受益于中国经济发展趋势和投资主题的公司股票进行投资。<br>3、债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 |
| 业绩比较基准 | 1 年期银行定期存款利率（税后）+3%（单利年化） |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，属于中高预期收益和风险水平的投资品种，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 景顺长城基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | investor@igwfmc.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95588 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 赵如冰 | 姜建清 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.igwfmc.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

## 2.5 其他相关资料

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

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日 ) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 365,876,350.39 |
| 本期利润 | 356,506,042.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1384 |
| 本期加权平均净值利润率 | 12.16% |
| 本期基金份额净值增长率 | 15.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2015 年 6 月 30 日 ) |
| 期末可供分配利润 | 441,170,560.83 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1632 |

| | |
|---|---|
| 期末基金资产净值 | 3,227,181,911.59 |
| 期末基金份额净值 | 1.194 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（ 2015 年 6 月 30 日 ） |
| 基金份额累计净值增长率 | 19.40% |

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。

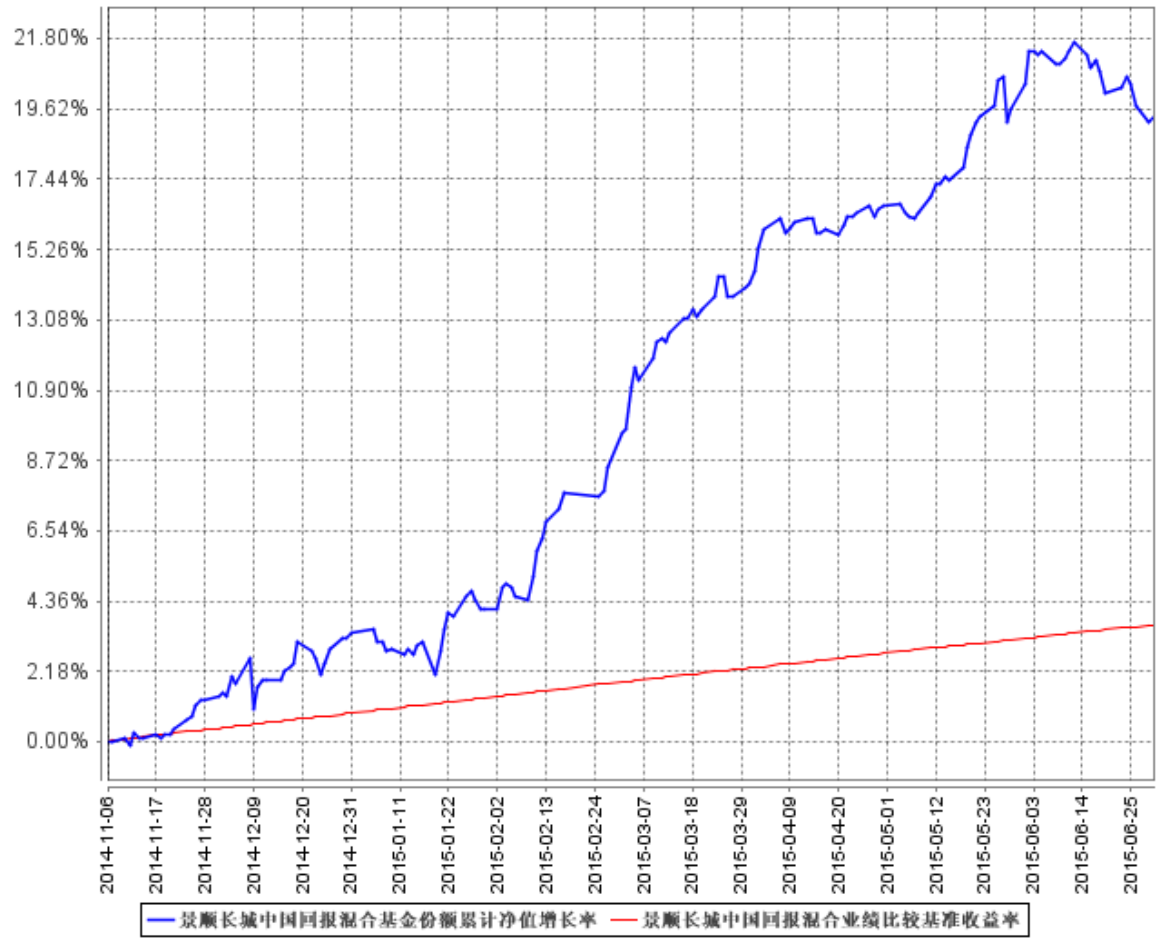
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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 | -0.17% | 0.37% | 0.44% | 0.01% | -0.61% | 0.36% |
| 过去三个月 | 4.55% | 0.33% | 1.30% | 0.01% | 3.25% | 0.32% |
| 过去六个月 | 15.47% | 0.37% | 2.71% | 0.02% | 12.76% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.40% | 0.37% | 3.62% | 0.02% | 15.78% | 0.35% |

### 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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2014 年 11 月 6 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。基金合同生效日（2014 年 11 月 6 日）起至本报告期末不满一年。

# §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、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。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 | 证券从 | 说明 |
|---|---|---|---|---|

| | | （助理）期限 | | 业年限 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 毛从容 | 景顺长城稳健回报灵活配置混合型基金、领先回报灵活配置混合型基金、中国回报灵活配置混合型基金、安享回报灵活配置混合型基金、鑫月薪定期支付债券型基金、景颐双利债券型基金、景丰货币市场基金、景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城货币市场基金），固定收益部投资总监 | 2015 年 3 月 28 日 | - | 15 | 经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金融研究所，着重于宏观和债券市场的研究，并担任金融研究所债券业务小组组长。2003 年 3 月加入本公司，担任研究员等职务；自 2005 年 6 月起担任基金经理。 |
| 刘晓明 | 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城成长之星股票型基金基金经理 | 2014 年 11 月 6 日 | - | 7 | 农学硕士。曾担任国元证券研究所研究员，第一创业证券研究所行业研究员。2011 年 6 月加入本公司，历任研究员、高级研究员职务；自 2014 年 11 月起担任基金经理。 |
| 王鹏辉 | 景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，副总经理 | 2014 年 11 月 6 日 | 2015 年 1 月 22 日 | 14 | 经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员。2007 年 3 月加入本公司，担任研究员等职务；自 2007 年 9 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；

3、王鹏辉先生于 2015 年 1 月 22 日离任景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理；

4、毛从容女士于 2015 年 4 月 2 日离任景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金基金经理。

## 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、《景顺长城中国回报灵活配置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 GDP 增速为 7%，比 2014 年同期回落 0.4 个百分点。其中工业增加值从 3 月最低的 5.6%，增速回升到 6 月的 6.8%。6 月固定资产投资增速累计同比是 11.4%，与 1-5 月持平，投资增速下滑态势得到抑制。1-6 月社会消费品零售总额累计同比 10.4%，较 2014 年同期有所下降，处于近十年的历史低位。经济数据呈现温和企稳态势，包括 PMI、工业增加值、固定资产投资、房地产开发投资等数据在 6 月份均有触底回升迹象。尽管猪肉价格持续上升，但 4、5 月份的 CPI 一直保持低位，通胀压力不大。社融与信贷增长仍旧低迷，显示信用扩张依旧不力。期间货币政策持续宽松，经过 3 次降息、3 次降准，但由于信用传导不畅，过多的流动性淤积在银行间市场，资金面非常宽松。央行 5 月中下旬重启定向正回购，货币政策基调已逐渐由前期的

总量放松逐渐转变为“锁短放长”和“定向放松”。受基本面和政策面的影响，债券收益率整体下行。短端下行幅度较大，长期利率因市场忧虑经济反弹及地方债供给压力，下行幅度较小。截止 2015 年 6 月末，与年初相比，1 年期国开债下行 117BP 至 2.78%，10 年期国开债为 4.1%与年初持平。信用债收益率及利差下行幅度较大，1 年期 AA 短融、3 年期 AA 中票、3 年期 AA 城投债分别下行 128BP、67BP 和 77BP 至 4.35%、5.00%和 5.08%。

在改革预期以及增量资金的推动下，A 股上半年从慢牛到加速上涨，6 月因获利盘较大以及监管层查杠杆资金的风险导致 A 股大幅下跌，期间沪深 300 指数上涨 26.6%，创业板指数上涨 64.3%。新股方面发行提速，由年初的每月发行至一个月两批新股发行，中签率明显下行，新股上市后涨幅仍然可观。

本基金是一只追求绝对回报的混合型基金，业绩基准为一年定期存款+3%。自成立以来，基金经理采取了较为审慎的投资策略，关注新股的投资机会，同时，自下而上选择了一些优质的高成长股，取得了超越比较基准的绝对收益。6 月中下旬市场大幅下跌波动加剧，从绝对收益角度减仓锁定收益。虽然与同期大盘涨幅有一定差距，但本基金定位为追求绝对回报，降低净值波动，严格控制回撤风险，力争在市场波动中获取稳健收益。

### 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 15.47%，高于业绩比较基准收益率 12.76%。

## 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 2015 年下半年，中国经济转型才开始，基本面处于筑底企稳的过程，通胀在年内应该不是风险因素。从稳增长角度政策短期内还将以偏宽松为主，考虑到美联储可能的加息未来我们降准的可能性较大。近期因监管风险和去杠杆风险导致的市场调整非常剧烈，风险已经明显释放，我们认为后续市场将进入以宽幅震荡为主要形式的调整格局之中，个股表现也会出现明显分化，市场风格趋向均衡，一些质地优良估值已经趋向合理的公司后续会有投资机会。债券市场方面，基本面和政策面决定债券市场方向未变，二级市场股票的剧烈波动、新股 IPO 的收益率收窄，资金面的角度对债券市场相对有利。具体品种看，地方债置换有利于改善地方政府融资能力，但会扩大利率债供给，城投债的价值相对比较高。可转债方面品种较少且估值较高，投资会比较谨慎。受到股市调整影响，上市公司债资信状况有所恶化，需要仔细甄别。

策略上权益市场经过风险释放后，风格趋向均衡，我们将维持合理的仓位，选择业绩增长确定的成长股。债券市场方面维持适度久期中高等级信用债的配置。经济企稳预期和地方债供给压力的影响下，长久期利率债收益率不会明显下行，但我们认为存在波段机会。

本基金将坚持一贯以来的稳健操作风格，强化投资风险控制，密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，持续保持对组合的信用风险和流动性风险的关注，努力为投资人创造安全稳定的收益。

## 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。

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

本报告期内，本基金托管人在对景顺长城中国回报灵活配置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，景顺长城中国回报灵活配置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中国回报灵活配置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，景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人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中国回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金
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<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,470,655,893.76 | 5,239,317.09 |
| 结算备付金 | | 1,652,153.07 | 107,306,529.89 |
| 存出保证金 | | 900,075.60 | 220,623.31 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 585,663,300.39 | 427,412,256.75 |
| 其中：股票投资 | | 136,905,300.39 | 426,564,256.75 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 448,758,000.00 | 848,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 1,178,403,447.60 | 2,284,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 5,286,416.74 | 156,287,579.67 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 12,094,987.89 | 50,292.97 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,254,656,275.05 | 2,980,516,599.68 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2015 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 6,924,713.21 |
| 应付赎回款 | | 21,564,762.74 | - |
| 应付管理人报酬 | | 4,126,260.11 | 3,738,454.71 |
| 应付托管费 | | 687,710.03 | 623,075.80 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 809,227.64 | 1,831,716.74 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 286,402.94 | - |
| 负债合计 | | 27,474,363.46 | 13,117,960.46 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,702,529,191.26 | 2,870,622,209.94 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 524,652,720.33 | 96,776,429.28 |
| 所有者权益合计 | | 3,227,181,911.59 | 2,967,398,639.22 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,254,656,275.05 | 2,980,516,599.68 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.194 元，基金份额总额 2,702,529,191.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金
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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | | 387,840,496.88 |
| 1.利息收入 | | 31,861,827.53 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 8,620,947.74 |
| 债券利息收入 | | 14,001,367.34 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 9,239,512.45 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 356,809,465.47 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 359,947,493.80 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -3,534,926.78 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 396,898.45 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -9,370,307.45 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 8,539,511.33 |
| **减：二、费用** | | 31,334,453.94 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 21,589,499.36 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 3,598,249.88 |

| | | |
|---|---|---|
| 3．销售服务费 | | - |
| 4．交易费用 | 6.4.7.18 | 5,517,418.48 |
| 5．利息支出 | | 358,758.33 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 358,758.33 |
| 6．其他费用 | 6.4.7.19 | 270,527.89 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 356,506,042.94 |
| 减：所得税费用 | | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 356,506,042.94 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金
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<br>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） | 2,870,622,209.94 | 96,776,429.28 | 2,967,398,639.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 356,506,042.94 | 356,506,042.94 |
| 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） | -168,093,018.68 | 71,370,248.11 | -96,722,770.57 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,531,781,810.12 | 343,573,512.90 | 2,875,355,323.02 |
| 2.基金赎回款 | -2,699,874,828.80 | -272,203,264.79 | -2,972,078,093.59 |
| 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） | 2,702,529,191.26 | 524,652,720.33 | 3,227,181,911.59 |

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 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金(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 [2014] 810 号文《关于核准景顺长城中国回报灵活配置混合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作为发起人于 2014 年 9 月 30 日至 2014 年 11 月 4 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2014）验字第 60467014_H03 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 2014 年 11 月 6 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 2,869,742,421.49 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 879,788.45 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 2,870,622,209.94 元，折合 2,870,622,209.94 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

本基金投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款、（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。 本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）+3%（单利年化）。

### 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>》及其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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 日止的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产的分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。本基金目前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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

(2) 金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认金融资产或金融负债，按取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件时的金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资

成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

对于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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,470,655,893.76 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 1,470,655,893.76 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 103,889,287.13 | 136,905,300.39 | 33,016,013.26 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 银行间市场 | 449,135,750.00 | 448,758,000.00 | -377,750.00 |
| | 合计 | 449,135,750.00 | 448,758,000.00 | -377,750.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 553,025,037.13 | 585,663,300.39 | 32,638,263.26 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 1,178,403,447.60 | - |
| 合计 | 1,178,403,447.60 | - |

### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应收活期存款利息 | 97,660.04 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 669.15 |
| 应收债券利息 | 11,335,442.59 |
| 应收买入返售证券利息 | 660,851.52 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 364.59 |
| 合计 | 12,094,987.89 |

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末的其他资产余额为零。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 755,784.89 |
| 银行间市场应付交易费用 | 53,442.75 |
| 合计 | 809,227.64 |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 79,338.66 |
| 预提费用 | 207,064.28 |
| 合计 | 286,402.94 |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,870,622,209.94 | 2,870,622,209.94 |
| 本期申购 | 2,531,781,810.12 | 2,531,781,810.12 |
| 本期赎回(以"-"号填列) | -2,699,874,828.80 | -2,699,874,828.80 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以"-"号填列) | - | - |
| 本期末 | 2,702,529,191.26 | 2,702,529,191.26 |

注：本期申购份额包含基金转入份额；本期赎回份额包含基金转出份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 54,767,858.57 | 42,008,570.71 | 96,776,429.28 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 本期利润 | 365,876,350.39 | -9,370,307.45 | 356,506,042.94 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,526,351.87 | 50,843,896.24 | 71,370,248.11 |
| 其中：基金申购款 | 195,749,193.31 | 147,824,319.59 | 343,573,512.90 |
| 基金赎回款 | -175,222,841.44 | -96,980,423.35 | -272,203,264.79 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 441,170,560.83 | 83,482,159.50 | 524,652,720.33 |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 2,185,438.45 |
| 定期存款利息收入 | 6,049,833.33 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 305,416.26 |
| 其他 | 80,259.70 |
| 合计 | 8,620,947.74 |

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 2,030,315,649.65 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,670,368,155.85 |
| 买卖股票差价收入 | 359,947,493.80 |

### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,546,724,797.61 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,515,681,680.53 |
| 减：应收利息总额 | 34,578,043.86 |
| 买卖债券差价收入 | -3,534,926.78 |

### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益发生额为零。

### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 396,898.45 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 396,898.45 |

### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -9,370,307.45 |
| ——股票投资 | -8,992,557.45 |
| ——债券投资 | -377,750.00 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | -9,370,307.45 |

### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 8,394,552.25 |
| 基金转换费收入 | 144,959.08 |
| 合计 | 8,539,511.33 |

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 5,504,843.48 |
| 银行间市场交易费用 | 12,575.00 |
| 合计 | 5,517,418.48 |

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 债券托管账户维护费 | 16,210.00 |
| 银行划款手续费 | 55,963.61 |
| 合计 | 270,527.89 |

### 6.4.7.20 分部报告

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

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 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、注册登记人、基金销售机构、 |
| 中国工商银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 21,589,499.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5,235,130.69 |

注：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 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,598,249.88 |

注：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×0.25%/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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金。

### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 1,470,655,893.76 | 2,185,438.45 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期未在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（ 2015 年 6 月 30 日 ）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300488 | 恒锋工具 | 2015 年 6 月 25 日 | 2015 年 7 月 1 日 | 新股流通受限 | 20.11 | 20.11 | 6,734 | 135,420.74 | 135,420.74 | - |
| 300480 | 光力科技 | 2015 年 6 月 25 日 | 2015 年 7 月 2 日 | 新股流通受限 | 7.28 | 7.28 | 7,263 | 52,874.64 | 52,874.64 | - |

### 6.4.12.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000008 | 神州高铁 | 2015 年 3 月 12 日 | 筹划重大事项 | 31.45 | 2015 年 7 月 2 日 | 29.56 | 2,034,982 | 35,875,199.95 | 64,000,183.90 | - |
| 600643 | 爱建股份 | 2015 年 6 月 30 日 | 重大事项待公告 | 16.73 | - | - | 1,270,494 | 18,700,223.65 | 21,255,364.62 | - |
| 002303 | 美盈森 | 2015 年 6 | 筹划重大 | 37.78 | 2015 年 7 | 21.43 | 499,982 | 14,751,532.80 | 18,889,319.96 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 月 9 日 | 事项 | | 月 13 日 | | | | | |
| 300467 | 迅游科技 | 2015 年 6 月 25 日 | 筹划重大事项 | 297.30 | 2015 年 7 月 2 日 | 267.57 | 3,726 | 125,752.50 | 1,107,739.80 | - |

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

为有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险，并由独立于投资部门的风险管理人员设定流动性风险控制指标，并进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所或银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本基金管理人每日预测本基金申购赎回情况以控制基金发生大幅申购赎回的风险。而且，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的组合资产损失或收益变动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,470,655,893.76 | - | - | - | - | - | 1,470,655,893.76 |
| 结算备付金 | 1,652,153.07 | - | - | - | - | - | 1,652,153.07 |
| 存出保证金 | 900,075.60 | - | - | - | - | - | 900,075.60 |
| 交易性金融资产 | 50,025,000.00 | - | 201,520,000.00 | 197,213,000.00 | - | 136,905,300.39 | 585,663,300.39 |
| 买入返售金融资产 | 1,178,403,447.60 | - | - | - | - | - | 1,178,403,447.60 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 5,286,416.74 | 5,286,416.74 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 12,094,987.89 | 12,094,987.89 |
| 资产总计 | 2,701,636,570.03 | - | 201,520,000.00 | 197,213,000.00 | - | 154,286,705.02 | 3,254,656,275.05 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 21,564,762.74 | 21,564,762.74 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 4,126,260.11 | 4,126,260.11 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 687,710.03 | 687,710.03 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 809,227.64 | 809,227.64 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 286,402.94 | 286,402.94 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 27,474,363.46 | 27,474,363.46 |
| 利率敏感度缺口 | 2,701,636,570.03 | - | 201,520,000.00 | 197,213,000.00 | - | - | - |
| **上年度末 2014 年 12 月 31 日** | **1 个月以内** | **1-3 个月** | **3 个月-1 年** | **1-5 年** | **5 年以上** | **不计息** | **合计** |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 5,239,317.09 | - | - | - | - | - | 5,239,317.09 |
| 结算备付金 | 107,306,529.89 | - | - | - | - | - | 107,306,529.89 |
| 存出保证金 | 220,623.31 | - | - | - | - | - | 220,623.31 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 848,000.00 | - | 426,564,256.75 | 427,412,256.75 |
| 买入返售金融资产 | 2,284,000,000.00 | - | - | - | - | - | 2,284,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 156,287,579.67 | 156,287,579.67 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 50,292.97 | 50,292.97 |
| 资产总计 | 2,396,766,470.29 | - | - | 848,000.00 | - | 582,902,129.39 | 2,980,516,599.68 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 6,924,713.21 | 6,924,713.21 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,738,454.71 | 3,738,454.71 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 623,075.80 | 623,075.80 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 1,831,716.74 | 1,831,716.74 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 13,117,960.46 | 13,117,960.46 |
| 利率敏感度缺口 | 2,396,766,470.29 | - | - | 848,000.00 | - | - | - |

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2015 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 2,128,842.20 | 10,954.15 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -2,105,913.34 | -10,784.75 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价

格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 136,905,300.39 | 4.24 | 426,564,256.75 | 14.38 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | 448,758,000.00 | 13.91 | 848,000.00 | 0.03 |
| 交易性金融资产－贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 585,663,300.39 | 18.15 | 427,412,256.75 | 14.40 |

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2015 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2014 年 12 月 31 日 ） |
| | “沪深 300 指数×50%”上升 5% | 8,067,954.78 | 39,034,786.35 |
| | “沪深 300 指数×50%”下降 5% | -8,067,954.78 | -39,034,786.35 |

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 31,464,396.73 元，划分为第二层次的余额为人民币 554,198,903.66 元，无划分为第三层次的余额（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 382,151,731.25 元，划分为第二层次的余额为人民币 45,260,525.50 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

# §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 136,905,300.39 | 4.21 |
| | 其中：股票 | 136,905,300.39 | 4.21 |
| 2 | 固定收益投资 | 448,758,000.00 | 13.79 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 其中：债券 | 448,758,000.00 | 13.79 |
| | 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 | 1,178,403,447.60 | 36.21 |
| | 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 | 1,472,308,046.83 | 45.24 |
| 7 | 其他各项资产 | 18,281,480.23 | 0.56 |
| 8 | 合计 | 3,254,656,275.05 | 100.00 |

## 7.2 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（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 484,279.65 | 0.02 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 87,458,583.14 | 2.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 15,262,500.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| 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 | 1,536,620.68 | 0.05 |
| J | 金融业 | 21,255,364.62 | 0.66 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,907,952.30 | 0.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 136,905,300.39 | 4.24 |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000008 | 神州高铁 | 2,034,982 | 64,000,183.90 | 1.98 |
| 2 | 600643 | 爱建股份 | 1,270,494 | 21,255,364.62 | 0.66 |
| 3 | 002303 | 美盈森 | 499,982 | 18,889,319.96 | 0.59 |
| 4 | 300262 | 巴安水务 | 825,000 | 15,262,500.00 | 0.47 |
| 5 | 600138 | 中青旅 | 500,000 | 10,560,000.00 | 0.33 |
| 6 | 603116 | 红蜻蜓 | 65,333 | 1,831,937.32 | 0.06 |
| 7 | 300485 | 赛升药业 | 17,372 | 1,164,097.72 | 0.04 |
| 8 | 300467 | 迅游科技 | 3,726 | 1,107,739.80 | 0.03 |
| 9 | 002772 | 众兴菌业 | 21,381 | 484,279.65 | 0.02 |
| 10 | 300479 | 神思电子 | 9,600 | 434,688.00 | 0.01 |
| 11 | 002773 | 康弘药业 | 17,338 | 411,430.74 | 0.01 |
| 12 | 002769 | 普路通 | 7,710 | 347,952.30 | 0.01 |
| 13 | 300469 | 信息发展 | 6,596 | 302,360.64 | 0.01 |
| 14 | 300486 | N 东杰 | 16,092 | 207,104.04 | 0.01 |
| 15 | 300482 | N 万孚 | 7,942 | 182,983.68 | 0.01 |
| 16 | 300481 | N 惠成 | 11,296 | 148,542.40 | 0.00 |
| 17 | 300488 | 恒锋工具 | 6,734 | 135,420.74 | 0.00 |
| 18 | 002771 | 真视通 | 6,251 | 126,520.24 | 0.00 |
| 19 | 300480 | 光力科技 | 7,263 | 52,874.64 | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600643 | 爱建股份 | 66,970,814.18 | 2.26 |
| 2 | 002439 | 启明星辰 | 63,449,027.08 | 2.14 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 51,869,816.00 | 1.75 |
| 4 | 600617 | 国新能源 | 47,222,607.19 | 1.59 |
| 5 | 601258 | 庞大集团 | 45,918,079.51 | 1.55 |
| 6 | 600885 | 宏发股份 | 42,278,089.98 | 1.42 |
| 7 | 000008 | 神州高铁 | 40,987,681.02 | 1.38 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8 | 600594 | 益佰制药 | 38,322,458.34 | 1.29 |
| 9 | 600185 | 格力地产 | 36,014,071.09 | 1.21 |
| 10 | 002215 | 诺 普 信 | 35,784,294.08 | 1.21 |
| 11 | 000100 | TCL 集团 | 34,762,400.00 | 1.17 |
| 12 | 601872 | 招商轮船 | 32,923,054.81 | 1.11 |
| 13 | 600340 | 华夏幸福 | 32,789,530.01 | 1.10 |
| 14 | 002236 | 大华股份 | 30,763,011.20 | 1.04 |
| 15 | 000625 | 长安汽车 | 28,280,731.46 | 0.95 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 27,444,021.25 | 0.92 |
| 17 | 300251 | 光线传媒 | 25,788,431.77 | 0.87 |
| 18 | 002303 | 美盈森 | 25,715,482.80 | 0.87 |
| 19 | 600280 | 中央商场 | 24,707,672.92 | 0.83 |
| 20 | 600979 | 广安爱众 | 23,091,088.00 | 0.78 |

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 | 601318 | 中国平安 | 101,957,077.03 | 3.44 |
| 2 | 000150 | 宜华健康 | 89,218,662.17 | 3.01 |
| 3 | 002439 | 启明星辰 | 72,730,852.12 | 2.45 |
| 4 | 002215 | 诺 普 信 | 68,645,389.45 | 2.31 |
| 5 | 600643 | 爱建股份 | 60,093,342.79 | 2.03 |
| 6 | 601258 | 庞大集团 | 58,426,238.38 | 1.97 |
| 7 | 600617 | 国新能源 | 52,878,994.68 | 1.78 |
| 8 | 600885 | 宏发股份 | 51,168,467.96 | 1.72 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 50,587,965.50 | 1.70 |
| 10 | 600694 | 大商股份 | 47,829,565.34 | 1.61 |
| 11 | 000402 | 金 融 街 | 47,564,732.08 | 1.60 |
| 12 | 000100 | TCL 集团 | 47,042,132.43 | 1.59 |
| 13 | 002482 | 广田股份 | 43,064,631.62 | 1.45 |
| 14 | 600185 | 格力地产 | 41,129,255.44 | 1.39 |
| 15 | 600594 | 益佰制药 | 40,367,352.37 | 1.36 |
| 16 | 300170 | 汉得信息 | 35,946,631.17 | 1.21 |
| 17 | 601872 | 招商轮船 | 33,568,708.41 | 1.13 |
| 18 | 600340 | 华夏幸福 | 32,817,992.89 | 1.11 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 19 | 000831 | 五矿稀土 | 31,787,192.28 | 1.07 |
| 20 | 002236 | 大华股份 | 31,460,938.50 | 1.06 |

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,389,701,756.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,030,315,649.65 |

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

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 | 448,758,000.00 | 13.91 |
| | 其中：政策性金融债 | 448,758,000.00 | 13.91 |
| 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 | 448,758,000.00 | 13.91 |

## 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

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 | 140224 | 14 国开 24 | 1,500,000 | 155,385,000.00 | 4.81 |
| 2 | 150206 | 15 国开 06 | 1,000,000 | 100,920,000.00 | 3.13 |
| 3 | 150403 | 15 农发 03 | 500,000 | 50,305,000.00 | 1.56 |
| 4 | 130202 | 13 国开 02 | 500,000 | 50,295,000.00 | 1.56 |
| 5 | 140218 | 14 国开 18 | 500,000 | 50,025,000.00 | 1.55 |

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

1、时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向和技术指标等因素。

2、套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

3、合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 900,075.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,286,416.74 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,094,987.89 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,281,480.23 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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 | 000008 | 神州高铁 | 64,000,183.90 | 1.98 | 筹划重大事项 |
| 2 | 600643 | 爱建股份 | 21,255,364.62 | 0.66 | 重要事项未公告 |
| 3 | 002303 | 美盈森 | 18,889,319.96 | 0.59 | 筹划重大事项 |
| 4 | 300467 | 迅游科技 | 1,107,739.80 | 0.03 | 筹划重大事项 |

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 4,678 | 577,710.39 | 2,335,627,593.87 | 86.42% | 366,901,597.39 | 13.58% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 209,230.38 | 0.0077% |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10～50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（ 2014 年 11 月 6 日 ）基金份额总额 | 2,870,622,209.94 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,870,622,209.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,531,781,810.12 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 2,699,874,828.80 |
| 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 | 2,702,529,191.26 |

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

1、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。

2、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

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。

## 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 814,416,287.93 | 23.98% | 741,445.44 | 23.98% | - |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | 785,350,400.17 | 23.12% | 714,983.49 | 23.12% | - |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | 581,363,060.80 | 17.11% | 529,271.56 | 17.11% | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | 469,046,346.24 | 13.81% | 427,019.67 | 13.81% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 215,229,060.84 | 6.34% | 195,943.72 | 6.34% | - |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | 209,906,351.28 | 6.18% | 191,099.36 | 6.18% | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | 157,486,476.46 | 4.64% | 143,375.20 | 4.64% | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 74,953,701.23 | 2.21% | 68,237.89 | 2.21% | - |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | 62,397,726.99 | 1.84% | 56,806.90 | 1.84% | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 14,577,877.40 | 0.43% | 13,271.55 | 0.43% | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | 12,119,956.00 | 0.36% | 11,034.04 | 0.36% | - |
| 长城证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、本基金与景顺长城新兴成长股票型证券投资基金共用交易单元。

2、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1）选择标准：

a、资金实力雄厚，信誉良好；

b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；

d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；

e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2）选择程序

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | 50,000,000.00 | 4.17% | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1,284,720.00 | 100.00% | 700,000,000.00 | 58.33% | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | 270,000,000.00 | 22.50% | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | 180,000,000.00 | 15.00% | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
| --- | --- | --- | --- |
| 1 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 1 月 16 日 |
| 2 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增苏州银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 1 月 16 日 |
| 3 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 1 月 23 日 |
| 4 | 景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 1 月 23 日 |
| 5 | 景顺长城基金管理有限公司关于网上直销交易系统基金转换费率优惠的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 2 月 11 日 |
| 6 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和讯科技申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 12 日 |
| 7 | 关于景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 12 日 |
| 8 | 景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 3 月 28 日 |
| 9 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 1 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 告 | | |
| 10 | 关于景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金恢复日常申购、转换转入和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 9 日 |
| 11 | 关于景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入和定期定额投资业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 13 日 |
| 12 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 15 日 |
| 13 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 17 日 |
| 14 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加华龙证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 17 日 |
| 15 | 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 1 季度报告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 21 日 |
| 16 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加汇付金融基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 17 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇付金融为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 18 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加利得基金基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 8 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 19 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增利得基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 8 日 |
| 20 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增川财证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 29 日 |
| 22 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加川财证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 5 月 29 日 |
| 23 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增天风证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 4 日 |
| 24 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 12 日 |
| 25 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国民生银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 18 日 |
| 26 | 景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书摘要 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 19 日 |
| 27 | 景顺长城中国回报灵活配置混合型证 | 中国证券报，上海 | 2015 年 6 月 19 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 券投资基金 2015 年第 1 号更新招募说明书 | 证券报，证券时报，基金管理人网站 | |
| 28 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加第一创业基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 26 日 |
| 29 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站 | 2015 年 6 月 30 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；

6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

## 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2015 年 8 月 29 日