

# 景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF） 2016 年半年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38

7.12 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 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.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>46</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	景顺长城鼎益混合（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	2,318,746,263.20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年5月25日

### 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
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1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1号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	杨光裕	田国立

## 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.igwfm.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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-94,374,127.76
本期利润	-133,552,710.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0752
本期加权平均净值利润率	-7.27%
本期基金份额净值增长率	-5.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-301,392,876.23
期末可供分配基金份额利润	-0.1300
期末基金资产净值	2,017,353,386.97
期末基金份额净值	0.870
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	497.36%

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。

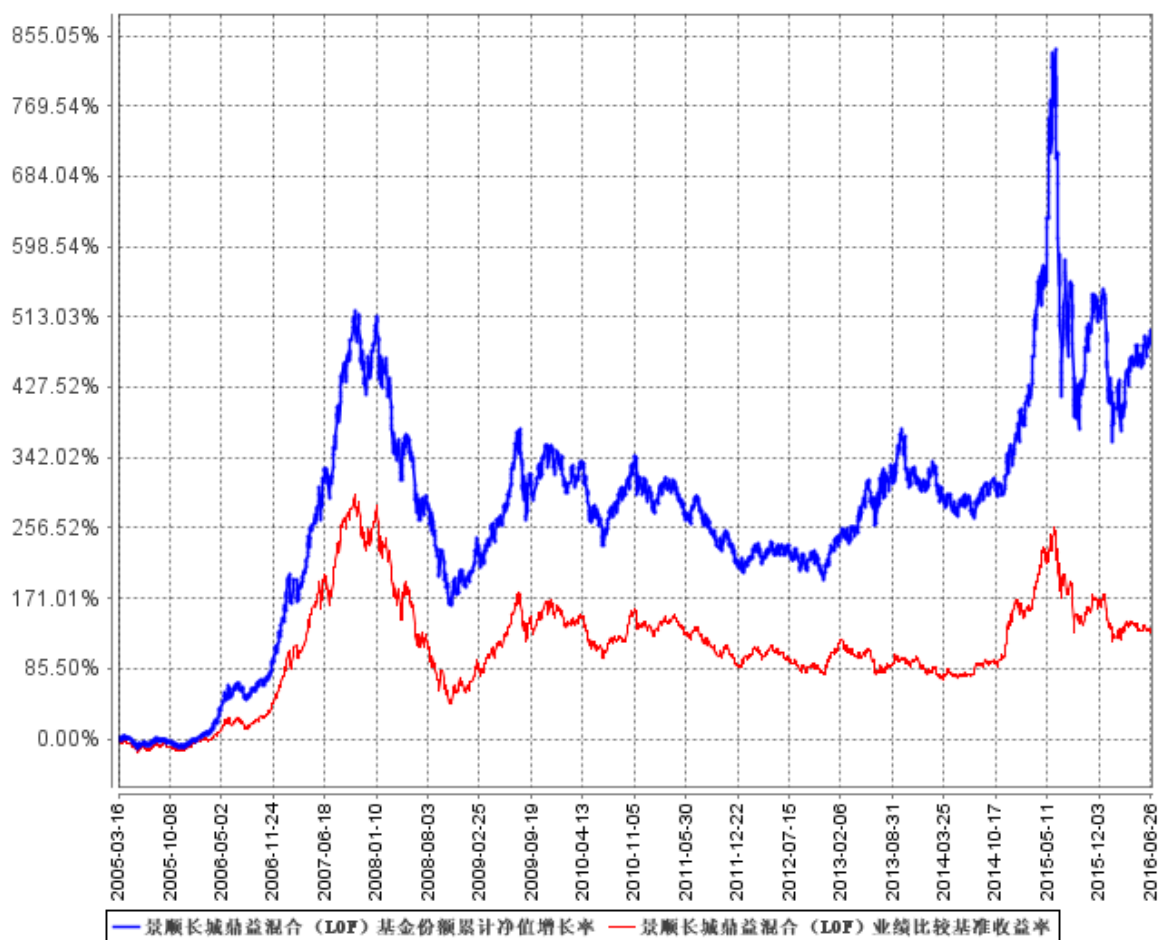
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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	3.33%	1.19%	-1.84%	0.72%	5.17%	0.47%
过去三个月	8.61%	1.27%	-3.03%	0.75%	11.64%	0.52%
过去六个月	-5.06%	2.24%	-13.18%	1.39%	8.12%	0.85%
过去一年	-13.31%	2.64%	-25.33%	1.79%	12.02%	0.85%
过去三年	58.03%	2.10%	27.91%	1.46%	30.12%	0.64%
自基金合同生效起至今	497.36%	1.68%	133.28%	1.48%	364.08%	0.20%

### 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一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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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



资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2016 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 55 只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 800 食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型

证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘彦春	景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金经理，景顺长城鼎益混合型证券投资基金（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），景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金经理，研究部总监	2015年7月10日	-	13	管理学硕士。曾担任汉唐证券研究员，香港中信投资研究有限公司研究员，博时基金研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2015年1月加入本公司，自2015年4月起担任基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（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。

## 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

上半年，景顺长城鼎益基金继续坚持一贯的投资理念，投资判断主要基于企业本身的经营和财务绩效，自下而上寻找具备高投入资本产出、高成长潜力的企业。基金在 2 季度减持了部分经营不达预期个股，进一步增加了估值偏低、盈利能力和成长性较好的个股配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，本基金份额净值增长率为-5.06%，业绩比较基准收益率为-13.18%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基建托底一度使得上半年经济企稳，但民营投资持续低迷，实体经济回报率偏低局面难以改变。资金继续脱实入虚，包括股市在内的各大类资产继续呈现泡沫化局面。近期，经济与通胀双双下行导致市场对货币政策宽松预期再次升温，股市、债市、商品齐涨；股市中再次出现各个主题板块轮涨的局面。我们在积极参与市场反弹的同时，也必须意识到目前市场泡沫化程度相当高。人民币汇率压力已经对货币政策宽松形成制约。一旦货币政策宽松不达预期，市场就将存在调整风险。

在当前时点，企业家能力变得尤为重要。我们需要企业家在未来相对复杂的经济环境下，利用好一切可以获得的资源，做好产业布局，继续开拓市场，持续为股东创造价值。

消费仍然是我们重点研究领域。文化、体育、教育、娱乐等新兴消费领域正在快速成长。传统消费则向更健康、更安全、更个性化转型升级。企业如果能够把握部分细分领域转型升级趋势，很可能通过差异化竞争脱颖而出。传统消费企业中，部分低估值、具有强大现金流的消费品龙头企业同样存在价值重估的可能。

民间固定资产投资月度增速出现负增长，而公共部门固定资产投资则进一步加速，未来这一趋势可能持续。我们需要关注公共部门投资方向是否有变化，下游行业产能和库存情况，部分细分行业可能存在投资机会。

在经济的重大转折关口，我们进行投资同样要面向未来，保持乐观同时冷静而充满耐心。我们继续重点关注可以创造性满足国内居民需求的优秀企业。期待政府可以加快推进市场化改革，更大力度保护创新和企业家精神，相信未来会有一批优秀企业在提高经济整体运行效率过程中成长起来。

## 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**

本基金本报告期内实施了两次利润分配：

(1) 截至 2015 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 708,261,520.37 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 1,102,830,960.30 元，本基金的基金管理人已于 2016 年 1 月 20 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 1.0 元，详细信息请查阅相关分红公告。

(2) 截至 2015 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 708,261,520.37 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 1,102,830,960.30 元，本基金的基金管理人已于 2016 年 4 月 22 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 4.88 元，详细信息请查阅相关分红公告。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城鼎益混合型证券投资基金（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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	113,042,297.06	350,360,654.66
结算备付金		2,560,180.89	3,223,651.25
存出保证金		318,642.99	872,455.59
交易性金融资产	6.4.7.2	1,665,669,367.47	1,606,878,237.92
其中：股票投资		1,665,669,367.47	1,606,878,237.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	240,701,131.05	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	75,969.71	87,528.87
应收股利		-	-
应收申购款		182,857.72	18,383.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,022,550,446.89	1,961,440,912.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	41,525,425.82
应付赎回款		1,231,007.66	2,959,730.16
应付管理人报酬		2,423,813.01	2,461,741.31
应付托管费		403,968.84	410,290.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	784,284.63	1,530,657.96

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	6.4.7.8	345,892.98	220,046.08
负债合计		5,197,059.92	49,115,984.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,318,746,263.20	1,204,063,407.48
未分配利润	6.4.7.10	-301,392,876.23	708,261,520.37
所有者权益合计		2,017,353,386.97	1,912,324,927.85
负债和所有者权益总计		2,022,550,446.89	1,961,440,912.18

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.870 元，基金份额总额 2,318,746,263.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-115,557,381.01	1,993,097,465.77
1.利息收入		2,171,667.79	1,878,302.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,392,242.22	1,114,547.03
债券利息收入		-	278,904.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		779,425.57	484,851.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-82,062,668.50	2,435,215,429.48
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-89,624,024.46	2,422,174,628.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-179,150.00
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	7,561,355.96	13,219,950.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-39,178,583.22	-444,155,713.50
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	3,512,202.92	159,447.37
<b>减：二、费用</b>		17,995,329.97	56,261,015.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,557,183.37	29,457,459.55

2. 托管费	6.4.10.2.2	2, 259, 530. 55	4, 909, 576. 64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1, 909, 972. 25	21, 612, 687. 17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	268, 643. 80	281, 292. 00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-133, 552, 710. 98	1, 936, 836, 450. 41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-133, 552, 710. 98	1, 936, 836, 450. 41

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	1, 204, 063, 407. 48	708, 261, 520. 37	1, 912, 324, 927. 85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-133, 552, 710. 98	-133, 552, 710. 98
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, 114, 682, 855. 72	1, 871, 040, 493. 43	2, 985, 723, 349. 15
其中：1.基金申购款	4, 600, 329, 247. 45	1, 223, 600, 237. 86	5, 823, 929, 485. 31
2.基金赎回款	-3, 485, 646, 391. 73	647, 440, 255. 57	-2, 838, 206, 136. 16
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）	-	-2, 747, 142, 179. 05	-2, 747, 142, 179. 05
五、期末所有者权益（基金净值）	2, 318, 746, 263. 20	-301, 392, 876. 23	2, 017, 353, 386. 97
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		





有限公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起将景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）变更为本基金。

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%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制。同时，在具体会计估值核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### **6.4.5.3 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。

## 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、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

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。

自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品、买断式买入返售金融商品及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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、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，暂免征收个人所得税。

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
	2016年6月30日
活期存款	113,042,297.06
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	113,042,297.06

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,631,451,079.37	1,665,669,367.47	34,218,288.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,631,451,079.37	1,665,669,367.47	34,218,288.10

### 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	
	2016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	240,701,131.05	-
合计	240,701,131.05	-

#### 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 2016年6月30日
应收活期存款利息	51,327.48
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	1,037.38
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	23,475.78
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	129.06
合计	75,969.71

#### 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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	764,511.51
银行间市场应付交易费用	19,773.12
合计	784,284.63

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,277.98
预提费用	342,615.00
合计	345,892.98

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,204,063,407.48	1,204,063,407.48
本期申购	4,600,329,247.45	4,600,329,247.45
本期赎回(以“-”号填列)	-3,485,646,391.73	-3,485,646,391.73
- 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	2,318,746,263.20	2,318,746,263.20

注：本期申购含红利再投资份额。

### 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	1,005,542,704.51	-297,281,184.14	708,261,520.37
本期利润	-94,374,127.76	-39,178,583.22	-133,552,710.98
本期基金份额交易产生的变动数	2,278,533,368.48	-407,492,875.05	1,871,040,493.43
其中：基金申购款	3,038,829,327.69	-1,815,229,089.83	1,223,600,237.86
基金赎回款	-760,295,959.21	1,407,736,214.78	647,440,255.57
本期已分配利润	-2,747,142,179.05	-	-2,747,142,179.05
本期末	442,559,766.18	-743,952,642.41	-301,392,876.23

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	29,014.78
其他	124,956.81
合计	1,392,242.22

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	565,860,802.89
减：卖出股票成本总额	655,484,827.35
买卖股票差价收入	-89,624,024.46

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期债券收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期衍生工具收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,561,355.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,561,355.96

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-39,178,583.22
——股票投资	-39,178,583.22
——债券投资	-
——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	-39,178,583.22

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	3,512,202.92
合计	3,512,202.92

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,909,910.75
银行间市场交易费用	61.50
合计	1,909,972.25

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	54,700.10
信息披露费	149,178.12
债券托管账户维护费	18,501.52
上市月费	29,835.26
银行划款手续费	16,428.80
合计	268,643.80

#### 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报出日，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

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

于 2016 年上半年，并无对本基金存在控制关系或重大影响关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构

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。

## 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	-	-	887,555,971.08	6.83%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	808,031.49	6.83%	746,187.15	10.43%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为

本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 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	13,557,183.37	29,457,459.55
其中：支付销售机构的客户维护费	2,287,162.70	6,351,399.94

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1.5%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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 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	2,259,530.55	4,909,576.64

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

### 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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 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及上年度可比期间均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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	113,042,297.06	1,238,270.63	299,683,230.25	1,037,933.10

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。

#### 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016年4月22日	2016年4月25日	2016年4月22日	4.880	2,330,990,386.31	296,087,823.25	2,627,078,209.56	
2	2016年1月20日	2016年1月21日	2016年1月20日	1.000	63,493,128.34	56,570,841.15	120,063,969.49	
合计	-	-	-	5.880	2,394,483,514.65	352,658,664.40	2,747,142,179.05	

#### 6.4.12 期末（2016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
601966	玲珑	2016年6月	2016年	新股流	12.98	12.98	1,095	14,213.10	14,213.10	-

	轮胎	月 24 日	7 月 6 日	通受限						
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 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
300166	东方国信	2016 年 6 月 8 日	重大事项停牌	28.23	-	-	2,400,043	55,723,351.31	67,753,213.89	-
002672	东江环保	2016 年 5 月 23 日	重大事项停牌	17.89	2016 年 7 月 15 日	19.06	3,423,328	65,376,038.31	61,243,337.92	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大事项停牌	18.72	2016 年 7 月 4 日	22.59	2,551,064	85,530,504.31	47,755,918.08	-

#### 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，并按照合同约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 2016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	113,042,297.06	-	-	-	-	-	113,042,297.06
结算备付金	2,560,180.89	-	-	-	-	-	2,560,180.89
存出保证金	318,642.99	-	-	-	-	-	318,642.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,665,669,367.47	1,665,669,367.47
买入返售金融资产	240,701,131.05	-	-	-	-	-	240,701,131.05
应收利息	-	-	-	-	-	75,969.71	75,969.71
应收申购款	-	-	-	-	-	182,857.72	182,857.72
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	356,622,251.99	-	-	-	-	1,665,928,194.90	2,022,550,446.89
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,231,007.66	1,231,007.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,423,813.01	2,423,813.01
应付托管费	-	-	-	-	-	403,968.84	403,968.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	784,284.63	784,284.63
应交税费	-	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	-	345,892.98	345,892.98
负债总计	-	-	-	-	-	5,197,059.92	5,197,059.92
利率敏感度缺口	356,622,251.99	-	-	-	-	-	-
上年度末 2015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	350,360,654.66	-	-	-	-	350,360,654.66
结算备付金	3,223,651.25	-	-	-	-	3,223,651.25
存出保证金	872,455.59	-	-	-	-	872,455.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-1,606,878,237.92	1,606,878,237.92
应收利息	-	-	-	-	87,528.87	87,528.87
应收申购款	-	-	-	-	18,383.89	18,383.89
资产总计	354,456,761.50	-	-	-	-1,606,984,150.68	1,961,440,912.18
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	41,525,425.82	41,525,425.82
应付赎回款	-	-	-	-	2,959,730.16	2,959,730.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,461,741.31	2,461,741.31
应付托管费	-	-	-	-	410,290.20	410,290.20
应付交易费用	-	-	-	-	1,530,657.96	1,530,657.96
应交税费	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	220,046.08	220,046.08
负债总计	-	-	-	-	49,115,984.33	49,115,984.33
利率敏感度缺口	354,456,761.50	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：同），因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对期末基金资产净值无重大影响（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 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。

本基金投资组合中股票投资不少于基金总资产的 60%；持有现金和到期在 1 年以内政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 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 2016年6月30日		上年度末 2015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	1,665,669,367.47	82.57	1,606,878,237.92	84.03
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	1,665,669,367.47	82.57	1,606,878,237.92	84.03

#### 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	沪深300指数上升5%	77,668,105.40	67,887,534.94
沪深300指数下降5%	-77,668,105.40	-67,887,534.94	

#### 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

本基金管理人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2016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1,488,103,318.20元，划分为第二层次的余额为人民币177,566,049.27元，无划分为第三层次的余额（于2015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 1,544,759,829.52 元，划分为第二层次的余额为人民币 62,118,408.40 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。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金报告期末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 2016 年 8 月 25 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	1,665,669,367.47	82.35
	其中：股票	1,665,669,367.47	82.35
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	240,701,131.05	11.90
	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	115,602,477.95	5.72

7	其他各项资产	577,470.42	0.03
8	合计	2,022,550,446.89	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	49,207,410.00	2.44
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,242,818,950.66	61.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	770,827.20	0.04
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	258,927,992.39	12.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	61,243,337.92	3.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,803,923.20	0.88
R	文化、体育和娱乐业	34,876,800.00	1.73
S	综合	-	-
	合计	1,665,669,367.47	82.57

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002572	索菲亚	2,499,981	140,048,935.62	6.94
2	002311	海大集团	6,899,833	108,810,366.41	5.39
3	600566	济川药业	4,031,920	103,781,620.80	5.14
4	002616	长青集团	4,190,436	86,742,025.20	4.30
5	603899	晨光文具	4,800,076	84,961,345.20	4.21
6	300145	中金环境	3,842,182	84,066,942.16	4.17
7	300017	网宿科技	1,230,250	82,672,800.00	4.10
8	002475	立讯精密	4,079,130	80,154,904.50	3.97
9	300166	东方国信	2,400,043	67,753,213.89	3.36
10	002303	美盈森	5,474,625	67,283,141.25	3.34
11	000568	泸州老窖	2,130,765	63,283,720.50	3.14
12	002672	东江环保	3,423,328	61,243,337.92	3.04
13	000333	美的集团	2,557,838	60,671,917.36	3.01
14	002007	华兰生物	1,919,885	60,284,389.00	2.99
15	600201	生物股份	2,000,000	54,660,000.00	2.71
16	002299	圣农发展	1,899,900	49,207,410.00	2.44
17	002065	东华软件	2,551,064	47,755,918.08	2.37
18	600702	沱牌舍得	1,881,977	47,501,099.48	2.35
19	300359	全通教育	1,448,110	42,950,942.60	2.13
20	300048	合康变频	3,000,000	35,280,000.00	1.75
21	300133	华策影视	2,240,000	34,876,800.00	1.73
22	002236	大华股份	2,500,000	32,750,000.00	1.62
23	002250	联化科技	2,200,000	31,504,000.00	1.56
24	002008	大族激光	999,916	22,838,081.44	1.13
25	000550	江铃汽车	904,849	22,042,121.64	1.09
26	002470	金正大	2,698,598	21,723,713.90	1.08
27	002123	荣信股份	927,746	19,287,839.34	0.96
28	300244	迪安诊断	539,840	17,803,923.20	0.88
29	300182	捷成股份	1,035,922	17,724,625.42	0.88
30	300203	聚光科技	536,087	14,152,696.80	0.70
31	601611	中国核建	37,059	770,827.20	0.04
32	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
33	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
34	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
35	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.00

36	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
37	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
38	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
39	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
40	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
41	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
42	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
43	601966	玲珑轮胎	1,095	14,213.10	0.00
44	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
45	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
46	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	002475	立讯精密	77,341,161.21	4.04
2	600566	济川药业	61,932,488.50	3.24
3	603899	晨光文具	60,724,150.34	3.18
4	000333	美的集团	59,704,537.03	3.12
5	002007	华兰生物	57,276,373.00	3.00
6	300166	东方国信	55,723,351.31	2.91
7	002299	圣农发展	41,067,594.70	2.15
8	300078	思创医惠	40,327,329.37	2.11
9	300133	华策影视	37,976,414.18	1.99
10	002303	美盈森	34,690,782.51	1.81
11	002123	荣信股份	32,433,969.00	1.70
12	000550	江铃汽车	23,877,010.19	1.25
13	002008	大族激光	22,950,183.28	1.20
14	000541	佛山照明	22,644,408.00	1.18
15	600201	生物股份	20,521,003.08	1.07
16	300182	捷成股份	17,983,541.10	0.94
17	600702	沱牌舍得	17,643,739.00	0.92
18	300244	迪安诊断	17,077,673.88	0.89
19	002616	长青集团	13,739,041.00	0.72

20	300017	网宿科技	7,831,775.95	0.41
----	--------	------	--------------	------

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	600804	鹏博士	75,832,062.13	3.97
2	300020	银江股份	53,336,945.59	2.79
3	002573	清新环境	48,290,872.29	2.53
4	300078	思创医惠	38,545,708.49	2.02
5	000902	新洋丰	35,961,694.97	1.88
6	300048	合康变频	34,812,784.88	1.82
7	600478	科力远	33,031,199.70	1.73
8	300284	苏交科	27,518,855.17	1.44
9	002250	联化科技	25,864,806.45	1.35
10	600077	宋都股份	24,893,354.09	1.30
11	000958	东方能源	22,922,141.75	1.20
12	000541	佛山照明	18,920,979.62	0.99
13	002236	大华股份	18,796,992.51	0.98
14	002123	荣信股份	14,872,311.18	0.78
15	600037	歌华有线	14,831,317.00	0.78
16	002711	欧浦智网	14,169,494.20	0.74
17	000090	天健集团	13,815,852.43	0.72
18	600201	生物股份	13,629,543.67	0.71
19	002470	金正大	9,488,605.24	0.50
20	300347	泰格医药	7,190,832.92	0.38

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	753,454,540.12
卖出股票收入（成交）总额	565,860,802.89

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

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。

## 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	318,642.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,969.71
5	应收申购款	182,857.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	577,470.42

### 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	300166	东方国信	67,753,213.89	3.36	重大事项停牌

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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
74,051	31,312.83	707,086,510.83	30.49%	1,611,659,752.37	69.51%

## 8.2 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	455,247.00	1.56%
2	张爱招	425,100.00	1.46%
3	牟德武	387,465.00	1.33%
4	万海斌	327,400.00	1.12%
5	姚瑞芹	279,600.00	0.96%
6	袁传智	255,771.00	0.88%
7	王淑英	250,056.00	0.86%
8	阴鹏	237,443.00	0.81%
9	谭青梅	235,066.00	0.81%
10	张燕	213,599.00	0.73%

注：持有人为场内持有人。

## 8.3 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	1,808.67	0.00%

## 8.4 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。

## § 9 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	1,204,063,407.48
本报告期基金总申购份额	4,600,329,247.45
减：本报告期基金总赎回份额	3,485,646,391.73
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,318,746,263.20

注：本期申购含红利再投份额。



## § 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 2016 年 1 月 22 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，同意黄卫明先生辞去本公司督察长一职。

2、本基金管理人于 2016 年 2 月 4 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，聘任杨皞阳先生担任本公司督察长。

3、本基金管理人于 2016 年 2 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，聘任毛从容女士担任本公司副总经理。

4、本基金管理人于 2016 年 7 月 4 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，同意赵如冰先生辞去本公司董事长一职，聘任杨光裕先生担任本公司董事长。根据公司章程相关规定，“公司的董事长为公司的法定代表人”。经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人已于 2016 年 7 月 13 日变更为杨光裕先生，本基金管理人已于 2016 年 7 月 15 日发布了公告。

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。

5、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	
中国国际金融股份有限公司	1	431,077,774.81	32.71%	401,463.72	32.71%	-
招商证券股份有限公司	2	213,606,067.83	16.21%	198,932.43	16.21%	-
海通证券股份有限公司	3	210,100,445.72	15.94%	195,667.67	15.94%	-
长江证券股份有限公司	1	146,117,503.99	11.09%	136,079.93	11.09%	-
广发证券股份有限公司	2	141,871,476.82	10.77%	132,125.33	10.77%	-
平安证券有限责任公司	1	77,889,413.17	5.91%	72,538.43	5.91%	-
中信建投证券股份有限公司	2	33,653,258.64	2.55%	31,341.47	2.55%	-
华泰证券股份有限公司	1	33,405,504.35	2.54%	31,110.42	2.54%	-
中国银河证券股份有限公司	1	29,602,940.72	2.25%	27,569.13	2.25%	-
东兴证券股份有限公司	1	351,903.98	0.03%	327.71	0.03%	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期租用的证券公司交易单元除东吴证券新增 1 个以外，其余未变更。

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情况稳定；
- 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
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	2,410,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月4日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月6日
3	景顺长城基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断后本公司各基金申购赎回、转换业务开放时间调整的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月7日
4	景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF) 分红公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月18日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券基金申购及定期定额投资申购费率优	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月20日

	惠活动的公告		
6	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2015年第4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	2016年1月21日
7	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	2016年1月22日
8	景顺长城基金管理有限公司关于聘任督察长的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年2月4日
9	景顺长城基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年2月20日
10	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2015年年度报告摘要	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年3月29日
11	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2015年年度报告	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年3月29日
12	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告	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年3月30日
13	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）分红公告	中国证券报,上海证券报,证券时报,基金管理人网站	2016年4月20日
14	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2016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	2016年4月20日

15	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2016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	2016年4月29日
16	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2016年第1号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年4月29日
17	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	2016年7月4日
18	景顺长城基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年7月15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、中国证监会准予景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
- 2、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）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  
2016年8月27日