

# 景顺长城新兴成长混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2017 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城新兴成长混合
场内简称	无
基金主代码	260108
交易代码	260108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 28 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	1,073,573,788.97 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，通过投资于具有合理值的高成长性上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于成长型公司。根据不同类型成长型公司扩张起源的背景因素，本基金主要采取“自下而上”的投资策略，并结合估值因素最终确定投资标的。
业绩比较基准	富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金。

### 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	郭明
	联系电话	0755-82370388	010-66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-97,201,365.07	723,716,829.38	23,499,907.38
本期利润	-92,756,065.26	634,751,026.49	10,768,998.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0831	0.4191	0.0041
本期基金份额净值增长率	-8.12%	33.42%	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0761	0.0137	-0.2402
期末基金资产净值	991,845,329.04	1,149,503,217.69	1,699,936,465.66
期末基金份额净值	0.924	1.014	0.760

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。

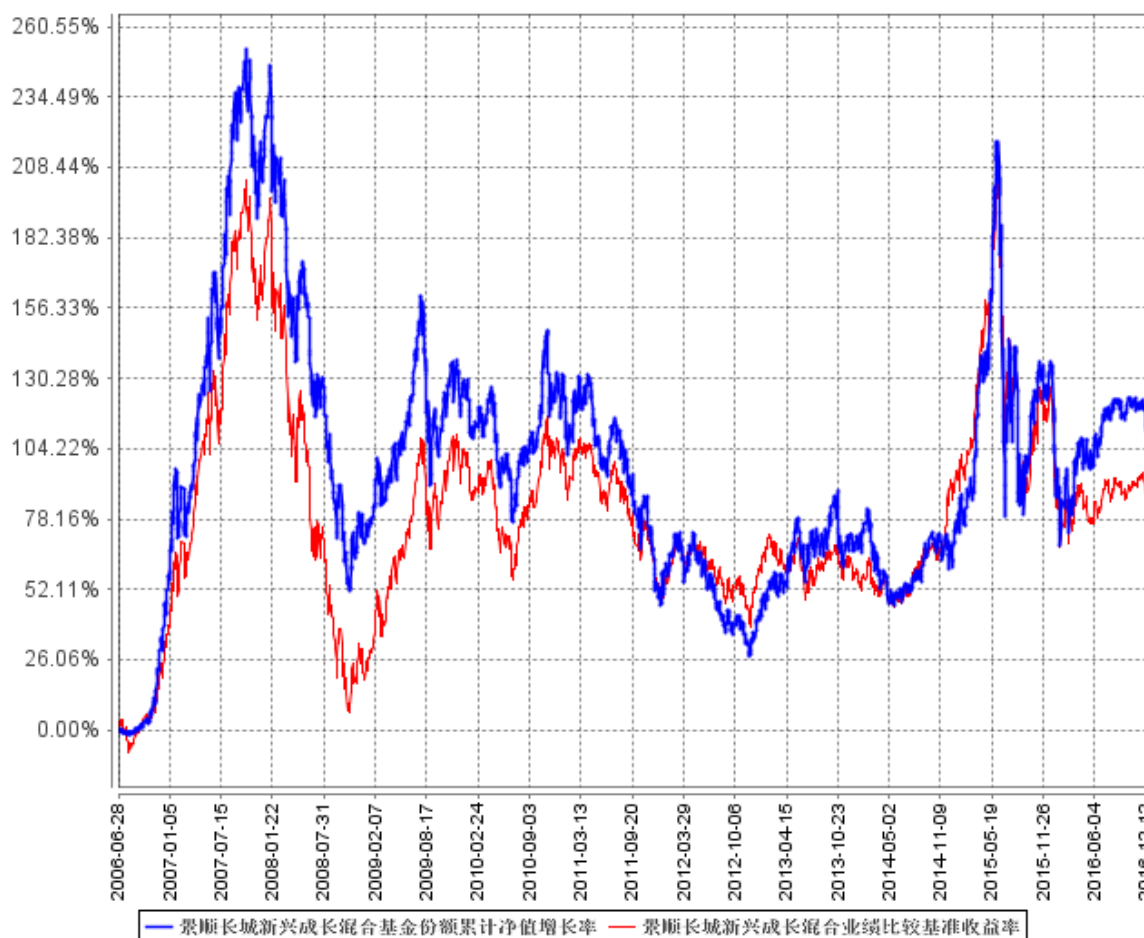
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

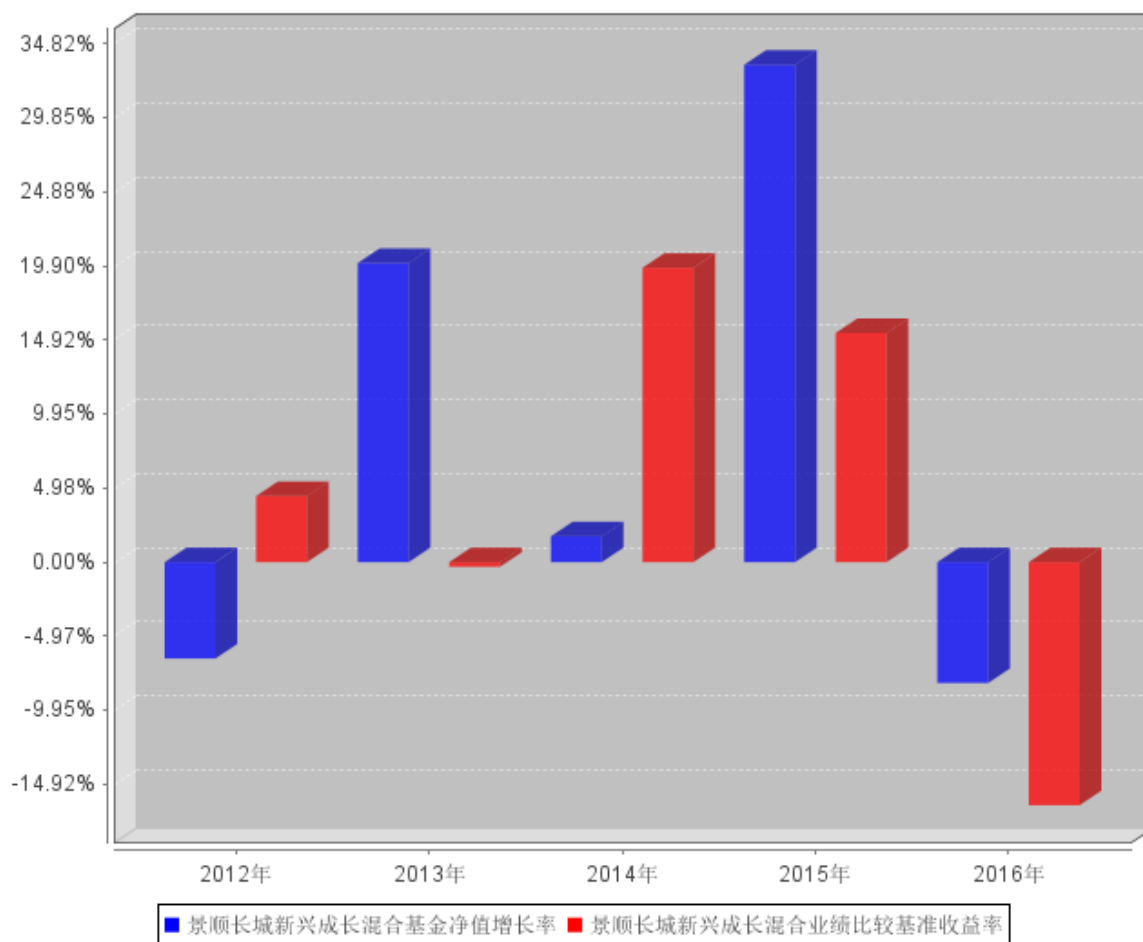
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.25%	0.64%	-1.69%	0.58%	-1.56%	0.06%
过去六个月	0.65%	0.65%	-0.56%	0.66%	1.21%	-0.01%
过去一年	-8.12%	1.68%	-16.33%	1.36%	8.21%	0.32%
过去三年	24.73%	1.97%	15.65%	1.53%	9.08%	0.44%
过去五年	40.11%	1.76%	20.41%	1.38%	19.70%	0.38%
自基金合同生效起至今	113.08%	1.72%	84.08%	1.54%	29.00%	0.18%

### 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资产净值的 65%，持有现金或者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%。本基金投资于成长型上市公司的股票比例高于非现金基金资产的 80%。本基金自 2006 年 6 月 28 日合同生效日起至 2006 年 12 月 27 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



## 3.3 其他指标

无。

## 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	0.070	3,441,217.14	4,494,108.16	7,935,325.30	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	0.070	3,441,217.14	4,494,108.16	7,935,325.30	

## § 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12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理62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、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景盈金利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金。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	本基金的基金经理、研究部总监	2015年4月9日	-	13年	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。
杨鹏	本基金的基金经理	2014年10月31日	2016年1月27日	12年	经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部，担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务。2008年3月加入本公司，担任研究员等职务；自2010年8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、《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

#### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

#### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易现象。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

2016 年，我国经济逐步走出通缩。持续的低利率环境、高强度的基建投资、供给侧主动调整共同推动经济企稳回升。特别从下半年开始，我国工业品价格持续上涨，企业盈利改善。经济再通胀过程中，周期品板块整体表现优异。而前期涨幅巨大的新兴产业板块则由于估值和预期过高，在市场利率回升过程中出现较大幅度回调。

景顺长城新兴成长基金在 2016 年中，继续基于企业本身的经营和财务绩效选择投资标的，自下而上寻找具备高投入资本产出、高成长潜力的企业。我们会根据宏观经济变化在相关受益领域寻找投资机会，但我们主要精力仍然投放在公司的竞争优势分析，以及行业竞争格局变化上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年度，本基金份额净值增长率为-8.12%，业绩比较基准收益率为-16.33%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观方面，现阶段经济仍处于脉冲式复苏阶段。大体量的基建投资以及地产销售刺激过后，经济内生增长动力显现，企业中长期贷款需求恢复，地产及制造业投资逐月反弹。基于价格回升，名义 GDP 继续走高，企业盈利改善。政策面逐步转向风险防范，市场利率回升，预期未来较长时间段内货币政策大概率中性偏紧。

对于股票市场，我们整体持乐观态度。货币政策趋紧、新股扩容等因素在近期的市场调整中已经得到相对充分的体现。很多优质公司估值已经处于偏低水平。我们认为这一轮经济反弹强度仍然需要观察，地产调控、汽车购置税政策调整以及市场利率回升本身都会形成制约，预期市场利率回升空间有限。

市场风格方面，我们认为市场会继续向基本面回归。当前国内外经济环境、流动性状况，市场扩容加速等因素会对市场估值水平形成压制。其中新股扩容不仅仅增加了股票供应，同时将降低已上市公司外延并购预期，从而影响估值水平提升。在估值水平受到压制背景下，盈利增长的确性变得更加重要。行业竞争格局优化、具有明确内生增长能力、估值合理的公司有望受到追捧。食品饮料、轻工、医药、家电、汽车等消费板块值得重点关注。预期高估值品种调整仍会继续，特别是中小市值壳资源价值继续下降。近期表现强势的周期性板块也需要谨慎对待，基于环保等因素的行政去产能会让相关领域大企业受益，但在需求端长期风险始终存在，这个位置已经处于风险偏高区域。

面对经济危机以来的一轮调整，我国经济表现出很好的韧性，我们也期待未来政府能够继续推进改革，进一步提高效率，改善经济运行质量。我们会继续与优秀企业同行，为持有人创造更大的价值。

#### 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其适用性的情况时，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一次利润分配。截止 2015 年 12 月 31 日, 本基金可供分配利润为 15,553,391.39 元, 根据基金合同约定本次应分配金额为 7,776,695.70 元, 本基金的基金管理人已于 2016 年 1 月 21 日完成权益登记, 每 10 份基金份额派发红利 0.07 元, 详细信息请查阅相关分红公告。

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，本基金托管人在对景顺长城新兴成长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，景顺长城新兴成长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新兴成长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，景顺长城新兴成长混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 7,935,325.30 元。

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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城新兴成长混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

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



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城新兴成长混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	69,397,894.83	203,409,817.16
结算备付金	236,312.97	1,027,304.38
存出保证金	160,377.15	444,111.55
交易性金融资产	854,668,690.67	971,076,345.68
其中：股票投资	854,668,690.67	971,076,345.68
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	69,825,304.74	-
应收证券清算款	70,214.07	-
应收利息	34,699.65	52,442.23
应收股利	-	-
应收申购款	1,908.09	9,216.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	994,395,402.17	1,176,019,237.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b> <b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末</b> <b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	22,725,333.90
应付赎回款	567,301.48	1,260,272.09
应付管理人报酬	1,276,044.94	1,459,460.31
应付托管费	212,674.16	243,243.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	274,903.79	617,889.86
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	219,148.76	209,819.80
负债合计	2,550,073.13	26,516,019.34
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,073,573,788.97	1,133,949,826.30
未分配利润	-81,728,459.93	15,553,391.39
所有者权益合计	991,845,329.04	1,149,503,217.69
负债和所有者权益总计	994,395,402.17	1,176,019,237.03

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.924 元，基金份额总额 1,073,573,788.97 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-71,846,493.96	669,418,578.49
1. 利息收入	1,452,013.52	1,671,718.58
其中：存款利息收入	1,184,111.46	1,595,738.40
债券利息收入	44.49	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	267,857.57	75,980.18
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-77,762,057.25	756,529,252.44
其中：股票投资收益	-83,645,017.80	749,226,514.87
基金投资收益	-	-
债券投资收益	40,191.61	-
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	5,842,768.94	7,302,737.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,445,299.81	-88,965,802.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	18,249.96	183,410.36
<b>减：二、费用</b>	20,909,571.30	34,667,552.00
1. 管理人报酬	15,092,997.45	21,817,251.76

2. 托管费	2,515,499.62	3,636,208.60
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,843,530.23	8,758,249.65
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	457,544.00	455,841.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-92,756,065.26</b>	<b>634,751,026.49</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-92,756,065.26</b>	<b>634,751,026.49</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,133,949,826.30	15,553,391.39	1,149,503,217.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-92,756,065.26	-92,756,065.26
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）	-60,376,037.33	3,409,539.24	-56,966,498.09
其中：1. 基金申购款	26,742,201.29	-3,512,810.81	23,229,390.48
2. 基金赎回款	-87,118,238.62	6,922,350.05	-80,195,888.57
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）	-	-7,935,325.30	-7,935,325.30
五、期末所有者权益（基金净值）	1,073,573,788.97	-81,728,459.93	991,845,329.04
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,237,321,845.00	-537,385,379.34	1,699,936,465.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	634,751,026.49	634,751,026.49
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）	-1,103,372,018.70	-81,812,255.76	-1,185,184,274.46
其中：1. 基金申购款	176,248,581.65	-3,297,207.75	172,951,373.90
2. 基金赎回款	-1,279,620,600.35	-78,515,048.01	-1,358,135,648.36
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）	1,133,949,826.30	15,553,391.39	1,149,503,217.69

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

景顺长城新兴成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2006]第 89 号《关于同意景顺长城新兴成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,921,069,020.42 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 86 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 6 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,923,088,471.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,019,451.43 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，基金托管人为中

国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，景顺长城新兴成长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 5 日公告后更名为景顺长城新兴成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金是一只较高持股的混合型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者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%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 成长指数(原名为新华富时 600 成长指数) X 80% + 同业存款利率 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2017 年 3 月 27 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城新兴成长混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 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、登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“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”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
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。

## 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	151,879,944.96	8.18%	-	-

## 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 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 2016年1月1日至2016年12月31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	141,446.09	8.18%	19,644.51	7.47%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 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等。

### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,092,997.45	21,817,251.76
其中：支付销售机构的客户维护费	3,613,687.31	5,208,570.30

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,515,499.62	3,636,208.60

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本报告期和上年度可比期间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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	69,397,894.83	1,167,010.23	203,409,817.16	1,547,762.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 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
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项停牌	168.97	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	191,443.01	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

截至本期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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属于第一层次的余额为 853,987,563.15 元，属于第二层次的余额为 681,127.52 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 933,784,345.68 元，第二层次 37,292,000.00 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(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。

## § 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	854,668,690.67	85.95
	其中：股票	854,668,690.67	85.95
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	69,825,304.74	7.02
	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	69,634,207.80	7.00
7	其他各项资产	267,198.96	0.03
8	合计	994,395,402.17	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	724,424,531.09	73.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,802,474.68	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,021,593.77	7.06
J	金融业	106,780.00	0.01
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,214,306.64	1.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,201,620.00	2.14
R	文化、体育和娱乐业	8,843,874.60	0.89
S	综合	-	-
	合计	854,668,690.67	86.17

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 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	002572	索菲亚	1,550,796	83,991,111.36	8.47
2	600566	济川药业	2,518,369	78,724,214.94	7.94
3	002311	海大集团	4,900,000	73,745,000.00	7.44
4	000418	小天鹅A	1,745,208	56,405,122.56	5.69
5	603899	晨光文具	2,879,766	52,411,741.20	5.28
6	000625	长安汽车	3,325,879	49,688,632.26	5.01
7	300017	网宿科技	917,737	49,199,880.57	4.96
8	000568	泸州老窖	1,477,800	48,767,400.00	4.92
9	000333	美的集团	1,708,722	48,134,698.74	4.85
10	300124	汇川技术	1,999,984	40,659,674.72	4.10

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	300017	网宿科技	80,447,893.97	7.00

2	000418	小天鹅 A	63,224,348.34	5.50
3	000625	长安汽车	51,807,458.70	4.51
4	000063	中兴通讯	42,294,182.27	3.68
5	000333	美的集团	42,011,118.94	3.65
6	300124	汇川技术	41,670,825.60	3.63
7	600566	济川药业	41,636,876.64	3.62
8	603899	晨光文具	36,930,245.15	3.21
9	002475	立讯精密	34,946,144.11	3.04
10	603866	桃李面包	31,512,146.38	2.74
11	000596	古井贡酒	30,973,322.92	2.69
12	300078	思创医惠	28,131,773.60	2.45
13	300166	东方国信	22,989,007.50	2.00
14	300133	华策影视	21,710,087.77	1.89
15	002299	圣农发展	21,574,448.53	1.88
16	300070	碧水源	21,417,567.07	1.86
17	002236	大华股份	21,068,393.35	1.83
18	000550	江铃汽车	20,615,288.76	1.79
19	600519	贵州茅台	19,908,667.66	1.73
20	002007	华兰生物	19,504,234.00	1.70

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	002616	长青集团	53,263,251.89	4.63
2	600201	生物股份	46,954,958.41	4.08
3	600804	鹏博士	46,373,583.44	4.03
4	002174	游族网络	44,087,118.30	3.84
5	002475	立讯精密	39,578,242.23	3.44
6	002303	美盈森	37,458,857.76	3.26
7	000958	东方能源	34,102,544.04	2.97
8	002672	东江环保	34,087,655.80	2.97
9	002250	联化科技	33,914,899.66	2.95
10	300048	合康新能	33,701,391.47	2.93
11	300145	中金环境	31,941,712.06	2.78

12	300017	网宿科技	29,669,432.86	2.58
13	002299	圣农发展	29,028,574.90	2.53
14	600702	沱牌舍得	28,555,723.25	2.48
15	002573	清新环境	27,592,317.74	2.40
16	300359	全通教育	27,357,013.30	2.38
17	300078	思创医惠	25,290,939.10	2.20
18	000902	新洋丰	22,557,483.54	1.96
19	000596	古井贡酒	21,988,161.80	1.91
20	002007	华兰生物	21,183,792.12	1.84

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	913,258,516.92
卖出股票收入（成交）总额	950,466,453.94

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均按买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

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。

### 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	160,377.15
2	应收证券清算款	70,214.07
3	应收股利	-
4	应收利息	34,699.65
5	应收申购款	1,908.09
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	267,198.96

#### 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不存在流通受限的情况。

## § 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 (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
57,161	18,781.58	2,751,216.15	0.26%	1,070,822,572.82	99.74%

### 9.2 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	207,812.92	0.02%

### 9.3 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

- 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（2006年6月28日）基金份额总额	5,923,088,471.85
本报告期期初基金份额总额	1,133,949,826.30
本报告期基金总申购份额	26,742,201.29
减:本报告期基金总赎回份额	87,118,238.62
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	1,073,573,788.97

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

基金管理人重大人事变动：

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。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 11 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	
海通证券股 份有限公司	1	310,581,704.29	16.73%	289,245.52	16.73%	未变更
招商证券股 份有限公司	1	278,407,693.89	15.00%	259,281.91	15.00%	未变更
中信证券股 份有限公司	2	254,314,225.10	13.70%	236,844.02	13.70%	未变更
华创证券有 限责任公司	1	226,280,419.76	12.19%	210,735.16	12.19%	未变更
国金证券股 份有限公司	1	215,304,117.92	11.60%	200,511.38	11.60%	未变更
安信证券股 份有限公司	1	168,600,946.57	9.08%	157,018.24	9.08%	未变更
长城证券股 份有限公司	1	151,879,944.96	8.18%	141,446.09	8.18%	未变更

平安证券股 份有限公司	1	103,695,691.17	5.59%	96,572.65	5.59%	本期新增
方正证券股 份有限公司	1	63,746,612.85	3.43%	59,366.74	3.43%	未变更
天风证券股 份有限公司	1	28,309,527.68	1.53%	26,364.17	1.53%	本期新增
国泰君安证 券股份有限 公司	1	24,643,576.80	1.33%	22,950.85	1.33%	未变更
民生证券股 份有限公司	1	20,196,630.22	1.09%	18,809.11	1.09%	未变更
中国国际金 融股份有限 公司	2	9,927,425.90	0.53%	9,245.62	0.53%	未变更
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变更
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	未变更
第一创业证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证 券股份有限	1	-	-	-	-	未变更

公司						
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	未变更

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
海通证券股份有限公司	215,236.10	100.00%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股 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	-	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	70,000,000.00	100.00%	-	-
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

景顺长城基金管理有限公司

2017 年 3 月 29 日