

景顺长城大中华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	景顺长城大中华混合(QDII)
场内简称	无
基金主代码	262001
交易代码	262001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月22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	120,343,829.80份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略，在实际投资组合的构建上更偏重“自下而上”的部分，重点投资于处于合理价位的成长型股票（Growth at Reasonable Price, GARP）以及受惠于盈利周期加速且估值便宜的品质型股票（value + catalyst）。
业绩比较基准	摩根斯坦利金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。同时，本基金投资的目标市场是海外市场，除了需要承担市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、不同地区以及国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。

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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Invesco Hong Kong Limited	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	景顺投资管理有限公司	渣打银行（香港）有限公司
注册地址		香港中环花园道3号花旗银行大厦41楼	香港中环德辅道中四至四A渣打银行大厦三十二楼
办公地址		香港中环花园道3号花旗银行大厦41楼	香港中环德辅道中四至四A渣打银行大厦三十二楼
邮政编码		-	-

2.5 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	11,845,868.32	-29,156,564.17	-161,044.61
本期利润	12,953,655.66	-27,628,828.74	-240,931.94
加权平均基金份额本期利润	0.0919	-0.2902	-0.0143
本期基金份额净值增长率	7.01%	-10.83%	0.08%
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	0.2429	0.1694	0.3106
期末基金资产净值	150,498,078.69	144,794,194.46	19,814,431.83
期末基金份额净值	1.251	1.169	1.311

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。

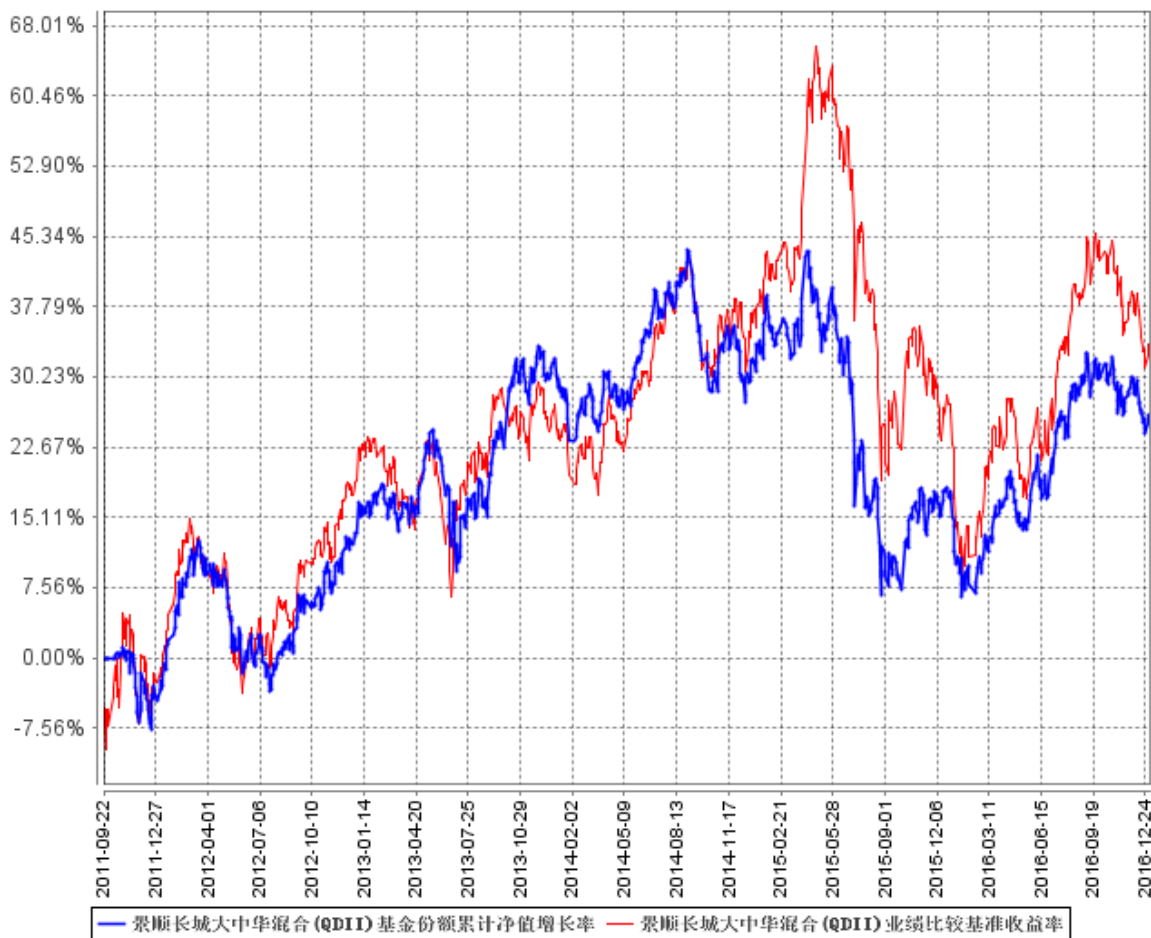
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

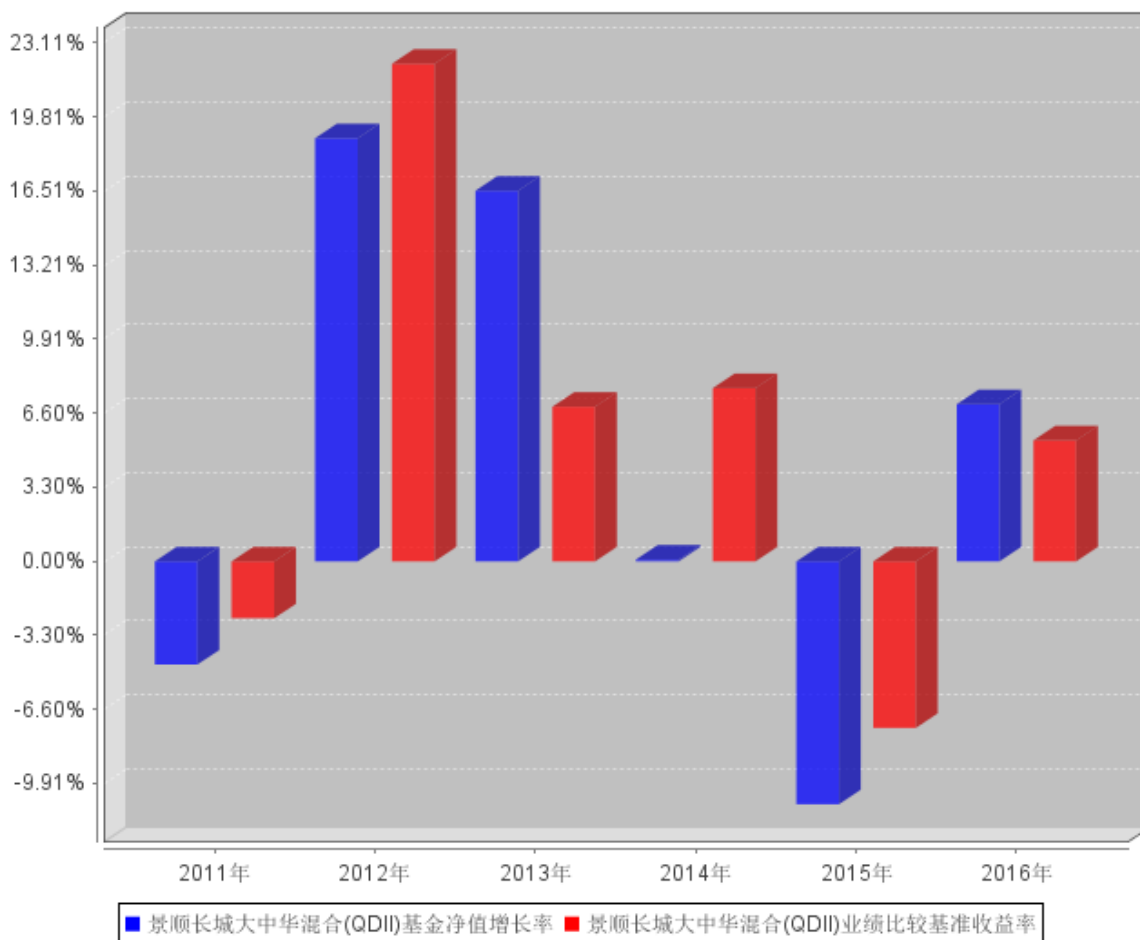
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.02%	0.71%	-6.29%	0.80%	3.27%	-0.09%
过去六个月	5.13%	0.79%	5.83%	0.87%	-0.70%	-0.08%
过去一年	7.01%	0.85%	5.40%	1.08%	1.61%	-0.23%
过去三年	-4.50%	0.89%	5.10%	1.09%	-9.60%	-0.20%
过去五年	32.28%	0.87%	37.28%	1.05%	-5.00%	-0.18%
自基金合同生效起至今	26.19%	0.87%	33.79%	1.13%	-7.60%	-0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的资产配置比例为：股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的80%；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%。本基金的建仓期为自2011年9月22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。

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



注：2011年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是2011年9月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、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		
黎海威	本基金的基金经理、量化及ETF投资部投资总监	2016年6月3日	-	13年	经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，担任量化及ETF投资部投资总监；自2013年10月起担

					任基金经理。
谢天翎	本基金的 基金经理	2011年9月 22日	2016年6月22日	15年	商学硕士， CFA。曾任台湾保诚证券投资信托股份有限公司股票投资暨研究部海外组副理和基金经理。2008年4月加入本公司，担任国际投资部高级经理职务；自2011年9月起担任基金经理。
周寒颖	本基金的 基金经理	2016年6月 3日	-	10年	管理学硕士。曾担任招商基金研究部研究员和高级研究员、国际业务部高级研究员等职务。2015年7月加入本公司，担任研究部高级研究员职务；自2016年6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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
萧光一(Mike Shiao)	首席投资总监	24	美国宾夕法尼亚州卓克索大学(Drexel University)金融理学硕士。2002年加盟景顺，并于2015年出任大中华首席投资总监，专门负责大中华地区市场(香港、中国及台湾)，并担任景顺大中华基金及景顺中国智选基金的首席基金经理；与此同时，自2012年6月起负责 Invesco Perpetual Hong Kong & China Fund 的基金管理。在此之前，为台湾景顺投信的股票部主管，负责台湾的股票团队及投资程序，并管理一项在台湾注册的单位信托基金。1992年开始投身投资业界，在 Grand Regent Investment 担任项目经理达六年之久，管理中国及台湾的创业基金活动。1997年加盟 Overseas Credit and Securities Incorporated, 担任

			高级分析师, 负责研究台湾的科技行业。在 2002 年加盟景顺前, 曾于 Taiwan International Investment Management Co. 任职三年, 负责科技业的研究工作, 并管理一项场外交易基金。
--	--	--	--

4.3 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、《景顺长城大中华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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如1日内、3日、5日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年大中华市场表现分化，各个区域涨跌不一，其中台湾加权指数上涨10.98%，香港恒生指数基本持平，小幅上涨0.39%，MSCI中国指数下跌1.38%。回顾全年，1季度全球经济前景黯淡；2季度国内经济增长好于预期，流动性持续改善叠加避险需求，大型股票跑赢小型股票；3季度外围市场不确定性增加，包括9月欧洲、日本央行量化宽松，美联储加息预期升温，以及立法会选举、产油国非正式会议等，诸多风险事件导致市场呈波动走势；4季度伴随特朗普上台，美国加息，风险集中释放，美国市场屡创新高，周期板块依然维持强势。同时深港通于12月5日正式启动，短期未有显著的“开闸放水”效果，但市场情绪乐观。长期来看，内地资金流入将是细水长流，港股市场结构性变化将实现从量变到质变的过程。

回顾全年，我们维持了消费、科技产业的核心配置。上半年集中仓位，坚守低估值高成长个股，使得基金业绩在下跌震荡行情中具有领先优势。下半年市场大涨大跌行情中，个股估值层面未成功切换使得部分获利回吐。

4.5.2 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7.01%，业绩比较基准收益率为5.40%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，上半年低基数、库存周期、供给收缩使得经济呈现温和通胀局面。国企改革提速、一带一路推进有利于增强国际市场对中国资产信心。加上人民币贬值阶段性企稳，资金面较去年下半年宽松，港股市场将在上半年温和窗口期回升。展望下半年，伴随美国加息，特朗普总统的政策颁布，新兴市场不确定性上升。整体上看，沪港通资金南下改善了港股市场流动性，有利于行业龙头估值抬升，A股与H股差价有望收窄。低估值、存在预期差的行业和个股将有机会带来超额收益。

4.7 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。风险管理人員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

相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 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。

4.9 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大中华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，景顺长城大中华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大中华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，景顺长城大中华混合型证券投资基金未进行利润分配。

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大中华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：景顺长城大中华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	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
资产:		
银行存款	35,612,049.32	33,588,701.50
结算备付金	2,016,704.96	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	113,708,890.25	111,617,050.03
其中: 股票投资	113,708,890.25	111,617,050.03
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	5,263.91	1,217.84
应收股利	18,480.09	16,336.82
应收申购款	5,294.76	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	151,366,683.29	145,223,306.19
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	340,236.30	-
应付赎回款	2,980.83	26,266.90
应付管理人报酬	247,027.35	219,975.53
应付托管费	48,033.08	42,773.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	70,315.57	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,011.47	140,096.29
负债合计	868,604.60	429,111.73
所有者权益:		
实收基金	120,343,829.80	123,817,850.83
未分配利润	30,154,248.89	20,976,343.63
所有者权益合计	150,498,078.69	144,794,194.46
负债和所有者权益总计	151,366,683.29	145,223,306.19

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.251 元，基金份额总额 120,343,829.80 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	18,886,190.38	-23,407,676.27
1. 利息收入	85,429.29	46,635.56
其中：存款利息收入	85,429.29	46,635.56
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	15,426,611.61	-23,395,581.91
其中：股票投资收益	12,475,039.65	-25,460,865.14
基金投资收益	-33,603.24	-912,060.55
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,985,175.20	2,977,343.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,107,787.34	1,527,735.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	2,189,679.15	-1,671,599.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	76,682.99	85,133.65
减：二、费用	5,932,534.72	4,221,152.47
1. 管理人报酬	3,063,812.62	2,039,023.33
2. 托管费	595,741.30	396,476.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,892,494.84	1,425,448.14
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	380,485.96	360,204.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	12,953,655.66	-27,628,828.74

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	12,953,655.66	-27,628,828.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华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）	123,817,850.83	20,976,343.63	144,794,194.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	12,953,655.66	12,953,655.66
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）	-3,474,021.03	-3,775,750.40	-7,249,771.43
其中：1. 基金申购款	47,877,991.96	10,065,844.63	57,943,836.59
2. 基金赎回款	-51,352,012.99	-13,841,595.03	-65,193,608.02
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）	120,343,829.80	30,154,248.89	150,498,078.69
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）	15,118,690.12	4,695,741.71	19,814,431.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-27,628,828.74	-27,628,828.74
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）	108,699,160.71	43,909,430.66	152,608,591.37

其中：1. 基金申购款	162,208,191.93	61,446,669.40	223,654,861.33
2. 基金赎回款	-53,509,031.22	-17,537,238.74	-71,046,269.96
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）	123,817,850.83	20,976,343.63	144,794,194.46

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

景顺长城大中华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”)证监许可[2011]第709号《关于核准景顺长城大中华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《景顺长城大中华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291,060,560.03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(2011)第367号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于2011年9月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为291,092,562.55份基金份额，其中认购资金利息折合32,002.52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，境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。

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》，景顺长城大中华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大中华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《景顺长城大中华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股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业

的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；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：摩根斯坦利金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。

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》、《景顺长城大中华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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》

、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》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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
渣打银行(香港)有限公司(“渣打银行”)	境外资产托管人
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

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及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

本基金本报告期和上年度可比期间未发生关联方佣金支出。

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	3,063,812.62	2,039,023.33
其中：支付销售机构的客户维护费	134,451.30	178,138.94

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 1.8% 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 1.8% / 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	595,741.30	396,476.69

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 0.35% 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 0.35% / 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	23,971,492.22	77,438.90	5,430,749.97
渣打银行	11,640,557.10	3,100.91	28,157,951.53	2,334.23

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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的金融工具中属于第一层次的余额为 113,708,890.25 元，无属于第二层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 111,617,050.03 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(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	113,708,890.25	75.12
	其中：普通股	102,913,485.82	67.99
	存托凭证	10,795,404.43	7.13
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	37,628,754.28	24.86
8	其他各项资产	29,038.76	0.02
9	合计	151,366,683.29	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币

元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	10,795,404.43	7.17
台湾地区	16,619,994.33	11.04
香港特别行政区	86,293,491.49	57.34
合计	113,708,890.25	75.56

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币

元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
基础材料	2,836,070.79	1.88
通讯	26,856,406.66	17.85
消费品，周期性	20,870,269.01	13.87
消费品，非周期性	22,521,543.42	14.96
综合经营	-	-
能源	4,634,456.31	3.08
金融	-	-
工业	12,087,200.94	8.03
科技	19,332,265.38	12.85
公用事业	4,570,677.74	3.04
合计	113,708,890.25	75.56

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾积体电路制造股份有限公司	2330 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	301,000	11,735,267.14	7.80
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	64,600	10,961,880.13	7.28
3	CHINA MOBILE LTD	中国移动有限公司	941 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	103,500	7,610,222.73	5.06
4	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	美国 - 纽约证券交易所	美国	11,895	7,245,696.16	4.81
5	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	周黑鸭国际有限公司	1458 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	976,500	5,939,725.30	3.95
6	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	中国软件国际有限公司	354 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	1,562,000	5,085,897.61	3.38
7	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光电股份有限公司	3008 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	6,000	4,884,727.19	3.25
8	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际集团	2313 HK	香港 - 香港联	香港特别行政区	107,000	4,694,701.56	3.12

				合交易所				
9	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	942,000	4,634,456.31	3.08
10	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气股份有限公司	3898 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	124,500	4,382,271.56	2.91

注：1) 本基金对以上证券采用彭博代码即 BB Ticker。

2) 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益投资明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	AIA GROUP LTD	1299 HK	14,837,763.42	10.25
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	14,210,607.99	9.81
3	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	12,083,541.30	8.35
4	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	1458 HK	11,646,204.54	8.04
5	CHINA MOBILE LTD	941 HK	11,053,099.22	7.63
6	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	10,754,044.95	7.43
7	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	10,180,670.91	7.03
8	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	9,916,625.42	6.85
9	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	220 HK	9,609,460.74	6.64
10	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	8,935,454.00	6.17

11	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	8,561,480.80	5.91
12	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	8,509,357.69	5.88
13	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	392 HK	8,306,202.09	5.74
14	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	7,327,784.45	5.06
15	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	6,803,953.10	4.70
16	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	6,597,855.97	4.56
17	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	6,501,041.76	4.49
18	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	3331 HK	6,264,747.70	4.33
19	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	6,240,613.96	4.31
20	LARGAN PRECISION CO LTD	3008 TT	6,061,528.46	4.19
21	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	5,611,763.63	3.88
22	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	5,556,756.28	3.84
23	TAL EDUCATION GROUP-ADR	XRS US	5,512,092.31	3.81
24	MEDIATEK INC	2454 TT	5,403,524.32	3.73
25	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1476 TT	5,265,727.86	3.64
26	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	5,246,818.86	3.62
27	MINTH GROUP LTD	425 HK	5,141,153.52	3.55
28	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	5,118,234.71	3.53
29	CHINA POWER INTERNATIONAL	2380 HK	5,110,434.88	3.53
30	VIRSCEND EDUCATION CO LTD	1565 HK	5,064,240.00	3.50
31	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	6 HK	4,800,255.90	3.32
32	PING AN INSURANCE	2318 HK	4,735,590.13	3.27

	GROUP CO-H			
33	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	4,507,957.47	3.11
34	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	2018 HK	4,425,104.46	3.27
35	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	4,340,992.28	3.00
36	STELLA INTERNATIONAL	1836 HK	4,309,972.71	2.98
37	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	4,244,203.73	2.93
38	POU SHENG INTL HOLDINGS LTD	3813 HK	4,215,489.74	2.91
39	CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	291 HK	3,964,542.41	2.74
40	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	3,891,167.47	2.69
41	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	551 HK	3,625,814.54	2.50
42	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP- H	2238 HK	3,505,124.72	2.42
43	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	3,409,481.38	2.35
44	IMAX CHINA HOLDING INC	1970 HK	3,407,707.88	2.35
45	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1929 HK	3,306,511.79	2.28
46	FU SHOU YUAN INTERNATIONAL	1448 HK	3,304,659.39	2.28
47	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	3,197,335.73	2.21
48	CAR INC	699 HK	3,190,221.03	2.20
49	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	3,022,278.79	2.09
50	NETEASE INC-ADR	NTES US	2,986,089.94	2.06
51	SUN ART RETAIL GROUP LTD	6808 HK	2,920,803.51	2.02

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币

元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1 HK	14,999,877.84	10.36
2	AIA GROUP LTD	1299 HK	14,827,099.61	10.24
3	MINTH GROUP LTD	425 HK	12,613,267.25	8.71
4	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	12,576,501.88	8.69
5	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	10,823,567.75	7.48
6	CHINA MOBILE LTD	941 HK	10,526,289.61	7.27
7	MAX CHINA HOLDING INC	1970 HK	9,904,258.02	6.84
8	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	9,824,796.35	6.79
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	8,602,455.92	5.94
10	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	8,099,545.46	5.59
11	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	392 HK	7,943,998.90	5.49
12	ZHOU HEI YA INTERNATIONAL HO	1458 HK	7,652,119.95	5.28
13	CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	354 HK	7,589,048.98	5.24
14	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1038 HK	7,512,507.97	5.19
15	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2689 HK	7,233,055.68	5.00
16	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	551 HK	6,933,629.74	4.79
17	MAN WAH HOLDINGS LTD	1999 HK	6,827,061.87	4.72
18	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	762 HK	6,621,846.14	4.57
19	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	6,526,519.79	4.51
20	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	3898 HK	6,520,416.97	4.50
21	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1476 TT	6,369,310.09	4.40
22	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	BABA US	6,337,704.88	4.38
23	TAIWAN	2330 TT	6,289,945.82	4.34

	SEMICONDUCTOR MANUFAC			
24	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	6,140,192.96	4.24
25	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	220 HK	6,128,685.64	4.23
26	KINGSOFT CORP LTD	3888 HK	6,031,193.57	4.17
27	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	371 HK	5,776,670.94	3.99
28	TAL EDUCATION GROUP-ADR	XRS US	5,732,243.30	3.96
29	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	5,671,360.15	3.92
30	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	1193 HK	5,422,098.77	3.74
31	STELLA INTERNATIONAL	1836 HK	5,216,729.69	3.60
32	MEDIATEK INC	2454 TT	5,196,117.13	3.59
33	VIRSCEND EDUCATION CO LTD	1565 HK	5,094,763.69	3.52
34	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	5,068,955.74	3.50
35	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	4,842,419.54	3.34
36	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	4,821,944.35	3.33
37	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	4,755,791.93	3.28
38	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	4,673,986.33	3.23
39	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	6 HK	4,664,268.80	3.22
40	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	4,410,989.96	3.05
41	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	4,383,642.88	3.03
42	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	4,094,744.72	2.83
43	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	4,016,630.04	2.77
44	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	3,890,043.40	2.69

45	SANDS CHINA LTD	1928 HK	3,754,947.22	2.59
46	SUN ART RETAIL GROUP LTD	6808 HK	3,492,076.24	2.41
47	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	3,365,625.60	2.32
48	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	3,349,826.69	2.31
49	TOWNGAS CHINA CO LTD	1083 HK	3,264,182.81	2.25
50	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	EDU US	3,253,380.74	2.25
51	CAR INC	699 HK	2,968,257.90	2.05
52	CHINA POWER INTERNATIONAL	2380 HK	2,957,160.25	2.04
53	CHIN-POON INDUSTRIAL CO LTD	2355 TT	2,903,411.86	2.01
54	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	315 HK	2,894,472.95	2.00

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	365,481,589.40
卖出收入（成交）总额	376,972,576.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	18,480.09
4	应收利息	5,263.91
5	应收申购款	5,294.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,038.76

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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

728	165,307.46	108,174,107.88	89.89%	12,169,721.92	10.11%
-----	------------	----------------	--------	---------------	--------

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	455,815.57	0.38%

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

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	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月22日）基金份额总额	291,092,562.55
本报告期期初基金份额总额	123,817,850.83
本报告期基金总申购份额	47,877,991.96
减：本报告期基金总赎回份额	51,352,012.99
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	120,343,829.80

§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，聘任杨皦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6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60,000.00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	
DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	29,996,289.75	4.04%	44,994.44	4.08%	未变更
Yuanta securities company limited	-	8,775,118.74	1.18%	13,162.85	1.19%	未变更
Haitong International Securities Company Limited	-	39,845,900.79	5.37%	85,424.08	7.75%	未变更
中信建投证券股份有限公司	-	87,894,496.59	11.84%	70,315.57	6.38%	未变更
ICBC International Holdings Limited	-	15,980.65	0.00%	23.97	0.00%	新增
China International Capital Corporation Limited	-	256,885,756.91	34.60%	336,130.06	30.48%	未变更
Masterlink Securities Corporation	-	43,439,049.55	5.85%	52,124.81	4.73%	未变更
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	10,268,596.80	1.38%	102,685.97	9.31%	新增
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	265,332,975.79	35.74%	397,999.53	36.09%	未变更
Morgan Stanley&Co. International plc	-	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序：

1) 选择标准

券商的选择基于最佳执行、研究报告质量、财务健全度、交易执行速度、费用、信赖度及负责任的回报等因素。选择标准包括但不限于：

- 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、交易券商必需是主要海外证券交易所的成员；
- d、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，有良好的执行能力，且其作业程序需尽责完善。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta securities company limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-2,060,873.28	30.11%
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-4,782,603.58	69.89%
Morgan Stanley&Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-

§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