

景顺长城动力平衡证券投资基金 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	景顺长城动力平衡混合
场内简称	无
基金主代码	260103
交易代码	260103
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金
系列其他子基金名称	景顺长城货币（260102）、景顺长城优选混合（260101）
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 10 月 24 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	1,956,524,544.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本系列基金运用专业化的投资管理，为基金持有人提供长期稳定并可持续的资本增值，动力平衡基金以获取高于业绩比较基准的回报为目标，注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾，争取为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	通过在股票、债券和现金之间动态的资产配置来获得资本保全，并获得稳定的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×45%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金是一种具有中等风险的投资工具，除了结合景顺长城股票及债券投资的风险管理程序以外，为达到平稳回报的目的，该基金还将独立地对风险来源进行评估，并设立额外的风险控制管理手段。

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	杨焱阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	61,574,587.28	1,301,023,928.82	121,384,911.30
本期利润	-6,738,896.95	1,085,747,026.65	245,910,723.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0035	0.3851	0.0462
本期基金份额净值增长率	-0.32%	20.27%	8.55%
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	-0.1276	-0.1248	-0.2733
期末基金资产净值	1,706,874,019.71	1,658,945,635.77	3,347,783,395.23
期末基金份额净值	0.8724	0.8752	0.7277

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、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。

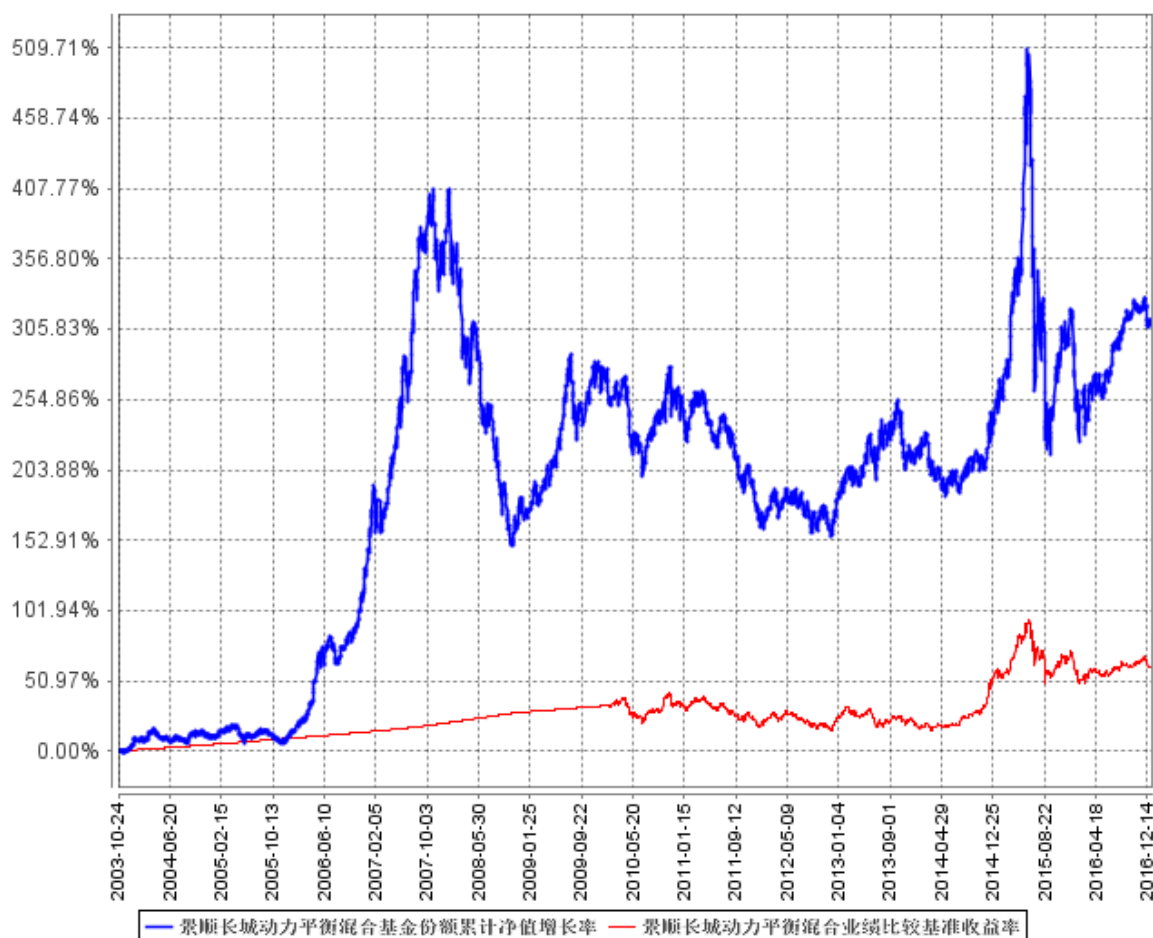
3.2 基金净值表现

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	-1.04%	0.61%	0.03%	0.39%	-1.07%	0.22%
过去六个月	7.96%	0.61%	2.53%	0.40%	5.43%	0.21%
过去一年	-0.32%	1.34%	-4.65%	0.71%	4.33%	0.63%
过去三年	30.13%	1.69%	34.30%	0.90%	-4.17%	0.79%
过去五年	52.01%	1.49%	35.63%	0.81%	16.38%	0.68%
自基金合同生效起至今	312.99%	1.31%	61.55%	0.57%	251.44%	0.74%

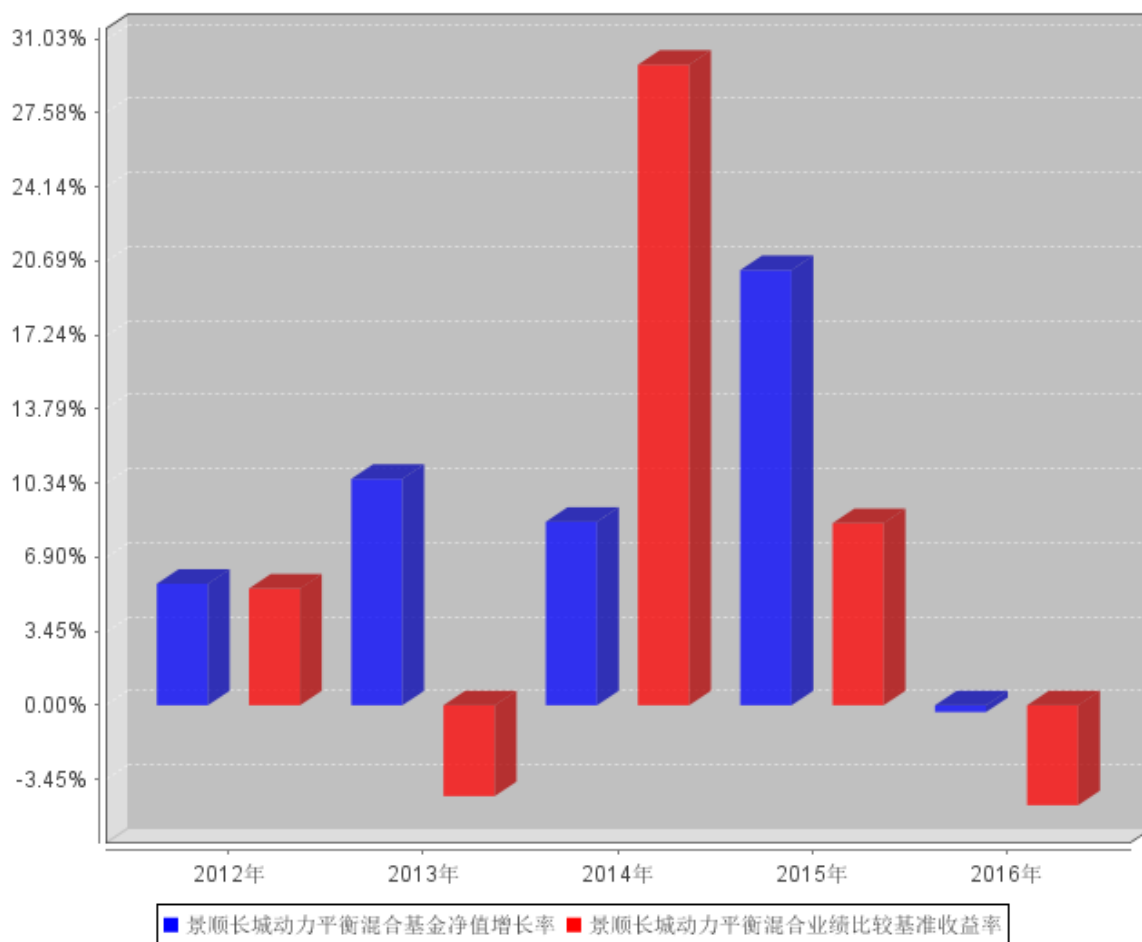
注：自 2010 年 1 月 29 日起，本基金的业绩比较基准由“一年期银行定期存款年利率的 2 倍”变更为“沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×45%+银行同业存款收益率×5%”。

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：股票投资的比例为基金资产净值的 20%至 80%；债券投资的比例为基金资产净值的 20%至 80%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自 2003 年 10 月 24 日合同生效日起至 2004 年 1 月 23 日为建仓期。本基金于 2007 年 9 月 10 日实施分红，此后基金资产规模持续增长，根据基金部函[2007]91 号《关于实施基金份额拆分后调整基金建仓期有关问题的复函》的有关规定，本基金证券投资比例的调整期限延长至 2007 年 10 月 9 日止。建仓期结束时，本基金投资组合均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

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		
刘苏	本基金的基金经理	2015 年 9 月 29 日	-	11 年	理学硕士。曾担任深圳国际信托投资有限公司（现华润深国投信托）信托经理，鹏华基金高级研究员、基金经理助理、基金经理职务。2015 年 5 月加入本公司，自 2015 年 9 月起担任基金经理。
刘彦春	本基金的基金经理、研究部总监	2015 年 7 月 10 日	2016 年 11 月 8 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。

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、《景顺长城景系列开放式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

报告期内，A 股各指数普遍先抑后扬，在经历年初“熔断”大幅下跌后，股指缓慢回升，全年市场结构分化显著。上半年低估值蓝筹板块如家电、汽车、食品饮料等行业表现突出，年中以后，受益于供给侧改革及经历多年产能去化的部分周期性行业如煤炭、有色、钢铁、建材等行业

涨幅也较大。前几年表现突出的 TMT 板块依然处于压缩估值泡沫的阶段，全年股价表现缺乏亮点。从整个报告期看，基金管理人在年初市场大幅下跌后，一直保持较高的股票仓位，同时通过积极的个股选择，优化投资组合的风险收益比，以期为投资者获得中长期的合理回报。

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-0.32%，业绩比较基准收益率为-4.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2016 年经济形势，上半年稳增长政策以及房地产、汽车行业的旺销对于经济起到了比较明显的支撑作用，使得下半年经济数据显著改善。但大宗商品价格反弹、金融杠杆过高导致资产价格上涨也引起了政府的注意，2016 年底的中央经济工作会议将防范金融风险放在了更为重要的位置，并相对弱化了稳增长的目标。实际上，2016 年 4 季度以来，国内债券市场的剧烈调整即是货币政策方面有意趋紧的信号。2017 年春节前后央行上调逆回购利率及中短期货币工具的利率，都清楚的表明过去几年的宽货币环境已经结束，投资人很难期待 A 股市场整体估值扩张发生。但是 A 股市场经过一年多的调整，估值泡沫已经大幅压缩，整体估值水平已经接近历史平均水平，部分行业估值水平已经展现出长期吸引力。在我们的框架中，尽管缺乏货币宽松这一基础条件导致我们依然看不到股票市场趋势性的机会，但结构性机会已经开始逐步增多，因此我们对于股票市场的态度也并不悲观。需要关注的风险点是在过去两年相对宽松的货币、财政政策刺激下的基建投资和地产销售，2017 年可能面临较大的不确定性。尤其是 PPP 等新模式在基建投资领域能否真正对冲财政投入的放缓，是我们需要密切关注的点。另外到了下半年，部分之前估值过高的成长股以 2018 年的估值水平来看或许吸引力会越来越大，或许存在市场风格转换的机会，也值得密切关注。中国经济的大部分市场化领域已经渡过了短缺时代，进入过剩时代，这意味着这些领域的企业经营状态将发生巨大的分化，选股将变得更为重要。基金管理人将坚持长期价值投资的理念，把控制风险收益比作为首要前提，重点选择两类投资机会进行布局，其一是那些产业或企业发展尚处于初、中期，且公司有显著差异化竞争优势或领先性的品种；其二是寻找市场预期较低、安全边际充分但有新的增长因素出现的品种，以期为投资人带来较好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制

定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资片、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据投资人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供在证券交易所上市或挂牌转让的

固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城动力平衡证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告期内，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：景顺长城动力平衡证券投资基金

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
资产：		
银行存款	116,670,658.01	44,746,326.44
结算备付金	2,367,032.61	2,651,333.02
存出保证金	389,833.46	743,570.34
交易性金融资产	1,587,287,208.40	1,508,783,525.83
其中：股票投资	1,206,887,208.40	1,157,803,525.83
基金投资	-	-
债券投资	380,400,000.00	350,980,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	100,000,170.00
应收证券清算款	6,852,415.50	-
应收利息	7,102,481.65	8,576,947.15
应收股利	-	-
应收申购款	336,888.39	27,902.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,721,006,518.02	1,665,529,775.41
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 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	8,474,731.33	-
应付赎回款	912,396.08	1,681,288.14
应付管理人报酬	2,267,951.88	2,088,983.10
应付托管费	377,991.99	348,163.84
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,456,628.93	1,809,785.04
应交税费	489,361.60	489,361.60

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	153,436.50	166,557.92
负债合计	14,132,498.31	6,584,139.64
所有者权益：		
实收基金	1,956,524,544.95	1,895,412,218.12
未分配利润	-249,650,525.24	-236,466,582.35
所有者权益合计	1,706,874,019.71	1,658,945,635.77
负债和所有者权益总计	1,721,006,518.02	1,665,529,775.41

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8724 元，基金份额总额

1,956,524,544.95 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城动力平衡证券投资基金

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	28,519,589.11	1,149,946,243.55
1. 利息收入	12,236,220.80	21,703,716.39
其中：存款利息收入	1,154,747.64	1,209,489.31
债券利息收入	10,731,267.35	20,403,619.31
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	350,205.81	90,607.77
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	84,357,267.34	1,343,427,158.14
其中：股票投资收益	79,147,798.96	1,331,805,728.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-962,060.64	481,206.15
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	6,171,529.02	11,140,223.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-68,313,484.23	-215,276,902.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	239,585.20	92,271.19

减：二、费用	35,258,486.06	64,199,216.90
1. 管理人报酬	23,997,656.17	36,964,722.93
2. 托管费	3,999,609.34	6,160,787.04
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,987,918.86	20,780,588.03
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	273,301.69	293,118.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,738,896.95	1,085,747,026.65
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,738,896.95	1,085,747,026.65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城动力平衡证券投资基金

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）	1,895,412,218.12	-236,466,582.35	1,658,945,635.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,738,896.95	-6,738,896.95
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）	61,112,326.83	-6,445,045.94	54,667,280.89
其中：1. 基金申购款	456,279,747.96	-59,488,032.66	396,791,715.30
2. 基金赎回款	-395,167,421.13	53,042,986.72	-342,124,434.41
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）	1,956,524,544.95	-249,650,525.24	1,706,874,019.71

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）	4,600,730,553.07	-1,252,947,157.84	3,347,783,395.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,085,747,026.65	1,085,747,026.65
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）	-2,705,318,334.95	-69,266,451.16	-2,774,584,786.11
其中：1. 基金申购款	141,014,456.86	-2,277,291.17	138,737,165.69
2. 基金赎回款	-2,846,332,791.81	-66,989,159.99	-2,913,321,951.80
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）	1,895,412,218.12	-236,466,582.35	1,658,945,635.77

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

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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[2003]第 96 号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 10 月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为景顺长城动力平衡证券投资基金(以下简称“本基金”)、景顺长城优选股票证券投

资基金和景顺长城货币市场证券投资基金(2005年7月15日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金)。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,835,000,215.28元,其中包括本基金人民币540,701,410.62元、景顺长城优选股票证券投资基金人民币820,829,988.03元和景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币473,468,816.63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(2003)第144号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币782,418.90元在基金募集期结束时计入投资者认购账户,折合成782,418.90份基金份额,其中本基金261,168.43份基金份额、景顺长城优选股票证券投资基金262,508.27份基金份额、景顺长城恒丰债券证券投资基金258,742.20份基金份额,归投资者所有。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城景系列开放式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。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的A股;债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转债等。在正常情况下,本基金的资产配置比例为:股票投资占基金资产净值的20%-80%,债券投资占基金资产净值的20%-80%。本基金的原业绩比较基准为:一年期银行定期存款年利率的2倍,根据本基金的基金管理人发布的《景顺长城动力平衡证券投资基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》,本基金的业绩比较基准自2010年1月29日起变更为:沪深300指数收益率 X 50% + 中国债券总指数收益率 X 45% + 银行同业存款收益率 X 5%。

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》、《景顺长城动力平衡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相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[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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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
中国银行股份有限公司(“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	72,746,980.32	1.58%	1,446,420,522.34	11.28%

7.4.8.1.2 权证交易

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	67,748.99	1.58%	-	-
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	1,322,346.70	11.28%	93,446.95	5.16%

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 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
	当期发生的基金应支付的管理费	23,997,656.17
其中：支付销售机构的客户维护费	6,229,144.37	10,225,170.29

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 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

当期发生的基金应支付的托管费	3,999,609.34	6,160,787.04
----------------	--------------	--------------

注：支付基金托管人中国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
	中国银行	116,670,658.01	1,104,906.76	44,746,326.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期和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 燃气	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
002664	信质电机	2016年 12月 16日	重大 事项 停牌	25.40	-	-	2,098,749	54,146,818.80	53,308,224.60	-
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 1,152,897,856.28 元，属于第二层次的余额为 434,389,352.12 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,110,337,830.31 元，第二层次 398,445,695.52 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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：未持有)。

(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	1,206,887,208.40	70.13
	其中：股票	1,206,887,208.40	70.13
2	固定收益投资	380,400,000.00	22.10
	其中：债券	380,400,000.00	22.10
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	119,037,690.62	6.92
7	其他各项资产	14,681,619.00	0.85
8	合计	1,721,006,518.02	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	1,118,666,891.73	65.54
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	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,794,192.20	2.39
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	47,256,375.90	2.77

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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,206,887,208.40	70.71

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	300156	神雾环保	3,663,267	91,618,307.67	5.37
2	600201	生物股份	2,809,936	88,765,878.24	5.20
3	002572	索菲亚	1,585,658	85,879,237.28	5.03
4	300145	中金环境	3,111,465	81,209,236.50	4.76
5	002616	长青集团	3,900,000	77,766,000.00	4.56
6	300207	欣旺达	5,426,377	75,426,640.30	4.42
7	300203	聚光科技	2,461,488	75,198,458.40	4.41
8	000967	盈峰环境	5,162,366	72,169,876.68	4.23
9	000333	美的集团	2,507,020	70,622,753.40	4.14
10	300064	豫金刚石	5,965,896	67,712,919.60	3.97

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	000333	美的集团	102,230,905.96	6.16
2	002664	信质电机	100,988,458.21	6.09
3	300156	神雾环保	88,508,748.88	5.34
4	601009	南京银行	88,304,542.41	5.32
5	300203	聚光科技	83,195,954.01	5.01
6	300207	欣旺达	78,656,149.21	4.74
7	600487	亨通光电	77,092,461.90	4.65
8	300166	东方国信	70,489,654.56	4.25
9	002303	美盈森	68,835,210.15	4.15
10	600104	上汽集团	68,085,447.52	4.10
11	600240	华业资本	67,180,742.54	4.05
12	300064	豫金刚石	64,651,548.76	3.90
13	002123	梦网荣信	64,598,994.02	3.89
14	002475	立讯精密	62,130,415.80	3.75
15	000651	格力电器	60,289,843.92	3.63
16	600660	福耀玻璃	57,879,565.87	3.49
17	600919	江苏银行	56,258,152.00	3.39
18	000820	神雾节能	55,379,780.07	3.34
19	000967	盈峰环境	54,516,068.82	3.29
20	603609	禾丰牧业	53,667,653.37	3.24
21	002311	海大集团	52,260,889.46	3.15
22	600856	中天能源	48,903,305.97	2.95
23	002299	圣农发展	46,004,307.79	2.77
24	601021	春秋航空	45,922,160.24	2.77
25	600535	天士力	41,508,727.92	2.50
26	002616	长青集团	41,268,011.94	2.49
27	300011	鼎汉技术	39,634,688.04	2.39
28	300115	长盈精密	37,459,677.67	2.26
29	300145	中金环境	35,498,445.36	2.14
30	001979	招商蛇口	34,576,789.17	2.08

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	002475	立讯精密	99,094,698.22	5.97
2	002311	海大集团	96,066,483.16	5.79
3	601009	南京银行	90,258,503.61	5.44
4	002303	美盈森	85,464,071.54	5.15
5	000820	神雾节能	77,205,278.56	4.65
6	600804	鹏博士	75,991,486.07	4.58
7	600660	福耀玻璃	69,423,543.16	4.18
8	601021	春秋航空	68,852,985.01	4.15
9	300166	东方国信	67,520,272.01	4.07
10	000958	东方能源	63,332,974.37	3.82
11	600856	中天能源	60,267,404.13	3.63
12	002664	信质电机	59,456,882.92	3.58
13	000651	格力电器	56,874,866.71	3.43
14	300145	中金环境	56,586,166.91	3.41
15	002299	圣农发展	53,638,995.39	3.23
16	000333	美的集团	52,724,831.77	3.18
17	600919	江苏银行	49,850,465.00	3.00
18	002572	索菲亚	47,111,569.69	2.84
19	000902	新洋丰	47,040,004.23	2.84
20	300017	网宿科技	45,561,295.69	2.75
21	300011	鼎汉技术	44,739,487.50	2.70
22	001979	招商蛇口	42,478,412.38	2.56
23	300048	合康新能	40,785,659.15	2.46
24	601211	国泰君安	40,594,897.28	2.45
25	002531	天顺风能	38,903,511.82	2.35
26	002020	京新药业	38,617,829.83	2.33
27	000042	中洲控股	37,755,211.19	2.28
28	300115	长盈精密	36,089,464.59	2.18
29	300259	新天科技	35,752,523.08	2.16
30	000423	东阿阿胶	35,305,179.68	2.13
31	002271	东方雨虹	34,349,655.30	2.07

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	2,324,372,563.64
卖出股票收入（成交）总额	2,288,657,589.65

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数

量)，未考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	380,400,000.00	22.29
	其中：政策性金融债	380,400,000.00	22.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	380,400,000.00	22.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160414	16 农发 14	1,100,000	109,835,000.00	6.43
2	140220	14 国开 20	900,000	90,756,000.00	5.32
3	160211	16 国开 11	900,000	89,847,000.00	5.26
4	160204	16 国开 04	600,000	59,982,000.00	3.51
5	160209	16 国开 09	200,000	19,980,000.00	1.17

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

1、广东长青（集团）股份有限公司（以下简称“长青集团”，股票代码 002616）子公司韶关市曲江长青环保热电有限公司，因实施了集中供热项目环境影响评价文件未依法报批擅自开工建设的行为，违反了《中华人民共和国环境保护法》和《广东省环境保护条例》的相关规定，于 2016 年年底收到韶关市环境保护局曲江分局出具的《行政处罚决定书》（韶曲环罚字[2016]5 号），对上述行为处以罚款 140000 元。

本基金投研人员认为：广东长青（集团）股份有限公司子公司韶关市曲江长青环保热电有限公司受到行政处罚，体现出其原有业务流程存在一定的瑕疵，但该笔行政罚款占公司净利润的比例较低，不会对公司的生产、经营造成重大影响。曲江经济开发区集中供热项目环境影响报告书也已于 2016 年 11 月 24 日（即接获上述《行政处罚决定书》前）通过专家评审，该项目将按有关法律法规有序推进。该行政处罚事宜，并不影响长青集团具备投资价值的判断。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对长青集团进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	389,833.46
2	应收证券清算款	6,852,415.50
3	应收股利	-
4	应收利息	7,102,481.65
5	应收申购款	336,888.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,681,619.00

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
109,322	17,896.90	166,530,375.16	8.51%	1,789,994,169.79	91.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

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（2003年10月24日）基金份额总额	540,962,579.05
本报告期期初基金份额总额	1,895,412,218.12
本报告期基金总申购份额	456,279,747.96
减:本报告期基金总赎回份额	395,167,421.13
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	1,956,524,544.95

注：总申购份额含转换入份额，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：

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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 14 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	
中信建投证 券股份有限 公司		1962,980,818.62	20.91%	896,825.47	20.91%	-
广发证券股 份有限公司		2772,526,940.33	16.78%	719,456.02	16.78%	-
国金证券股 份有限公司		1706,938,962.95	15.35%	658,369.62	15.35%	-
海通证券股 份有限公司		2529,098,617.39	11.49%	492,749.50	11.49%	-
长江证券股 份有限公司		1469,893,277.41	10.21%	437,611.86	10.21%	-
西南证券股 份有限公司		1380,792,626.80	8.27%	354,628.00	8.27%	-
中国国际金 融股份有限		1227,451,202.85	4.94%	211,824.78	4.94%	-

公司						
招商证券股份有限公司	1	203,715,355.57	4.42%	189,720.81	4.42%	-
兴业证券股份有限公司	1	135,505,039.19	2.94%	126,196.14	2.94%	-
北京高华证券有限责任公司	1	116,967,668.32	2.54%	108,932.79	2.54%	-
长城证券股份有限公司	1	72,746,980.32	1.58%	67,748.99	1.58%	-
东吴证券股份有限公司	1	24,339,033.73	0.53%	22,666.77	0.53%	本期新增
申万宏源证券有限公司	1	1,431,025.00	0.03%	1,332.65	0.03%	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、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
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

招商证券股 份有限公司	215,250.00	100.00%	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-85,000,000.00	100.00%	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 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