

景顺长城大中华混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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.....	18
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	35
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	35
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	38
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	40
7.7 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.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.9 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.....	40

7.10 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	40
7.11 投资组合报告附注	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华混合型证券投资基金
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	145,471,920.64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	洪渊
	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
注册地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		杨光裕	易会满

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

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

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-5,584,477.48
本期利润	3,806,513.23
加权平均基金份额本期利润	0.0294
本期加权平均净值利润率	2.59%
本期基金份额净值增长率	1.80%
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	19,270,353.80
期末可供分配基金份额利润	0.1325
期末基金资产净值	173,043,853.03
期末基金份额净值	1.190
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	20.04%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

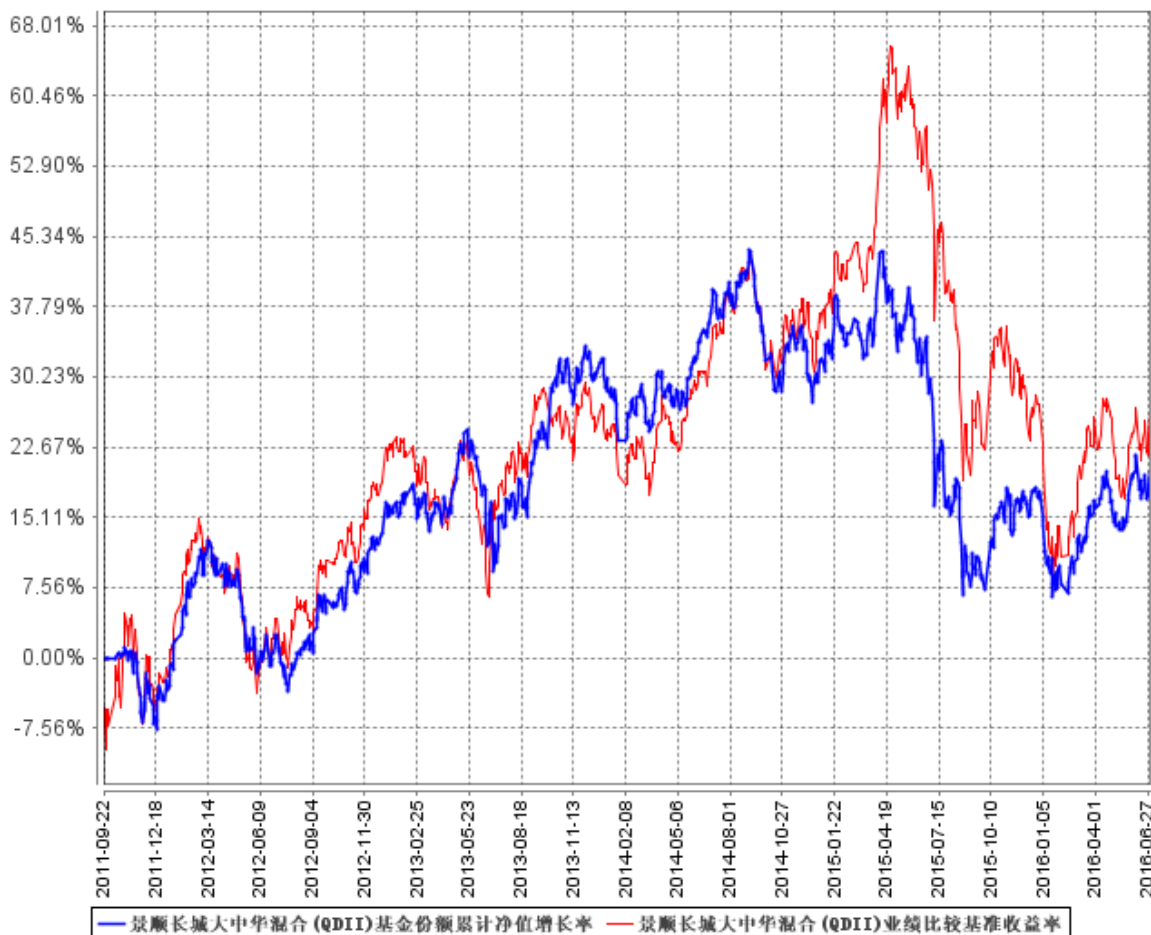
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.34%	1.01%	1.87%	1.30%	-1.53%	-0.29%
过去三个月	2.67%	0.82%	0.42%	1.06%	2.25%	-0.24%
过去六个月	1.80%	0.92%	-0.40%	1.27%	2.20%	-0.35%
过去一年	-7.68%	1.12%	-17.13%	1.43%	9.45%	-0.31%
过去三年	3.75%	0.88%	12.07%	1.09%	-8.32%	-0.21%
成立至今	20.04%	0.88%	26.42%	1.15%	-6.38%	-0.27%

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。

3.3 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		
谢天翎	景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金基金经理，国际投资部投资副总监	2011年9月22日	2016年6月22日	15	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。
黎海威	景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金经理，量化及ETF投资部投资总监	2016年6月3日	-	13	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。
周寒颖	景顺长城大中华混合型证券投资基金基金经理	2016年6月3日	-	10	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；

3、谢天翎女士于2016年2月3日离任景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金经理，于2016年6月22日离任景顺长城大中华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。

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。

4.4.2 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。

4.5 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

上半年大中华市场涨跌不一，台湾加权指数上涨 3.9%，恒生指数下跌 5.1%，上证指数下跌 17%。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。伴随人民币贬值预期增强，3-6 月沪港通南下资金流入创新高，恒生指数权重股获得了明显流入。6 月英国公投靴子落地，短期内不会启动退欧程序，市场情绪修复，新兴市场流动性改善带动恒生指数快速收复失地。全球大类资产价格普涨，债券、股票、黄金、工业金属等价格均出现反弹。这背后主要反映的是全球流动性宽松的预期。市场热点集中于强者恒强、低估值、高股息率、流动性好的大盘股和龙头股。

回顾上半年持仓，我们的超额收益来自于低仓位和选股。在人民币贬值背景下精选全球化布局、行业前景良好，竞争地位稳固的行业龙头为我们带来了超额收益。同时，我们也注意到，在香港市场流动性改善背景下未提高金融股配置，使得我们的基金表现相对业绩基准的超额收益收窄。

4.5.2 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 1.80%，业绩比较基准收益率为-0.40%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济增长呈现周期性回升，2 季度实际 GDP 增长 6.7%，与 1 季度持平，名义 GDP 增长 7.3%，略高于 1 季度。6 月份的工业增加值、发电量、基建投资、社会消费品零售总额等增速均有所提升。美国经济数据也表现较好，包括房地产、零售、核心 CPI、企业盈利等数据。7 月以来中国经济下行和人民币贬值告一段落，预计 3 季度流动性相对宽松，低估值龙头股估值修复和中报业绩超预期的个股有望跑赢。另外，7 月以来美国的加息预期有所提升，利率期货隐含的 9 月和 12 月的加息概率已经升至 26%和 47%，呈上升态势。下半年风险事件展望，关注美国重启加息和美国大选影响，亚太市场资金再次流出可能带来的估值压力。

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、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

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。

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

2016年上半年,本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《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其他法律法规和托管协议的有关规定,不存在任何损害持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

2016年上半年,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、资产净值计算、费用开支等问题上,不存在任何损害持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其他法律法规的有关规定进行。本报告期内,景顺长城大中华混合型证券投资基金没有进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城大中华混合型证券投资基金2016年上半年年度管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城大中华混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	41,543,101.93	33,588,701.50
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	127,813,557.67	111,617,050.03
其中：股票投资		127,813,557.67	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		4,671,222.77	-
应收利息	6.4.7.5	1,702.13	1,217.84
应收股利		832,917.66	16,336.82
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	10,217.86	0.00
资产总计		174,872,720.02	145,223,306.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,204,931.28	-
应付赎回款		12,325.89	26,266.90
应付管理人报酬		253,281.41	219,975.53
应付托管费		49,249.18	42,773.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	309,079.23	140,096.29
负债合计		1,828,866.99	429,111.73
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	145,471,920.64	123,817,850.83
未分配利润	6.4.7.10	27,571,932.39	20,976,343.63
所有者权益合计		173,043,853.03	144,794,194.46
负债和所有者权益总计		174,872,720.02	145,223,306.19

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.190元，基金份额总额145,471,920.64份。

6.2 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6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	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

一、收入		6,029,868.53	-10,523,787.31
1.利息收入		21,189.56	26,996.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,189.56	26,996.99
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）		-4,306,673.02	-293,874.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,290,563.11	-1,107,713.14
基金投资收益	6.4.7.13	-33,603.24	-768,231.14
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,017,493.33	1,582,070.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,390,990.71	-8,093,721.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		923,252.80	-2,240,942.08
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,108.48	77,753.76
减：二、费用		2,223,355.30	1,771,715.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,305,681.39	736,689.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	253,882.47	143,245.17
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	484,818.86	712,434.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	178,972.58	179,346.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,806,513.23	-12,295,502.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,806,513.23	-12,295,502.52

6.3 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)	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)	-	3,806,513.23	3,806,513.23
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)	21,654,069.81	2,789,075.53	24,443,145.34
其中：1.基金申购款	23,050,679.82	2,950,486.99	26,001,166.81
2.基金赎回款	-1,396,610.01	-161,411.46	-1,558,021.47
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)	145,471,920.64	27,571,932.39	173,043,853.03
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-12,295,502.52	-12,295,502.52
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)	113,597,754.37	44,759,461.41	158,357,215.78
其中：1.基金申购款	161,942,127.62	61,395,993.82	223,338,121.44
2.基金赎回款	-48,344,373.25	-16,636,532.41	-64,980,905.66
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)	-	-	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	128,716,444.49	37,159,700.60	165,876,145.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>许义明</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城大中华混合型证券投资基金(原名为景顺长城大中华股票型证券投资基金,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 2016 年 8 月 25 日批准报出。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半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 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》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) 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。

(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, 于 2016 年 5 月 1 日前, 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。对基金从证券市场中取得买卖股票、债券的差价收入, 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。

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	41,543,101.93
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3-6 个月	-
存款期限 1 年	-
其他存款	-
合计：	41,543,101.93

注：于 2016 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 32,875,892.02 元(折合人民币 28,098,038.62 元)，美元 9.46 元(折合人民币 62.77 元)，新台币 24,753,307.95(折合人民币 5,086,271.07 元)。

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	114,822,776.99	127,813,557.67	12,990,780.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	114,822,776.99	127,813,557.67	12,990,780.68

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

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**

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于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	1,702.13
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,702.13

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	10,217.86
合计	10,217.86

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末应付交易费用为零。

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	8.51

应付在途资金	-
其他应付款	-
预提审计费	59,890.78
预提信息披露费	249,179.94
预提上市年费	-
合计	309,079.23

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	123,817,850.83	123,817,850.83
本期申购	23,050,679.82	23,050,679.82
本期赎回(以“-”号填列)	-1,396,610.01	-1,396,610.01
- 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	145,471,920.64	145,471,920.64

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	21,439,603.24	-463,259.61	20,976,343.63
本期利润	-5,584,477.48	9,390,990.71	3,806,513.23
本期基金份额交易产生的变动数	3,415,228.04	-626,152.51	2,789,075.53
其中：基金申购款	3,628,157.04	-677,670.05	2,950,486.99
基金赎回款	-212,929.00	51,517.54	-161,411.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,270,353.80	8,301,578.59	27,571,932.39

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	20,669.58

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	-
其他	519.98
合计	21,189.56

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	80,205,990.98
减：卖出股票成本总额	86,496,554.09
买卖股票差价收入	-6,290,563.11

6.4.7.13 基金投资收益

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/赎回基金成交总额	3,404,936.81
减：卖出/赎回基金成本总额	3,438,540.05
基金投资收益	-33,603.24

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本期的债券投资收益项目发生额为零。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	2,017,493.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,017,493.33

6.4.7.17 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	9,390,990.71
——股票投资	9,390,990.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——外汇远期	-
——期权	-
——互换	-
3. 其他	-
合计	9,390,990.71

6.4.7.18 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	1,108.48
转换费收入	-
其他收入	-
合计	1,108.48

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.19 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	484,818.86
银行间市场交易费用	-
其他交易费用	-
合计	484,818.86

6.4.7.20 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	19,890.78
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	114.00
税务代理费	9,787.86
合计	178,972.58

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

无。

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 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6月30日	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	1,305,681.39	736,689.65
其中：支付销售机构的客户维护费	67,014.07	98,322.58

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。

6.4.10.1.2 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6月30日	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	253,882.47	143,245.17

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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 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	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
中国工商银行	8,358,743.66	18,878.33	3,733,407.00	20,062.68
渣打银行	33,184,358.27	1,791.25	20,510,102.83	1,074.58

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。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期未进行利润分配。

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

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。

6.4.12.2 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。

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。

6.4.12.3.2 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。

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设

立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理岗设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于

一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。同时本基金投资于与中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不超过基金资产净值的 3%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有及承担的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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	41,543,101.93	-	-	-	-	-	41,543,101.93
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	127,813,557.67	127,813,557.67
资产支持证券投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,671,222.77	4,671,222.77
应收利息	-	-	-	-	-	1,702.13	1,702.13

应收股利						832,917.66	832,917.66
应收申购款							
递延所得税资产							
其他资产						10,217.86	10,217.86
资产总计	41,543,101.93					133,329,618.09	174,872,720.02
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						1,204,931.28	1,204,931.28
应付赎回款						12,325.89	12,325.89
应付管理人报酬						253,281.41	253,281.41
应付托管费						49,249.18	49,249.18
应付销售服务费							
应付交易费用							
应交税费							
应付利息							
应付利润							
递延所得税负债							
其他负债						309,079.23	309,079.23
负债总计						1,828,866.99	1,828,866.99
利率敏感度缺口	41,543,101.93						
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	20,139,766.41					13,448,935.09	33,588,701.50
结算备付金							
存出保证金							
交易性金融资产						111,617,050.03	111,617,050.03
买入返售金融资产							
应收证券清算款							
应收利息						1,217.84	1,217.84
应收股利						16,336.82	16,336.82
资产总计	20,139,766.41					125,083,539.78	145,223,306.19
负债							
应付证券清算款							
应付赎回款						26,266.90	26,266.90
应付管理人报酬						219,975.53	219,975.53
应付托管费						42,773.01	42,773.01
其他负债						140,096.29	140,096.29
负债总计						429,111.73	429,111.73

利率敏感度缺口	20,139,766.41	-	-	-	-	-
---------	---------------	---	---	---	---	---

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券投资（2016年6月30日：无），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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	62.77	28,098,038.62	5,086,271.07	33,184,372.46
交易性金融资产	5,651,771.76	101,943,016.26	20,218,769.65	127,813,557.67
应收证券清算款	-	4,671,222.77		4,671,222.77
应收利息	0.01			0.01
应收股利	-	439,385.38	393,532.28	832,917.66
以外币计价的负债				
应付证券清算款			1204931.28	1204931.28
资产合计	5651834.54	135151663.03	25698573.00	166502070.57
负债合计			1204931.28	1204931.28
资产负债表外汇风险敞口净额	5651834.54	135151663.03	24493641.72	165297139.29
项目	上期末 2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	42.49	14,708,990.64	13,448,935.09	28,157,968.22
交易性金融资产	10,495,865.41	93,145,258.50	7,975,926.12	111,617,050.03
应收股利	-	16,336.77	0.05	16,336.82
资产合计	10,495,907.90	107,870,585.91	21,424,861.26	139,791,355.07
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外汇风险敞口净额	10,495,907.90	107,870,585.91	21,424,861.26	139,791,355.07
---------------	---------------	----------------	---------------	----------------

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	1、所有外币相对人民币升值5%	8,245,180.35	6,989,567.75
	2、所有外币相对人民币贬值5%	-8,245,180.35	-6,989,567.75

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市场利率和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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	127,813,557.67	73.86	111,617,050.03	77.09
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	127,813,557.67	73.86	111,617,050.03	77.09

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）
	MSCI 金龙净总收益指数 上升 5%	5,970,012.93	5,314,424.76
MSCI 金龙净总收益指数 下降 5%	-5,970,012.93	-5,314,424.76	

6.4.14 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 6 月 30 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 127,813,557.67 元，无属于第二层次和第三层次的余额(于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 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

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 6 月 30 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。

§ 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	127,813,557.67	73.09
	其中: 普通股	122,161,785.91	69.86
	存托凭证	5,651,771.76	3.23
	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	41,543,101.93	23.76
8	其他各项资产	5,516,060.42	3.15
9	合计	174,872,720.02	100.00

7.2 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	5,651,771.76	3.27
台湾地区	20,218,769.65	11.68
香港特别行政区	101,943,016.26	58.91
合计	127,813,557.67	73.86

7.3 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	-	-
通讯	31,414,982.71	18.15
消费品，周期性	42,403,006.74	24.50
消费品，非周期性	15,328,258.61	8.86
综合经营	-	-
能源	2,577,701.81	1.49
金融	4,764,073.14	2.75
工业	13,350,328.01	7.71
科技	13,322,707.94	7.70
公用事业	4,652,498.71	2.69
合计	127,813,557.67	73.86

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

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	TENCENT HOLDINGS	腾讯控	700 HK	香港	香港特	97,200	14,629,318.03	8.45

	LTD	有限公司		- 香港联合交易所	别行政区			
2	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	399,000	13,322,707.94	7.70
3	MINTH GROUP LTD	敏实集团有限公司	425 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	458,000	9,805,543.50	5.67
4	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	108,500	8,220,664.76	4.75
5	MAN WAH HOLDINGS LTD	敏华控股有限公司	1999 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	700,000	6,676,682.04	3.86
6	HENGAN INTL GROUP CO LTD	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	108,000	5,972,092.11	3.45
7	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	美国 - 纳斯达克	美国	30,000	5,651,771.76	3.27
8	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	申洲国际集团	2313 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	173,000	5,537,278.73	3.20
9	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	东江环保股份有限公司	895 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	466,600	5,295,918.21	3.06
10	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	株洲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	143,000	5,206,478.71	3.01
11	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	长江和记实业有限公司	1 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	65,000	4,697,052.66	2.71
12	SANDS CHINA LTD	金沙中	1928 HK	香港	香港特	176,000	3,903,448.84	2.26

		国有限公司		- 香港联合交易所	别行政区			
13	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	裕元工业(集团)有限公司	551 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	139,500	3,654,291.16	2.11
14	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业中国控股有限公司	220 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	633,000	3,527,359.83	2.04
15	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	广州汽车集团股份有限公司	2238 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	438,000	3,462,695.51	2.00
16	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	深圳高速公路股份有限公司	548 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	534,000	3,217,576.15	1.86
17	TOWNGAS CHINA CO LTD	港华燃气控股有限公司	1083 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	852,000	3,211,268.69	1.86
18	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	华晨中国汽车有限公司	1114 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	446,000	3,034,215.26	1.75
19	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	儒鸿企业股份有限公司	1476 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	46,000	2,934,848.46	1.70
20	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	数码通电讯集团有限公司	315 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	247,000	2,913,228.16	1.68
21	CHIN-POON INDUSTRIAL CO LTD	敬鹏工业股份有限公司	2355 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	200,000	2,847,931.09	1.65
22	SINO BIOPHARMACEUTICAL	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	605,000	2,611,230.52	1.51
23	YANZHOU COAL MINING CO-H	兖州煤业股份有限公司	1171 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	602,000	2,577,701.81	1.49

		有限公司		港联合交易所	区			
24	STELLA INTERNATIONAL	九兴国际控股有限公司	1836 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	194,500	2,280,721.08	1.32
25	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	北京控股有限公司	392 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	38,500	1,441,230.02	0.83
26	MAKALOT INDUSTRIAL CO LTD	聚阳实业股份有限公司	1477 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	36,000	1,113,282.16	0.64
27	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	418	67,020.48	0.04

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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	CHINA MOBILE LTD	941 HK	7,787,139.61	5.38
2	HENGAN INTL GROUP CO LTD	1044 HK	6,501,041.76	4.49
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	6,043,587.84	4.17
4	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	5,514,128.00	3.81
5	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	5,118,234.71	3.54
6	VIRSCEND EDUCATION	1565 HK	5,064,240.00	3.50
7	ZHUZHOU CSR TIMES ELECTRIC-H	3898 HK	4,836,418.28	3.34
8	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	3,891,167.47	2.69
9	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	3,870,919.81	2.67
10	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	220 HK	3,586,598.55	2.48
11	GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2238 HK	3,505,124.72	2.42

12	SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	548 HK	3,409,481.38	2.35
13	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1114 HK	3,022,278.79	2.09
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,878,483.97	1.99
15	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1476 TT	2,853,001.37	1.97
16	TOWNGAS CHINA CO LTD	1083 HK	2,834,130.42	1.96
17	AIA GROUP LTD	1299 HK	2,594,833.23	1.79
18	YANZHOU COAL MINING CO-H	1171 HK	2,586,208.03	1.79
19	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS	315 HK	2,582,436.23	1.78
20	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	2,561,687.50	1.77

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。

7.5.2 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	CGN POWER CO LTD-H	1816 HK	10,823,567.75	7.48
2	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	1038 HK	7,512,507.97	5.19
3	CHINA MOBILE LTD	941 HK	7,005,184.52	4.84
4	IMAX CHINA HOLDING INC	1970 HK	6,288,024.72	4.34
5	GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-H	525 HK	5,671,360.15	3.92
6	VIRSCEND EDUCATION	1565 HK	5,094,763.69	3.52
7	JOY CITY PROPERTY LTD	207 HK	5,068,955.74	3.50
8	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	VIPS US	4,842,419.54	3.34
9	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	338 HK	4,410,989.96	3.05
10	PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2328 HK	4,383,642.88	3.03
11	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	1 HK	3,359,707.77	2.32
12	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	2,964,399.46	2.05
13	AIA GROUP LTD	1299 HK	2,638,818.15	1.82
14	SINO BIOPHARMACEUTICAL	1177 HK	2,512,654.21	1.74
15	WEIBO CORP-SPON ADR	WB US	2,098,633.48	1.45
16	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	1,767,153.72	1.22
17	STELLA INTERNATIONAL	1836 HK	1,415,392.03	0.98
18	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	6409 TT	1,160,171.83	0.80
19	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	914 HK	661,201.21	0.46

20	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	386 HK	371,262.37	0.26
----	---------------------------------	--------	------------	------

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。

7.5.3 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	93,302,071.02
卖出收入（成交）总额	80,205,990.98

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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	4,671,222.77
3	应收股利	832,917.66
4	应收利息	1,702.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	10,217.86
8	其他	-
9	合计	5,516,060.42

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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
669	217,446.82	131,222,866.75	90.20%	14,249,053.89	9.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	455,815.57	0.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研发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	-

§ 9 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	23,050,679.82
减:本报告期基金总赎回份额	1,396,610.01
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	145,471,920.64

§ 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，聘任杨崑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	
DBS VICKERS (HONG KONG) LIMITED	-	23,327,988.68	13.44%	34,992.00	11.38%	-
Yuanta Securities	-	2,713,590.28	1.56%	4,070.56	1.32%	-
海通国际证券有限责任公司	-	23,280,288.62	13.42%	70,919.32	23.07%	-
中国国际金融香港证券有限公司	-	48,552,284.14	27.98%	79,709.23	25.93%	-
Masterlink Securities	-	9,722,062.29	5.60%	11,665.86	3.80%	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	65,911,847.99	37.99%	106,041.69	34.50%	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley&Co. International	-	-	-	-	-	-

plc						
-----	--	--	--	--	--	--

注：1、本期基金租用证券公司交易单元未变更。

2、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。

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		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	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	2,060,873.28	30.11%
中国国际金融香港证券有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Masterlink Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	4,782,603.58	69.89%
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley&Co. International plc	-	-	-	-	-	-	-	-

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1月20日
5	景顺长城大中华混合型证券投资基金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
6	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
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加渤海银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月27日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增奕丰公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年1月29日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年2月1日
10	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年2月3日
11	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于	中国证券报, 上海证	2016年2月20日

	聘任副总经理的公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加凯石财富基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年2月25日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年2月25日
15	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年3月23日
16	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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
17	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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
18	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
19	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年3月30日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年4月19日
21	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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
22	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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5月6日
23	景顺长城大中华混合型证券投资基金 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5月6日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金斧子为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月11日

25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加金斧子基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月11日
26	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金恢复日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月13日
27	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金暂停日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月16日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增伯嘉基金为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月16日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江金观诚财富管理为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月26日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加金观诚基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月26日
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京汇成基金管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月27日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加汇成基金基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月27日
33	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金暂停日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年5月30日
34	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月3日
35	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金暂停日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月13日
36	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城大中华混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月23日

37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月24日
38	关于景顺长城大中华混合型证券投资基金继续暂停日常申购和定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月27日
39	景顺长城大中华混合型证券投资基金境外主要市场节假日暂停赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2016年6月28日
40	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
41	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大中华股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城大中华混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城大中华混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城大中华混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2016 年 8 月 27 日