

# 景顺长城资源垄断混合型证券投资基金 （LOF）2016 年半年度报告摘要

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 27 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。

基金托管人中国农业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城资源垄断混合（LOF）
场内简称	景顺资源
基金主代码	162607
交易代码	162607
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2006年1月26日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,463,825,981.06份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2006年4月7日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，重点投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的80%。从业务价值、估值、管理能力、自由现金流量与分红政策四个方面结合必要的合理性分析对上市公司的品质和估值水平进行鉴别，选择目标股票构建组合。债券投资部分着重本金安全性和流动性。
业绩比较基准	富时中国 A200 指数×80%+中国债券总指数×20%。
风险收益特征	本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	林葛
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599

传真	0755-22381339	010-68121816
----	---------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	-128,989,542.87
本期利润	-316,266,777.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0870
本期基金份额净值增长率	-13.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0190
期末基金资产净值	1,438,774,192.98
期末基金份额净值	0.415

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。

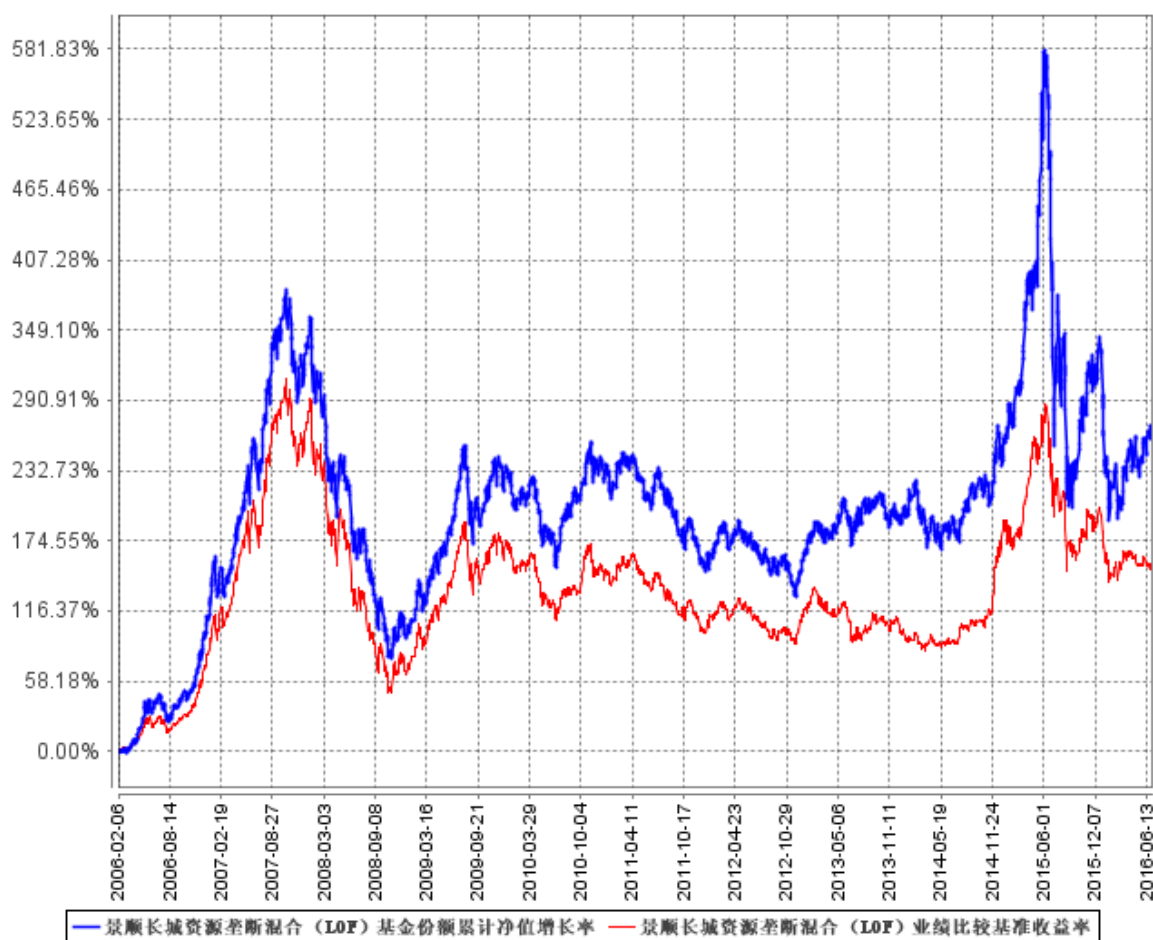
### 3.2 基金净值表现

#### 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	5.06%	1.43%	-1.71%	0.72%	6.77%	0.71%

过去三个月	8.36%	1.66%	-3.02%	0.75%	11.38%	0.91%
过去六个月	-13.59%	2.44%	-13.01%	1.40%	-0.58%	1.04%
过去一年	-26.90%	3.04%	-24.46%	1.79%	-2.44%	1.25%
过去三年	32.46%	2.22%	31.36%	1.46%	1.10%	0.76%
自基金合同生效起至今	269.26%	1.82%	155.96%	1.52%	113.30%	0.30%

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



注：本基金的资产配置比例为：对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优质上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2006 年 1 月 26 日合同生效日起至 2006 年 4 月 25 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

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

安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贾殿村	景顺长城支柱产业混合型证券投资基金基金经理，景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金经理，景顺长城研究精选股票型证券投资基金基金经理，研究部副总监	2014年12月27日	2016年2月3日	14	管理学博士。曾先后担任上海石油交易所交易员，北海国投深圳证券营业部分析师，北亚证券研发部分析师，第一创业证券研究所副所长，大成基金研究部高级研究员等职务。2010年3月加入本公司，担任研究副总监职务；自2012年11月起担任基金经理。
杨锐文	景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城优选混合型证券投资基金），景顺长城成长之星股票型证券投资基金，景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF），景顺长城环保优势股票型证券投资基金基金经理	2015年10月29日	-	6	工学硕士、理学硕士。曾担任上海常春藤衍生投资公司高级分析师。2010年11月加入本公司，担任研究员职务；自2014年10月起担任基金经理。
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	2014年12月27日	2016年2月3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

	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				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。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

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、贾殿村先生于 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 5 月 5 日离任景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金基金经理；

5、杨锐文先生于 2016 年 1 月 27 日离任景顺长城成长之星股票型证券投资基金基金经理。

## 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、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。



## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

由于市场开年之初连续熔断，沪深 300 上半年下跌 15.47%，但是，对于少数概念个股以及中小市值股票似乎牛市从未离去，市场情绪恢复超出我们预期。归结原因还是资产配置荒大背景下，资本市场是过剩流动性的重要去处。

尽管市场波动巨大，我们依旧致力于战胜市场，体现专业投资机构的能力。本基金始终坚持投资于符合产业趋势的真正的成长股，本季度基金仓位处于基金合同规定仓位限制中的较高仓位（80%-95%）。

在宏观经济低迷的大背景下，结合资产配置荒随之而来的过剩流动性，2 季度疯狂炒作各种概念：从物联网、虚拟现实到无线充电、量子通信。炒作概念盛行带来相关沾边的小市值个股被疯狂炒作，尽管参与这种疯狂充满快感，但是，我们更愿意赚伴随企业成长的钱。我们坚信，泡沫不一定会破，但故事一定会破，只有真正的成长股才能为投资者带来持续的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年上半年，本基金份额净值增长率为-13.59%，业绩比较基准收益率-13.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们不乐观亦不悲观，倾向于未来半年依然是上蹿下跳的“猴市”。不乐观在于中小创股票估值依然处于历史高位，而且市场需要时间来修复三波股灾带来的创伤。不悲观在于中国信用繁荣的内在性质，政府有足够的对金融机构的资产负债表的资产和流动性实施双向管控、外部头寸的资产和负债结构以及资本项目的管制。金融和财政政策的潜在空间，使得中国发生债务危机的概率极低。另外，从去年年初开始，M1 增速持续提高，从 2015 年 3 月的 2.9% 提高到今年 6 月份的 24.6%，而同期经济增速却没有明显回升。而且，M1 与 M2 增速的差距逐步扩大。6 月 M2 同比增长 11.8%，低于同期 M1 增速 12.8 个百分点。M1 增速与经济增长背离，反映了经济可能陷入某种形式、某种程度的“流动性陷阱”。无法进入实体的过剩流动性就会像浪潮一样推升各种资产的泡沫，随着浪潮的到来与退却，将带来相关资产的价格急剧的波动。然而，资本市场无疑仍然是吸引过剩流动性的重要去处。

全球进入负利率时代，而中国在某种程度上进入“流动性陷阱”的时代，我们从来没有面对过这样的时代，或许这个浪潮带来的资产价格波动将超出我们想象。根据我们对资产泡沫的理解，我们认为未来的投资机会主要存在两方面：一方面是投资产业趋势，另一方面是投资经济的变化点——也就是中国的供给侧改革。

回顾过去十年，A 股一直沿着中国产业发展趋势追逐个股。在 2008 年之前，中国经济增长核心驱动力是工业化与城镇化，工业化以及城镇化拉动最大的就是有色、钢铁、煤炭等上游原材料，那些年重仓这些板块就能大幅跑赢市场。从 2008 年至 2013 年，随着居民收入的提升以及城镇化的推进，中国出现明显的消费升级，于是，符合消费升级的家电板块几乎每年都跑赢市场。同时，受益于消费升级还有 TMT 行业，TMT 行业从 2009 年开始大牛市行情。在深入探讨 TMT 行业，A 股依然沿着产业发展的逻辑追逐：2009-2010 年 3G 网络大规模建设推升通信、电子行业的机会；2011-2012 年以 iPhone 为代表的智能手机快速普及带来电子行业的机会；2013 年移动互联网元年开启了以传媒、计算机为代表的移动互联网波澜壮阔的大行情。

未来的机会在哪里？我们依然认为符合产业趋势的新兴产业依然是未来主要的机会来源，但是，不容忽视供给侧改革带来的机会。市场对于供给侧改革有众多分歧，有别于大众的观点，我们认为供给侧改革是中国经济转型的关键，这将带来明显的投资机会。

中国经济最大风险点在于企业的杠杆率过高且不断提升。降低杠杆率不可能依靠债务剥离以及债务重组，只有重塑资产负债表以及重振资产回报率才是标本兼治之道。过去，减产能的问题一直是中国最突出的问题，产能无法出清导致工业企业的利润无法回归正常化，也就无法降低企业杠杆率。2012 年对于中国是“脱实入虚”的分水岭，金融开始空转，独自繁荣。经济在加速膨胀的金融资产和快速收缩的投资回报中艰难前行，整个产业部门现在已经难以托住昂贵的金融地产。现在，我们或许已经处于“由虚向实”的拐点之中。非金融企业不可持续的杠杆率倒逼泡沫收缩以及由虚向实。

如何降低传统产业的杠杆率？依靠持续输血是不可能的，只有恢复传统部门的造血功能才是核心。而恢复传统部门造血功能取决于供给侧改革去产能的力度。降低产业部门杠杆率的迫切性很有可能会导致政府去产能用力过猛，从而导致煤炭、有色等资源价格暴涨。政策执行与市场供求变化必然不可能完全匹配，大概率会导致矫枉过正，这种基本面的变化蕴藏着可观的投资机会。

过去，我们一直力求在新兴产业中寻找优质成长股。在现在这个时点，根据上述分析，我们可能会调整自身的策略观点，我们会重点关注供给侧改革受益标的。当然，我们在产业趋势中寻找优质成长股依旧会是我们重中之重。

#### 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

本基金本报告期内实施了一次利润分配。截至 2015 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 1,184,181,338.48 元，根据基金合同约定本次应分配金额为 1,237,674,919.33 元，本基金的基金管理人已于 2016 年 1 月 20 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发红利 4.0 元，详细信息请查阅相关分红公告。

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

### § 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：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	129,882,593.38	365,877,692.94
结算备付金	1,983,795.17	10,787,165.64
存出保证金	886,683.12	3,111,307.56
交易性金融资产	1,311,928,618.55	1,776,552,057.20
其中：股票投资	1,305,628,707.05	1,769,552,557.20
基金投资	-	-
债券投资	6,299,911.50	6,999,500.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	42,856.57	59,506.74
应收股利	-	-
应收申购款	244,811.64	900,943.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,444,969,358.43	2,157,288,673.97
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	62,868.19	16,218,951.86
应付赎回款	2,011,633.22	2,745,899.20
应付管理人报酬	1,734,870.92	2,711,485.22
应付托管费	289,145.15	451,914.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,570,615.55	3,827,319.28
应交税费	19,054.30	19,054.30
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	506,978.12	260,132.94
负债合计	6,195,165.45	26,234,756.99
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,504,689,767.78	946,872,578.50

未分配利润	-65,915,574.80	1,184,181,338.48
所有者权益合计	1,438,774,192.98	2,131,053,916.98
负债和所有者权益总计	1,444,969,358.43	2,157,288,673.97

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.415 元，基金份额总额 3,463,825,981.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6 月30日
<b>一、收入</b>	-298,006,538.87	2,566,847,500.92
1.利息收入	1,287,625.11	1,678,450.79
其中：存款利息收入	1,205,909.97	1,462,267.51
债券利息收入	13,871.33	4,243.36
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	67,843.81	211,939.92
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-113,153,759.36	2,418,059,718.49
其中：股票投资收益	-119,393,066.91	2,403,363,745.53
基金投资收益	-	-
债券投资收益	88,465.07	4,537,905.93
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	6,150,842.48	10,158,067.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-187,277,235.10	146,676,055.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,136,830.48	433,275.78
<b>减：二、费用</b>	18,260,239.10	66,955,108.44
1. 管理人报酬	11,223,096.49	37,596,228.64
2. 托管费	1,870,516.05	6,266,038.12
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,897,251.37	22,806,606.73
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	269,375.19	286,234.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-316,266,777.97	2,499,892,392.48

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-316,266,777.97	2,499,892,392.48

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	946,872,578.50	1,184,181,338.48	2,131,053,916.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-316,266,777.97	-316,266,777.97
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）	557,817,189.28	948,476,105.98	1,506,293,295.26
其中：1.基金申购款	1,622,716,543.09	808,771,876.43	2,431,488,419.52
2.基金赎回款	-1,064,899,353.81	139,704,229.55	-925,195,124.26
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）	-	-1,882,306,241.29	-1,882,306,241.29
五、期末所有者权益（基金净值）	1,504,689,767.78	-65,915,574.80	1,438,774,192.98
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）	2,749,746,393.26	2,371,520,356.99	5,121,266,750.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,499,892,392.48	2,499,892,392.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,720,891,386.90	-2,974,713,480.84	-4,695,604,867.74

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	96,440,989.12	136,681,525.41	233,122,514.53
2.基金赎回款	-1,817,332,376.02	-3,111,395,006.25	-4,928,727,382.27
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）	-	-187,433,457.41	-187,433,457.41
五、期末所有者权益（基金净值）	1,028,855,006.36	1,709,265,811.22	2,738,120,817.58

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：

_____ 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)(原名为景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第179号《关于同意景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)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《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,154,861,946.80元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第8号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于2006年1月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,155,234,378.92份基金份额，其中认购资金利息折合372,432.12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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2006]第24号文审核同意，本基金18,634,653.00份基金份额于2006年4月7日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金份额拆分公告》的有关规定，本基金于2007年7月26日进行了基金份



额拆分，拆分比例为 2.301455159，并于 2007 年 7 月 27 日进行了变更登记。

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》，景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)于 2015 年 8 月 7 日公告后更名为景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具的投资范围为国内依法发行和上市交易的公司股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于股票类资产，股票投资的比例不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩的比较基准为：富时中国 A200 指数(原名为新华富时 200 指数) X 80%+中国债券总指数 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监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 日期间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相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

### 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[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补充政策的通知》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。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	388,118,498.92	12.25%	1,183,532,444.00	8.78%

##### 6.4.8.1.2 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。

##### 6.4.8.1.3 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6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	361,452.67	12.25%	108,763.40	6.92%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	1,077,484.97	8.78%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,223,096.49	37,596,228.64
其中：支付销售机构的客户维护费	1,604,469.84	6,209,150.37

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,870,516.05	6,266,038.12

注：支付基金托管人中国农业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。

### 6.4.8.3 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。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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。

#### 6.4.8.4.2 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。

### 6.4.8.5 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6月30日	上年度可比期间 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
中国农业银行	129,882,593.38	1,070,239.85	187,766,572.78	1,390,198.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	11,177	145,077.46	145,077.46	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 6.4.9.2 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
002591	恒大高新	2016年4月15日	重大事项停牌	17.39	-	-	218,500	2,699,582.17	3,799,715.00	-

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.10 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。以公允价值计量的金融工具

##### (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级的余额为 1,307,252,621.41 元，属于第二层级的余额为 4,675,997.14 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层级为 1,719,157,000.30 元，属于第二层次的余额为 57,395,056.90 元，无属于第三层次的余额）。

###### (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，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及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于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），本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值从第一层次

调整至第二层次。

(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 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	1,305,628,707.05	90.36
	其中：股票	1,305,628,707.05	90.36
2	固定收益投资	6,299,911.50	0.44
	其中：债券	6,299,911.50	0.44
	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	131,866,388.55	9.13
7	其他各项资产	1,174,351.33	0.08
8	合计	1,444,969,358.43	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	470,943,301.12	32.73
C	制造业	619,085,071.67	43.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	702,665.60	0.05
F	批发和零售业	5,169,696.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,468,218.76	5.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	45,585,769.56	3.17
L	租赁和商务服务业	72,962,338.24	5.07
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,691,520.00	0.74
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	1,305,628,707.05	90.75

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	000967	盈峰环境	3,936,447	87,349,758.93	6.07
2	000971	高升控股	3,226,233	80,397,726.36	5.59
3	300145	中金环境	3,358,276	73,479,078.88	5.11
4	300058	蓝色光标	7,514,144	72,962,338.24	5.07
5	002664	信质电机	1,892,781	64,392,409.62	4.48
6	300048	合康变频	4,122,492	48,480,505.92	3.37



7	002311	海大集团	3,066,123	48,352,759.71	3.36
8	600525	长园集团	3,437,071	47,603,433.35	3.31
9	300203	聚光科技	1,791,768	47,302,675.20	3.29
10	002438	江苏神通	2,115,138	46,300,370.82	3.22

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半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000971	高升控股	82,302,614.20	3.86
2	300203	聚光科技	66,058,088.62	3.10
3	002664	信质电机	63,104,780.44	2.96
4	002557	洽洽食品	60,891,051.32	2.86
5	600203	福日电子	49,175,273.69	2.31
6	601088	中国神华	43,731,320.69	2.05
7	000983	西山煤电	41,325,547.14	1.94
8	002582	好想你	40,380,844.00	1.89
9	601666	平煤股份	38,411,643.77	1.80
10	601001	大同煤业	37,260,865.64	1.75
11	601225	陕西煤业	37,236,200.43	1.75
12	002688	金河生物	35,479,110.92	1.66
13	600340	华夏幸福	33,293,820.34	1.56
14	600114	东睦股份	33,141,844.25	1.56
15	601699	潞安环能	32,998,980.80	1.55
16	002128	露天煤业	32,849,476.52	1.54
17	600348	阳泉煤业	32,839,756.41	1.54
18	600971	恒源煤电	32,773,666.23	1.54
19	300048	合康变频	32,202,374.44	1.51
20	300097	智云股份	31,942,489.20	1.50

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000958	东方能源	78,180,776.75	3.67
2	600340	华夏幸福	69,621,756.07	3.27
3	000049	德赛电池	67,716,154.78	3.18
4	600048	保利地产	67,647,719.81	3.17
5	300048	合康变频	63,973,528.94	3.00
6	300009	安科生物	63,654,622.03	2.99
7	600292	远达环保	53,959,862.46	2.53
8	600804	鹏博士	53,331,836.11	2.50
9	002400	省广股份	52,076,146.53	2.44
10	002582	好想你	50,034,259.07	2.35
11	600203	福日电子	48,569,219.26	2.28
12	002311	海大集团	46,533,192.72	2.18
13	600525	长园集团	42,393,025.84	1.99
14	300097	智云股份	41,133,265.75	1.93
15	000977	浪潮信息	40,558,019.74	1.90
16	600645	中源协和	39,318,706.56	1.85
17	300241	瑞丰光电	37,311,621.20	1.75
18	000978	桂林旅游	37,195,028.98	1.75
19	600240	华业资本	35,895,344.20	1.68
20	600584	长电科技	31,012,520.81	1.46

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,507,227,000.31
卖出股票收入（成交）总额	1,664,030,136.95

注：买入股票成本、卖出股票收入均为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	6,299,911.50	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,299,911.50	0.44

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	123001	蓝标转债	58,495	6,299,911.50	0.44

## 7.7 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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	886,683.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,856.57
5	应收申购款	244,811.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,174,351.33

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	蓝标转债	6,299,911.50	0.44

### 7.12.5 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中不存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
109,416	31,657.40	215,635,026.85	6.23%	3,248,190,954.21	93.77%

**8.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	刘丽	1,900,110.00	2.05%
2	栾贵超	1,584,281.00	1.71%
3	尹宝亮	1,029,000.00	1.11%
4	衣国霞	846,012.00	0.91%
5	戴荣文	706,581.00	0.76%
6	李庆发	683,212.00	0.74%
7	李英杰	602,678.00	0.65%
8	堵海红	582,085.00	0.63%
9	潘孝俊	501,019.00	0.54%
10	董素贞	500,000.00	0.54%

注：持有人为场内持有人。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	836.27	0.00%

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年1月26日）基金份额总额	1,155,234,378.92
本报告期期初基金份额总额	2,179,379,533.98
本报告期基金总申购份额	3,735,732,387.80
减：本报告期基金总赎回份额	2,451,285,940.72
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	3,463,825,981.06

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于2016年1月22日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意黄卫明先生辞去本公司督察长一职。

2、本基金管理人于2016年2月4日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任杨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。

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	
瑞银证券有限责任公司	1	645,279,099.16	20.36%	600,947.77	20.36%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	455,033,995.77	14.36%	423,773.89	14.36%	-
长城证券股份有限公司	2	388,118,498.92	12.25%	361,452.67	12.25%	-
兴业证券股份有限公司	1	371,502,858.73	11.72%	345,981.29	11.72%	-
中国银河证券股份有限公司	2	298,916,043.08	9.43%	278,380.33	9.43%	-
恒泰证券股份有限公司	1	288,143,790.86	9.09%	268,348.98	9.09%	-
中信证券股份有限公司	2	258,163,529.96	8.15%	240,428.82	8.15%	-
国金证券股份有限公司	1	252,969,289.49	7.98%	235,590.75	7.98%	新增
中信建投证券	1	60,444,581.09	1.91%	56,291.91	1.91%	-

股份有限公司						
中国中投证券 有限责任公司	1	59,506,604.04	1.88%	55,418.94	1.88%	-
东方证券股份 有限公司	1	58,740,311.34	1.85%	54,704.84	1.85%	-
中国国际金融 股份有限公司	1	25,413,513.60	0.80%	23,667.59	0.80%	-
光大证券股份 有限公司	1	7,351,746.68	0.23%	6,846.74	0.23%	-
广发证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

#### 1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营况况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

#### 2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经



营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1,240,910.00	100.00%	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

### § 11 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  
2016 年 8 月 27 日