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:2016年3月29日

景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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2016年3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。

安永华明会计师事务所(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2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城鼎益混合(LOF)
场内简称	景顺鼎益
基金主代码	162605
前端交易代码	162605
后端交易代码	162606
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年3月16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	1,204,063,407.48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	2005-05-25

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益,力求基金财产长期稳定的回报。
投资策略	本基金依照以宏观经济分析模型MEM为基础的资产配置模型决定基金的资产配置,并运用景顺长城股票研究数据库(SRD)及GVI等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时,本基金运用多因素模型等分析工具,结合基金管理人的主观判断,根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。
业绩比较基准	富时中国A200指数x80%+同业存款利率x20%。
风险收益特征	本基金严格控制证券市场中的非系统性风险,是风险程度适中的投资品种。

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	杨岳阳	王永民
	联系电话	0755-82370388	010-66594896
	电子邮箱	investor@igwfmc.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.igwfmc.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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	2,205,661,920.60	166,964,885.96	1,079,602,896.19
本期利润	1,706,213,336.82	379,892,056.58	1,052,058,801.88
加权平均基金份额本期利润	0.8889	0.0893	0.2069
本期基金份额净值增长率	37.97%	10.46%	23.31%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.5882	-0.1360	-0.1832
期末基金资产净值	1,912,324,927.85	4,054,340,811.66	4,836,695,281.04
期末基金份额净值	1.588	1.151	1.042

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

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

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

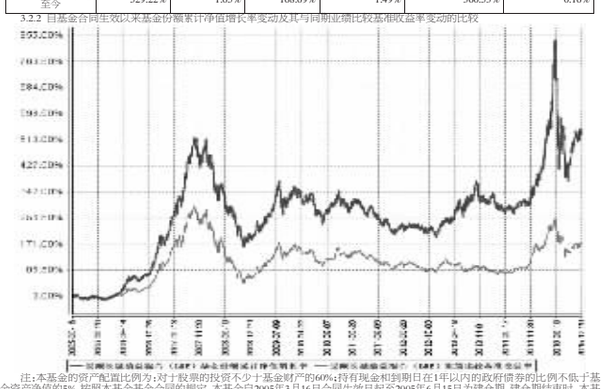
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

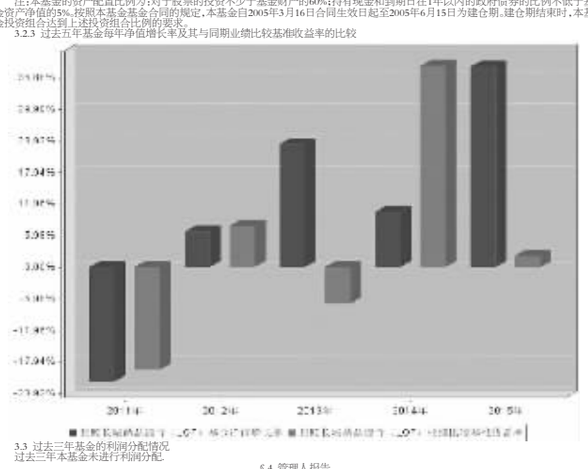
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.86%	1.56%	12.09%	1.31%	6.77%	0.25%
过去六个月	-8.68%	2.99%	-14.00%	2.10%	5.32%	0.89%
过去一年	37.97%	2.82%	2.21%	1.98%	35.76%	0.84%
过去三年	87.93%	1.99%	31.39%	1.43%	56.54%	0.56%
过去五年	57.07%	1.68%	14.09%	1.28%	42.98%	0.40%
自基金合同生效起至今	529.22%	1.65%	168.69%	1.49%	360.53%	0.16%

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财产的60%;持有现金和到期日在1年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。按照本基金基金合同的规定,本基金自2005年3月16日合同生效日起至2005年6月15日为建仓期,建仓期结束时,本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配

§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2015年12月31日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理52只开放式基金,包括景顺长城景丰两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、景顺长城精选监等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、景顺长城能源基础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、景顺长城四季丰收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、景顺长城景兴信用收益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、景顺长城景顺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、景顺长城中小股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、景顺长城群益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、景顺长城弼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、其中景顺长城景丰两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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘彦春	景顺长城新兴成长混合型证券投资基金基金经理、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)基金经理,景多列基金基金经理(分管景多列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金),景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金经理,研究部总监	2015年7月10日	-	12	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。
张继荣	景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)基金经理,景系列基金基金经理(分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金),景顺长城优质成长股票型证券投资基金基金经理,研究部总监	2009年9月19日	2015年7月9日	15	工学博士。曾担任大鹏证券行业分析师,融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理,银华基金投资管理部策略分析师、基金经理等职务。2009年3月加入本公司,自2009年8月起担任基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写,"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,"任职日期"为根据公司决定聘任后的公告日期,"离任日期"为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.张继荣先生于2015年7月9日离任景系列基金(分管景系列基金下设之景顺长城动力平衡证券投资基金)、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城优质成长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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城鼎益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

本报告期内,本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有1次,为公司旗下景顺长城鼎化精选股票型基金根据基金合同约定通过量化模型建仓从而与其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2015年,经济总体低迷,转型持续推进,流动性和风险偏好主导市场,杠杆资金进入与退出引发市场前所未有的大幅震荡,在经济疲弱、流动性充裕的大背景下,中小市值股票涨幅较大,鼎益基金始终坚守一直以来的价值判断准则,取得了相对稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年度,本基金份额净值增长率为37.97%,业绩比较基准收益率为2.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,无风险收益率下行和股票市场配置需求提升由行仍会对市场构成支撑,但我们要留意风险因素也在逐步累积,市场整体估值水平偏高,无风险收益率下行已经进入下半场,美联储回收流动性对全球市场的紧缩效应、注册制改革带来的股票稀缺性下降等因素都值得我们去思考和分析。

针对目前状况,新年后市场已经经历了较大幅度调整,我们观察到市场总体风险偏好已经处于极低水平,兼具高成长、高投入产出、较低估值水平的投资标的数量逐步增加,市场中长期投资价值显现,投资者可以考虑逐步增加权益类资产配置。

就经济而言,尽管眼前困难重重,我们仍然持相对乐观态度,政府供给侧改革有助于过剩产能出清,传统行业在优胜劣汰、并购重组过程中有望重新焕发活力。新兴产业创业者圆正在迎来最好的发展机遇,宽松的融资环境很可能孵化出未来的新兴产业龙头。此外,我们也看到其他很多积极的因素,过去这两年来,各个行政审批环节在逐渐取消,反腐在进行,越来越多的行业被放开,国家大力推动创新、大量的新技术、新模式也在不断涌现。互联网、新能源、智能化等新兴产业及各种创新产品、创新模式在中国如雨后春笋般涌现。这些现阶段成长还不足以对冲传统产业的下滑,但我们必须看到,寒冬终将过去。

我们那在期待大刀阔斧的改革,但同时我们也应该理解,改革的道路是曲折的,改革应该在不触及系统性风险底线的前提下渐进式开展,病来如山倒,病去如抽丝,对于资本市场的投资者而言,可能不得不接受和理解这样一个现实,渐进式的改革或许低于预期,但从一个国家系统运作的角度看,坚定不移的回归还必须保持耐心。

诚然,我们会有太多不如人意的地方需要改进,这是我们面临的问题,但同时也是我们提升的空间。从经济的角度看,所有的不是,也正是我们的机遇,未来社会要做到老有所养、病有所医、学有所教、生活上有更好的服务,更智能化人性化,生活的环境更蓝天碧水,生活模式更便捷环保节能,所有这一切都是我们面临的挑战,也是我们的发展机遇,越来越多的精英企业家开始放弃抱怨,用自己的努力和才智去解决问题、满足需求,同时社会也给予了这些勇于承担社会责任的人良好的回报。作为一个专业投资者而言,以上这些挑战,恰好也正是我们应该利用好的方向。

在经济的重大转折点上,我们进行投资同样要面向未来,保持乐观同时冷静而充满耐心。我们对出口的高端制造业、国企改革、互联网+、智能化、新兴消费、环境、医疗、军工等行业的发展保持谨慎,重点关注可以创造性满足国内居民需求的优秀企业。期待政府可以加快推进市场化改革,更大力度保护创新和企业家精神,相信未来会有一大批优秀企业在提高经济整体运行效率过程中成长起来。

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决策委员会、法律、监察稽核部、风险管理岗等相关人员。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时,通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种,由投资人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素,从价值投资的角度进行理论分析,并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人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.已实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2015年12月31日,本基金可供分配利润为708,261,520.37元,根据基金合同约定本次应分配金额为1,102,830,960.30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1.0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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)(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,安永华明会计师事务所(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:景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		350,360,654.66	159,050,620.86
结算备付金		3,223,651.25	8,522,113.74
存出保证金		872,455.59	1,343,242.51
交易性金融资产		1,606,878,237.92	3,866,257,117.27
其中:股票投资		1,606,878,237.92	3,816,227,117.27
基金投资		-	-
债券投资		-	50,030,000.00
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		-	-
应收证券清算款		-	46,847,376.43
应收利息		87,528.87	2,309,510.02
应收股利		-	-
应收申购款		18,383.89	28,484.73
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,961,440,912.18	4,084,358,465.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		41,525,425.82	-
应付赎回款		2,959,730.16	18,992,393.48
应付管理人报酬		2,461,741.31	5,190,015.85
应付托管费		410,290.20	865,002.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,530,657.96	4,739,769.73
应交税费		8,092.80	8,092.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		220,046.08	222,379.39
负债合计		49,115,984.33	30,017,653.90
所有者权益:			
实收基金		1,204,063,407.48	3,522,748,081.65
未分配利润		708,261,520.37	531,592,730.01
所有者权益合计		1,912,324,927.85	4,054,340,811.66
负债和所有者权益总计		1,961,440,912.18	4,084,358,465.56

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.588元,基金份额总额1,204,063,407.48份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		1,784,258,319.45	480,499,758.40
1.利息收入		4,342,566.01	14,837,968.27
其中:存款利息收入		2,740,651.95	3,748,724.37
债券利息收入		278,904.11	6,112,750.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,323,009.95	4,976,493.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,279,108,421.45	252,635,980.29
其中:股票投资收益		2,263,379,664.68	216,166,246.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-179,150.00	1,548,200.00
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		15,907,906.77	34,921,533.33
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-499,448,583.78	212,927,170.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		255,915.77	98,639.22
减:二、费用		78,044,982.63	100,607,701.82
1.管理人报酬		43,724,190.88	64,733,544.79
2.托管费		7,287,365.17	10,788,924.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		26,480,338.78	24,526,356.89
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		553,087.80	558,876.05
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,706,213,336.82	379,892,056.58
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,706,213,336.82	379,892,056.58

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	3,522,748,081.65	531,592,730.01	4,054,340,811.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,706,213,336.82	1,706,213,336.82
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)	-2,318,684,674.17	-1,529,544,546.46	-3,848,229,220.63
其中:1.基金申购款	134,107,428.65	90,640,597.11	224,748,025.76
2.基金赎回款	-2,452,792,102.82	-1,620,185,143.57	-4,072,977,246.39
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)	1,204,063,407.48	708,261,520.37	1,912,324,927.85

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	4,643,942,276.93	192,753,004.11	4,836,695,281.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	379,892,056.58	379,892,056.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,121,194,195.28	-41,052,330.68	-1,162,246,525.96
其中:1.基金申购款	64,956,617.21	1,794,918.12	66,751,535.33
2.基金赎回款	-1,186,150,812.49	-42,847,248.80	-1,228,998,061.29
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)	3,522,748,081.65	531,592,730.01	4,054,340,811.66

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　　邵娟媛

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

景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),原名景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF),系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]7号文《关于同意景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金募集的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2005年3月16日正式生效,首次设立募集规模为445,627,301.07份基金份额。本基金为契约型上市开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据2014年8月8日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号)第三十条第一项的规定,股票基金的股票资产投资比例下限由60%上调至80%,景顺长城基金管理有限公司经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起将景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)更名为"景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)",基金合同中的相关条款亦做相应修订,有关详细信息参见本公司于2015年8月7日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)变更基金类型并相应修订基金合同部分条款的公告》。

注:1)长城证券股份有限公司,系由原"长城证券有限责任公司"于2015年4月17更名;

2)以下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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	887,555,971.08	5.52%	1,880,720,977.15	11.82%

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 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	808,031.49	5.50%	-	-
	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
关联方名称	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	1,712,210.49	11.82%	473,048.28	10.00%

注: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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示,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。

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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	43,724,190.88	64,733,544.79
其中:支付销售机构的客户维护费	9,320,008.22	14,065,962.65

注:1)基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2)于2015年12月31日,应付基金管理费的金额为人民币2,461,741.31元(于2014年12月31日,应付基金管理费的金额为人民币5,190,015.85元)。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,287,365.17	10,788,924.09

注:1)基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2)于2015年12月31日,应付基金托管费的金额为人民币410,290.20元(2014年12月31日:应付基金托管费的金额为人民币865,002.65元)。

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

本基金于本期及上年度可比期间均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及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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

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: