景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2016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。

基金托管人中国农业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。

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	景顺长城沪深300等权重ETF
场内简称	300等权
基金主代码	159924
交易代码	159924
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年5月7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	54,515,929.00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	2013-06-05

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以沪深300等权重指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代（同行业股票优先考虑）或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。
业绩比较基准	沪深300等权重指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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@igwfmc.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5月7日（基金合同生效日）-2013年12月31日
本期已实现收益	66,580,652.62	4,162,965.72	-41,160,116.87
本期利润	46,607,759.58	45,010,221.70	-55,491,928.98
加权平均基金份额本期利润	0.4929	0.2563	-0.1304
本期基金份额净值增长率	18.73%	44.03%	-6.20%
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	0.6043	-0.0026	-0.0861
期末基金资产净值	87,459,376.25	168,266,653.43	216,191,364.73
期末基金份额净值	1.604	1.351	0.938

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。

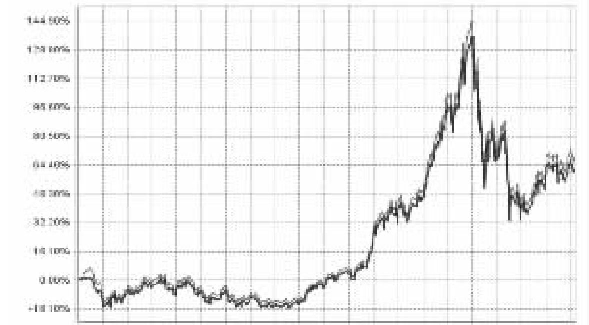
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

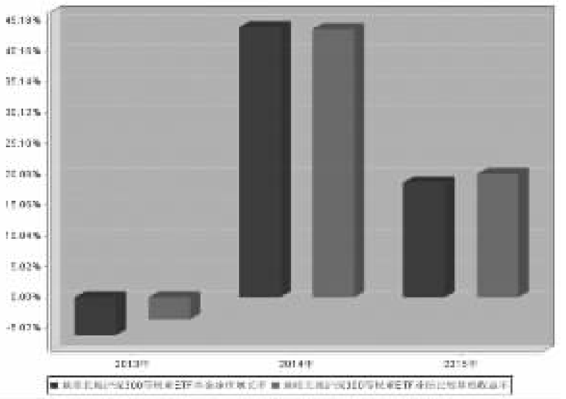
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.32%	1.79%	17.28%	1.81%	-0.96%	-0.02%
过去六个月	-17.57%	2.86%	-17.13%	2.91%	-0.44%	-0.05%
过去一年	18.73%	2.57%	20.12%	2.62%	-1.39%	-0.05%
自基金合同生效起至今	60.40%	1.84%	66.41%	1.88%	-6.01%	-0.04%

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：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的建仓期为自2013年5月7日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2013年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是2013年5月7日（基金合同生效日）至2013年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2013年5月7日）起至本报告期末未进行利润分配。

§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)、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。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		
徐喻军	上证180等权重交易型开放式指数基金、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数基金联接基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数基金、景顺长城中证500交易型开放式指数基金、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基金经理	2014年4月19日	–	5	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员职务；自2014年4月起担任基金经理。
江科宏	景顺长城中证医药卫生ETF、景顺长城中证800食品饮料ETF、景顺长城中证TMT150ETF、景顺长城沪深300等权重ETF、景顺长城中证500ETF、景顺长城研究精选股票型基金、景顺长城公司治理混合型基金、景顺长城优势企业混合型基金基金经理	2013年5月7日	2015年1月26日	8	经济学硕士，CFA。2007年至2010年担任本公司风险管理经理职务。2011年2月重新加入本公司，担任研究员等职务；自2012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、江科宏先生于2015年1月26日离任景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数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、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数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量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年中国经济仍处于产业结构调整阶段，经济潜在增速下行，部分行业“去产能”压力较大。全年GDP增速跌至6.9%，PMI在2季度出现短暂回升后，3、4季度继续下行。经济增长动能不足，消费数据相对平稳，在全球经济普遍下行、大宗商品价格下跌的背景下，全年国内通胀压力较小。2015年以来整体货币政策维持较为宽松格局，央行数次降准降息并通过公开市场操作，降低社会融资成本，助力实体经济去产能和结构转型。在“改革牛”和杠杆资金的推动下，2015年上半年A股走出了牛市行情，而随着杠杆资金压力的爆发，3季度A股指数大幅下行，进入4季度后有所修复，纵观全年上证综指和创业板指数分别上涨9.41%和84.41%。

本基金采用完全复制沪深300等权重指数的方法进行组合管理，本基金上市以后基金的收益和标的指数收益基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年，本基金份额净值增长率为18.73%，同期业绩比较基准收益率20.12%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在2%以内。

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2016年宏观经济，我们认为增长乏力、需求低迷、投资疲弱、传统行业产能过剩的局面依然存在，在经济下行和大宗商品价格持续低位的背景下，需要防范日益加重的通缩风险。为了配合供给侧改革下过剩产能的逐步出清，预期2016年的货币政策将继续保持宽松状态，但力度和频率可能有所减弱，主要以维稳国内经济增速和人民币汇率为主。持续暴跌对A股市场投资者信心影响较大，但股灾后市场重建过程中机会大于风险，预计2016年股票市场波动较大。

沪深300等权重指数通过特殊的加权方法，使得行业分布更为均衡，兼顾成长和价值，中长期的投资价值明显。本基金作为被动指数基金，将继续采用完全复制沪深300等权重指数的方法进行组合管理，控制跟踪误差和跟踪偏离度，期望为投资者分享中国经济的长期成长提供投资机会。

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，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

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

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2015年1月1日至2015年12月31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 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：景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金
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		1,844,467.47	2,868,858.54
结算备付金		1,692.29	894.28
存出保证金		6,803.61	2,581.18
交易性金融资产		85,709,966.73	166,298,863.13
其中：股票投资		85,693,266.73	166,298,863.13
基金投资		–	–
债券投资		16,700.00	–
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		176,707.93	–
应收利息		281.41	500.74
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		87,739,919.44	169,171,697.87
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		–	552,613.65
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		42,609.45	57,874.48
应付托管费		8,521.87	11,574.90
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		29,411.87	41,087.22
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		200,000.00	241,894.19
负债合计		280,543.19	905,044.44
所有者权益：			
实收基金		54,515,929.00	124,515,929.00
未分配利润		32,943,447.25	43,750,724.43
所有者权益合计		87,459,376.25	168,266,653.43
负债和所有者权益总计		87,739,919.44	169,171,697.87

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.604元，基金份额总额54,515,929.00份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金
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		48,357,565.54	46,745,931.16
1.利息收入		16,835.26	17,866.23
其中：存款利息收入		16,832.70	17,866.23
债券利息收入		2.56	–
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）		68,304,339.32	5,852,427.01
其中：股票投资收益		66,580,247.09	2,786,125.37
基金投资收益		–	–
债券投资收益		–	–
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		1,724,092.23	3,066,301.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-19,972,893.04	40,847,255.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）		9,284.00	28,381.94
减：二、费用		1,749,805.96	1,735,709.46
1.管理人报酬		786,832.25	825,127.52
2.托管费		157,366.37	165,025.58
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		194,828.54	144,938.36
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用		610,778.80	600,618.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,607,759.58	45,010,221.70
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,607,759.58	45,010,221.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金
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）	124,515,929.00	43,750,724.43	168,266,653.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	46,607,759.58	46,607,759.58
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）	-70,000,000.00	-57,415,036.76	-127,415,036.76
其中：1.基金申购款	24,000,000.00	11,305,928.00	35,305,928.00
2.基金赎回款	-94,000,000.00	-68,720,964.76	-162,720,964.76
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）	54,515,929.00	32,943,447.25	87,459,376.25
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）	230,515,929.00	-14,324,564.27	216,191,364.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	45,010,221.70	45,010,221.70
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）	-106,000,000.00	13,065,067.00	-92,934,933.00
其中：1.基金申购款	42,000,000.00	12,567,413.99	54,567,413.99
2.基金赎回款	-148,000,000.00	497,653.01	-147,502,346.99
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）	124,515,929.00	43,750,724.43	168,266,653.43

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

景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金(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[2012]第1542号《关于核准景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数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《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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870,464,701.00元(含募集股票市值)，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(2013)第183号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2013年5月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为870,515,929.00份基金份额，其中认购资金利息折合51,228.00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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2013]第181号文审核同意，本基金870,515,929.00份基金份额于2013年6月5日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深300等权重指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化；主要投资范围为沪深300等权重指数的成份股及备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的90%；本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。本基金的业绩比较基准为沪深300等权重指数。

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3月25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》、《景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015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2015年12月31日的财务状况以及2015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。

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

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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[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》及其他相关财税法规和实务操作，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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 本基金的基金管理人景顺长城基金公司的股东长城证券有限责任公司于2015年4月17日变更注册为长城证券股份有限公司。

2. 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 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	47,972,551.36	37.71%	40,849,368.33	42.84%

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	43,961.03	37.73%	11,899.99	40.46%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	37,189.50	42.84%	17,319.60	42.15%

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 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	786,832.25	825,127.52
其中：支付销售机构的客户维护费	–	–

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0.5%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X0.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	157,366.37	165,025.58

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0.1%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X0.1%/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 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	
	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	1,844,467.47	15,727.69	2,868,858.54	16,711.83

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。

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

无。

7.4.9 期末（2015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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月21日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	167	16,700.00	16,700.00	–

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
000002	万科A	2015年12月18日	重大事项停牌	24.43	–	–	15,685	197,839.65	383,184.55	–
600649	城投控股	2015年12月30日	重大事项停牌	23.16	2016年1月7日	20.84	15,718	165,676.56	364,028.88	–
600153	建发股份	2015年6月29日	重大事项停牌	17.31	–	–	20,962	187,847.17	362,852.22	–
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项停牌	58.80	–	–	6,100	408,434.74	358,680.00	–
000876	新希望	2015年8月17日	重大事项停牌	18.99	2016年3月2日	17.09	16,630	249,867.27	315,803.70	–
002065	东华软件	2015年12月21日	重大事项停牌	25.10	–	–	12,575	265,620.41	315,632.50	–
000712	锦龙股份	2015年12月25日	重大事项停牌	29.12	2016年2月22日	20.00	10,200	410,020.87	297,024.00	–
600873	梅花生物	2015年12月17日	重大事项停牌	9.14	–	–	31,944	203,518.55	291,968.16	–
002465	海格通信	2015年12月30日	重大事项停牌	16.69	2016年2月4日	15.02	16,900	157,863.90	282,061.00	–
601377	兴业证券	2015年12月29日	重大事项停牌	11.00	2016年1月7日	9.40	25,500	317,633.80	280,500.00	–
600578	京能电力	2015年11月5日	重大事项停牌	6.07	2016年2月24日	5.49	45,600	270,168.71	276,792.00	–
601018	宁波港	2015年8月4日	重大事项停牌	8.16	2016年2月22日	7.34	30,024	106,520.47	244,995.84	–
600783	鲁信创投	2015年12月31日	重大事项停牌	39.07	2016年1月4日	37.60	6,264	136,687.68	244,734.48	–
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项停牌	55.91	–	–	4,370	115,176.35	244,326.70	–
600690	青岛海尔	2015年10月19日	重大事项停牌	9.92	2016年2月1日	8.93	23,844	209,867.31	236,532.48	–

注：本基金截至2015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

7.4.14 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2015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81,194,150.22元，属于第二层次的余额为4,515,816.51元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次161,887,310.93元，第二层次4,411,552.20，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)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015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(2014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)基金申购款

于2015年度，本基金申购基金份额的对价总额为35,305,928.00元，其中包括以股票支付的申购款34,880,762.00元和以现金支付的申购款425,166.00元。(2014年度：本基金申购基金份额的对价总额为54,567,413.99元，其中包括以股票支付的申购款51,658,606.00元和以现金支付的申购款2,908,807.99元)。

(3)除公允价值和基金申购款外，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	85,693,266.73	97.67
	其中：股票	85,693,266.73	97.67
2	固定收益投资	16,700.00	0.02
	其中：债券	16,700.00	0.02
	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	1,846,159.76	2.10
7	其他各项资产	183,792.95	0.21
8	合计	87,739,919.44	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资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	263,942.28	0.30
B	采矿业	5,292,214.42	6.05
C	制造业	33,896,482.26	38.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,491,248.83	6.28
E	建筑业	3,288,135.70	3.76
F	批发和零售业	2,997,116.82	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	4,690,679.75	5.36
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,101,705.77	6.98
J	金融业	13,052,684.25	14.92
K	房地产业	3,944,967.52	4.51
L	租赁和商务服务业	1,446,192.57	1.65
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	868,287.75	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	266,724.68	0.30
R	文化、体育和娱乐业	3,025,149.92	3.46
S	综合	1,067,734.21	1.22
	合计	85,693,266.73	97.98

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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

8.3.1 期末指数投资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	600085	同仁堂	9,406	419,601.66	0.48
2	000002	万科A	15,685	383,184.55	0.44
3	600718	东软集团	12,257	380,579.85	0.44
4	002202	金风科技	16,486	375,715.94	0.43
5	600649	城投控股	15,718	364,028.88	0.42
6	600153	建发股份	20,962	362,852.22	0.41
7	300104	乐视网	6,100	358,680.00	0.41
8	002292	奥飞动漫	6,784	350,800.64	0.40
9	001979	招商蛇口	16,744	349,279.84	0.40
10	002456	欧菲光	11,221	348,075.42	0.40

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。

8.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601766	中国南车	2,061,323.30	1.23
2	300003	乐普医疗	1,970,433.50	1.17
3	603993	洛阳钼业	1,282,497.50	0.76
4	300002	神州泰岳	996,387.00	0.59
5	000166	申万宏源	959,492.16	0.57
6	601106	中国一重	875,155.00	0.52
7	600717	天津港	837,245.00	0.50
8	600317	营口港	831,275.00	0.49
9	601991	大唐发电	826,914.00	0.49
10	601788	光大证券	822,196.00	0.49
11	600005	武钢股份	819,688.00	0.49
12	600958	东方证券	819,181.00	0.49
13	601099	太平洋	814,397.00	0.48
14	002736	国信证券	807,888.00	0.48
15	000046	泛海控股	803,563.00	0.48
16	601969	海南矿业	785,682.00	0.47
17	300059	东方财富	779,857.00	0.46
18	601021	春秋航空	761,334.00	0.45
19	601919	中国远洋	743,709.00	0.44
20	000712	锦龙股份	737,165.00	0.44

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	601766	中国南车	2,802,524.90	1.67
2	601299	中国北车	2,061,323.30	1.23
3	300003	乐普医疗	1,496,907.00	0.89
4	600143	金发科技	1,110,954.63	0.66
5	600058	五矿发展	1,086,005.50	0.65
6	600498	烽火通信	1,004,992.52	0.60
7	600649	城投控股	1,004,494.25	0.60
8	002673	西部证券	980,119.90	0.58
9	600436	片仔癀	977,882.60	0.58
10	000562	宏源证券	959,492.16	0.57
11	002400	省广股份	924,312.68	0.55
12	603993	洛阳钼业	916,176.00	0.54
13	600655	豫园商城	903,324.90	0.54
14	601390	中国中铁	901,090.80	0.54
15	000839	中信国安	879,718.70	0.52
16	600880	博瑞传播	853,520.60	0.51
17	600079	人福医药	811,677.33	0.48
18	000401	冀东水泥	800,674.82	0.48
19	002429	兆驰股份	790,849.06	0.47
20	000869	张裕A	782,746.37	0.47

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	66,424,842.81
卖出股票收入（成交）总额	69,465,957.26

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	–	–
	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）	16,700.00	0.02
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	16,700.00	0.02

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	123001	蓝标转债	167	16,700.00	0.02

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

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

8.12.2

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	6,803.61
2	应收证券清算款	176,707.93
3	应收股利	–
4	应收利息	281.41
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	183,792.95

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000002	万科A	383,184.55	0.44	筹划重大事项
2	600649	城投控股	364,028.88	0.42	筹划重大事项
3	600153	建发股份	362,852.22	0.41	筹划重大事项
4	300104	乐视网	358,680.00	0.41	筹划重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§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
517	105,446.67	40,732,309.00	74.72%	13,783,620.00	25.28%

9.2 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	南京紫金资产管理有限公司	12,349,630.00	22.65%
2	工银安盛人寿保险有限公司	8,894,781.00	16.32%
3	上海璟行资产管理有限公司-富承成长基金1号	7,510,359.00	13.78%
4	工银安盛人寿保险有限公司	5,244,834.00	9.62%
5	江苏舜天股份有限公司	2,510,240.00	4.60%
6	陕西方直贸易有限公司	2,058,200.00	3.78%
7	中信期货有限公司-中信期货展弘多策略1号集合资产管理计划	1,151,252.00	2.11%
8	黄燕	786,038.00	1.44%
9	吉林省农村信用社联合社企业年金计划-交行	384,900.00	0.71%
10	陈宏伟	342,049.00	0.63%

9.3 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。

9.4 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年5月7日)基金份额总额	870,515,929.00
本报告期期初基金份额总额	124,515,929.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	94,000,000.00
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	54,515,929.00

§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

1、本基金管理人于2015年1月23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，同意王鹏辉先生辞去本公司副总经理一职。

2、本基金管理人于2015年9月1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Xie Sheng（谢生）先生辞去本公司副总经理一职。

3、本基金管理人于2015年9月19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，聘任刘奇伟先生担任本公司副总经理。

4、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。

5、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。

6、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。

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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续3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50,000.00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	
中国国际金融股份有限公司	2	79,235,357.55	62.29%	72,555.23	62.27%	–
长城证券股份有限公司	1	47,972,551.36	37.71%	43,961.03	37.73%	–
方正证券股份有限公司	1	–	–	–	–	新增
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
财富里昂证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	新增
中信证券股份有限公司	2	–	–	–	–	新增1个
申银万国证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华福证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
川财证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	2	–	–	–	–	新增1个
恒泰证券股份有限公司	1	–	–	–	–	新增
中信建投证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
国盛证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
民生证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	2	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	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
中国国际金融股份有限公司	–	–	–	–	–	–
长城证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
方正证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
财富里昂证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
申银万国证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
华福证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
川财证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
恒泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国盛证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
民生证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–

§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
2016年3月29日