景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 日
基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2017 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城策略精选灵活配置混合
场内简称	无
基金主代码	000242
交易代码	000242
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年 8 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	165, 530, 851.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,分享中国经济增长,在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略:基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析,重点关注包括、GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势,同时强调金融市场投资者行为分析,关注资本市场资金供求关系变化等因素,在深入分析和充分论证的基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度,运用宏观经济模型(MEM)做出对于宏观经济的评价,结合投资制度的要求提出资产配置建议,经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 2、股票投资策略:本基金将灵活运用多种投资策略,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,实现基金投资目标。其中,基金将综合运用主题、成长、价值、趋势几个主要投资策略,在自上而下的投资主题分析框架下,结合对行业和企业成长性的基本面研究,追求有远见地、准确地把握经济发展和变更中的个股投资机会。 3、债券投资策略:债券投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数× 50%+中证全债指数× 50%。
风险收益特征	本基金是混合型基金,属于中高风险收益的投资品种,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨柳阳	王永民
	联系电话	0755- 82370388	010- 66594896
	电子邮箱	investor@gwfmc.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.jgwfmc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	10, 200, 679.71	416, 177, 804.73	186, 125, 764.50
本期利润	- 4, 821, 489.70	499, 725, 867.25	116, 561, 096.84
加权平均基金份额本期利润	- 0.0242	0.8678	0.0309
本期基金份额净值增长率	0.36%	46.44%	- 1.17%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.0449	0.3997	- 0.0444
期末基金资产净值	232, 549, 256.53	317, 025, 446.66	1, 889, 246, 136.39
期末基金份额净值	1.405	1.400	0.956

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

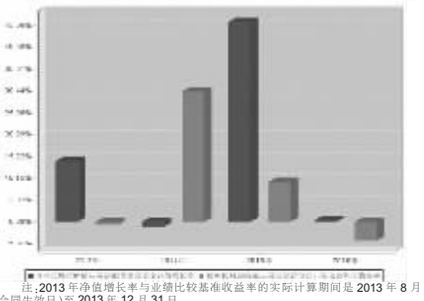
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.29%	0.28%	0.00%	0.39%	0.29%	- 0.11%
过去六个月	3.84%	0.33%	2.72%	0.40%	1.12%	- 0.07%
过去一年	0.36%	0.88%	- 4.29%	0.71%	4.65%	0.17%
过去三年	45.25%	1.25%	36.13%	0.90%	9.12%	0.35%
自基金合同生效起至今	65.86%	1.21%	35.27%	0.86%	30.59%	0.35%

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:本基金将基金资产的 0%-95%投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),将不低于 5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种(其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%)。本基金的建仓期为自 2013 年 8 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 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
2014	0.800	222, 686, 604.84	17, 370, 830.25	240, 057, 435.09	
合计	0.800	222, 686, 604.84	17, 370, 830.25	240, 057, 435.09	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2016 年 12 月 31 日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 62 只开放式基金,包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 800 食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城交易型货币市场基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐增利债券型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景益双利债券型证券投资基金、景顺长城景益利债券型证券投资基金、景顺长城景颐盛利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

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		
张靖	本基金的基金经理	2014 年 10 月 25 日	-	10年	经济学硕士。曾担任平安证券研究员、风险经理、高级业务总监,摩根士丹利华鑫基金研究员、基金经理、专户投资经理等职务。2014 年 5 月加入本公司,自 2014 年 10 月起担任基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其"任职日期"按基金合同生效日填写,"离任日期"为根据公司决定的解聘日期(公告前一日);对此后的非首任基金经理,"任职日期"指根据公司决定聘任后的公告日期,"离任日期"指根据公司决定的解聘日期(公告前一日);

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城策略精选灵活配置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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人(以下简称"本公司")投资和交易管理,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》等法律法规,本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》,该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下:

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分;建立客观的研究方法,任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持,避免主观臆断,严禁利用内幕信息作为投资依据;确保所有投资组合平等地享有研究成果;根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等,建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库,投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;建立公平的交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时,需根据价格优先、比例分配的原则,经过公平性审核,公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控,风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗内(如 1 日内、3 日、5 日内)公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析,对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内,公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况,应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度,并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年宏观经济需求层面乏善可陈,而国内政策和国际环境的变化对资本市场产生了较大影响。年初始断加剧了股灾后市场的恐慌心理,导致市场出现较大跌幅。新能源汽车的补贴政策带来该行业的迅猛发展,相关股票表现强劲;但在高速发展过程中,滋生了不少骗补行为,相关部门对补贴政策也进行了调整,股价也相应回落。2015 年以来,房地产价格上涨过快,尤其一线城市和部分二线城市,不仅没有催生市场对房地产投资加速的预期,反而带来对房地产泡沫的担忧,国庆节后中央和各地的新一轮房地产限购政策陆续出台,也给未来 1 到 2 年的房地产投资蒙上一层阴影。供给侧改革的持续实施,对煤炭、钢铁、化工、水泥等中上游周期性行业产生了较为积极的影响。随着产能的缩减,从 2016 年 1 季度开始,上市公司业绩边际有所改善,就其结构来说,主要是由于周期股的盈利改善所致。然而,受房地产投资增速下滑的影响,整体需求仍显疲弱,持续性存疑。另外,特朗普在此次美国大选中胜出,其竞选中的表态展现的政策取向可能将增加中美贸易、外交等方面的摩擦,也给市场带来不确定预期。对资本市场来说,2016 年可谓多事之秋,国内外的环境极为复杂和变幻莫测。股市缺乏趋势性机会。

由于缺乏趋势性的投资机会,本基金保持较为谨慎的仓位选择和灵活的行业和个股配置。上半年,基金较多配置在市场中为数不多的景气度高行业,如乘用车产业链、新能源汽车产业链。下半年,考虑到需求仍无起色、库存周期小周期可能见阶段性顶部以及货币政策的收紧等因素,本基金在股票配置上相对较为谨慎,主要配置一些景气度较好的细分子行业中业绩有改善、估值有吸引力的龙头个股上。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年,本基金份额净值增长率为 0.36%,业绩比较基准收益率为 -4.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济仍处于低迷状态并有恶化的迹象,需提防经济超预期下行的风险;国际环境出现较大的不利因素导致的人民币汇率继续贬值和贸易环境恶化的风险;国内由于需求疲弱,库存周期可能见顶回落的风险;在降杠杆过程中可能出现的流动性风险等。虽然面临上述风险,但随着经济转型的逐步推进和相关政策的助力,一些细分行业和个股仍有较好的投资机会。本基金将谨慎面对风险的基础上,采取灵活的仓位自下而上进行选股,关注在存量市场环境下,能够提升市场占有率的优质个股;在国产产业链持续完善的环境下,具备国产替代和产业升级能力的个股;在供给侧改革推进进程中能够获益的个股以及符合国企改革方向的优质个股等。

在长线投资机会不明确、市场大幅波动的市场环境下,2017 年股票市场的投资难度将大幅提高,板块性系统性的投资机会相对较少,但并不意味着个股投资机会的缺席。本基金将谨慎面对风险的基础上,采取灵活的仓位自下而上进行选股,积极参与具备安全边际、质地优良成长股投资。

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的基础上,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计账日的核对同时进行。

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

估值小组采派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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本报告期内,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:景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	16, 811, 423.70	75, 267, 705.08
结算备付金	7, 917, 128.90	1, 151, 386.36
存出保证金	79, 621.14	530, 393.29
交易性金融资产	69, 430, 441.92	239, 516, 726.14
其中:股票投资	49, 460, 441.92	189, 185, 826.14
基金投资	-	-
债券投资	19, 970, 000.00	50, 330, 900.00
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	60, 000, 000.00	-
应收证券清算款	78, 914, 513.75	-
应收利息	417, 337.40	2, 163, 455.06
应收股利	-	-
应收申购款	30, 112.97	137, 022.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	233, 600, 579.78	318, 766, 688.80
负债和所有者权益	本期末 2016年 12 月 31 日	上年度末 2015年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	273, 326.30	620, 906.29
应付管理人报酬	325, 154.33	399, 160.71
应付托管费	54, 192.42	66, 526.79
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	228, 754.81	464, 215.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	169, 895.39	190, 432.45
负债合计	1, 051, 323.25	1, 741, 242.14
所有者权益:		
实收基金	165, 530, 851.53	226, 497, 269.29
未分配利润	67, 018, 405.00	90, 528, 177.37
所有者权益合计	232, 549, 256.53	317, 025, 446.66
负债和所有者权益总计	233, 600, 579.78	318, 766, 688.80

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值人民币 1.405 元,基金份额总额 165, 530,851.53 份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	1, 671, 772.72	521, 071, 025.88
1.利息收入	2, 938, 376.77	4, 733, 579.50
其中:存款利息收入	769, 899.43	877, 596.55
债券利息收入	742, 697.53	3, 112, 291.78
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1, 425, 779.81	743, 691.17
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	13, 661, 684.94	430, 569, 906.22
其中:股票投资收益	13, 917, 717.92	426, 905, 941.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	- 586, 921.04	402, 248.07
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	330, 888.06	3, 261, 716.90
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	- 15, 022, 169.41	83, 548, 062.52
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	93, 880.42	2, 219, 477.64
减:二、费用	6, 493, 262.42	21, 345, 158.63
1. 管理人报酬	3, 965, 962.75	10, 530, 813.85
2. 托管费	660, 993.96	1, 755, 135.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1, 451, 549.61	8, 604, 100.68
5. 利息支出	-	1, 275.68
其中:卖出回购金融资产支出	-	1, 275.68
6. 其他费用	414, 756.10	453, 832.75
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	- 4, 821, 489.70	499, 725, 867.25
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	- 4, 821, 489.70	499, 725, 867.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	226, 497, 269.29	90, 528, 177.37	317, 025, 446.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	- 4, 821, 489.70	- 4, 821, 489.70
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)	- 60, 966, 417.76	- 18, 688, 282.67	- 79, 654, 700.43
其中:1.基金申购款	63, 370, 205.40	21, 900, 273.97	85, 270, 479.37
2.基金赎回款	- 124, 336, 623.16	- 40, 588, 556.64	- 164, 925, 179.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	165, 530, 851.53	67, 018, 405.00	232, 549, 256.53
项目	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1, 977, 079, 373.16	- 87, 833, 236.77	1, 889, 246, 136.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	499, 725, 867.25	499, 725, 867.25
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, 750, 582, 103.87	- 321, 364, 453.11	- 2, 071, 946, 556.98
其中:1.基金申购款	169, 689, 343.93	39, 941, 111.13	209, 630, 455.06
2.基金赎回款	- 1, 920, 271, 447.80	- 361, 305, 564.24	- 2, 281, 577, 012.04
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)	226, 497, 269.29	90, 528, 177.37	317, 025, 446.66

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

景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2013]784 号文《关于核准景顺长城策略精选灵活配置混合型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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2013 年 7 月 1 日至 2013 年 8 月 2 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字第 60467014_H02 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 8 月 7 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,525,950,600.09 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 406,448.26 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,526, 357,048.35 元,折合 1,526,357,048.35 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,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括中小企业私募债券)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或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。本基金将基金资产的 0%-95%投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),将不低于 5%的基金资产投资于债券等固定收益类品种(其中,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%)。本基金的建仓期为自 2013 年 8 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。

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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制。同时,在具体会计核算核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金信息披露业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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)》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错和更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)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,在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、回购业务、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值