景顺长城景系列开放式证券投资基金 2006 年年度报告摘要

(上接 53 版)

日基金销售服务费＝前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需向关联方支付的基金销售服务费如下：

	2006年度	2005年7月15日（基金运作起始日）至 2005 年 12 月 31 日止期间
景顺长城基金管理有限公司	699,147.15	1,221,590.73
中国银行	328,812.21	318,457.52
长城证券	980.09	1,002.55
	1,028,939.45	1,541,050.80

③与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年7月15日（基金运作起始日)至 2005 年 12 月 31 日止期间
买入债券结算金额	1,552,987,868.76	3,368,311,044.94
卖出债券结算金额	2,088,130,731.30	3,871,867,257.27
买入返售证券协议金额	40,000,000.00	–
买入返售证券利息收入	15,956.16	–

④关联方持有本基金份额

本基金基金管理人在 2006 年度及 2005 年度未持有本基金份额。

本基金基金管理人主要股东及其控制的机构在 2006 年 12 月 31 日及 2005 年 12 月 31 日未持有本基金份额。

⑤ 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

关联方	银行存款余额	
	2006年 12 月 31 日	2005年 12 月 31 日
中国银行	1,329,429.18	35,679,476.24

关联方	银行存款利息收入	
	2006年	2005年
中国银行	148,058.59	188,970.59

4、报告期末没有流通转让受到限制的基金资产。

第三节 动力平衡基金财务会计报告

（一）动力平衡基金会计报表

1、资产负债表(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006年 12月 31 日	2005年 12月 31 日
资产			
银行存款		3,678,473.19	18,073,768.94
清算备付金		8,962,613.75	141,537.65
交易保证金		388,549.12	185,707.76
应收证券清算款		21,550,321.69	0.00
应收利息		2,890,481.24	745,377.98
应收申购款		8,581,630.33	62,885.52
其他应收款		312.32	2,635.95
股票投资市值		1,511,737,106.65	158,954,147.52
其中：股票投资成本		1,162,744,230.68	146,364,779.76
债券投资市值		392,191,368.13	78,141,320.00
其中：债券投资成本		392,205,428.62	78,009,178.30
权证投资市值		0.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
资产总计		1,949,980,856.42	256,307,381.32
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		0.00	417,526.93
应付赎回款		32,587,558.43	137,651.49
应付赎回费		97,828.99	339.11
应付管理人报酬		2,294,382.47	316,975.26
应付托管费		382,397.09	52,829.19
应付佣金		1,340,973.21	65,738.63
其他应付款		250,000.00	250,000.00
预提费用		54,500.00	44,535.64
负债合计		37,007,640.19	1,285,596.25
持有人权益			
实收基金		1,488,068,085.53	251,029,561.09
未实现利得		373,306,990.02	943,571.15
未分配基金净收益		51,598,140.68	3,048,652.83
持有人权益合计		1,912,973,216.23	255,021,785.07
(2006 年末基金份额资产净值：1.2855 元)			
(2005 年末基金份额资产净值：1.0159 元)			
负债及持有人权益总计		1,949,980,856.42	256,307,381.32

2、经营业绩表及收益分配表(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006年度	2005年度
收入			
股票差价收入/(损失)		146,556,213.24	(2,374,833.48)
债券差价收入/(损失)		(64,059.58)	727,476.02
权证差价收入		5,672,364.74	1,396,599.42
债券利息收入		2,195,022.21	3,304,807.41
存款利息收入		219,549.04	204,443.44
股利收入		2,192,212.22	2,088,858.90
其他收入		328,743.12	62,360.01
收入合计		157,100,044.99	5,409,711.72
费用			
基金管理人报酬		(5,869,642.54)	(4,046,621.99)
基金托管费		(978,273.75)	(674,436.87)
卖出回购证券支出		(238,559.28)	(14,216.31)
其他费用		(192,971.06)	(163,449.86)
其中：信息披露费		(116,666.67)	(100,333.00)
审计费用		(50,000.00)	(40,000.00)
费用合计		(7,279,446.63)	(4,898,725.03)
基金净收益		149,820,598.36	510,986.69
加：未实现估值增值/(减值)变动数		336,257,306.02	(1,418,148.59)
基金经营业绩		486,077,904.38	(907,161.90)
基金净收益		149,820,598.36	510,986.69
加：年初基金净收益		3,048,652.83	7,076,743.58
本年申购基金份额的损益平准金		63,589,707.99	2,538,665.18
本年赎回基金份额的损益平准金		(19,078,824.02)	(1,794,017.17)
可供分配基金净收益		197,380,135.16	8,332,378.28
本年已分配基金净收益		(145,781,994.48)	(5,283,725.45)
未分配基金净收益		51,598,140.68	3,048,652.83

3、基金净值变动表(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006年度	2005年度
年初基金净值		255,021,785.07	258,922,776.15
本年经营活动			
基金净收益		149,820,598.36	510,986.69
未实现估值增值/(减值)变动数		336,257,306.02	(1,418,148.59)
经营活动产生的基金净值变动数		486,077,904.38	(907,161.90)
本年基金份额交易			
基金申购款		1,768,582,874.39	68,880,126.92
其中：分红再投资		53,416,404.94	680,142.43
基金赎回款		(450,927,353.13)	(66,590,230.65)
基金份额交易产生的基金净值变动数		1,317,655,521.26	2,289,896.27
本年向基金份额持有人分配收益			
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数		(145,781,994.48)	(5,283,725.45)
年末基金净值		1,912,973,216.23	255,021,785.07

（二）动力平衡基金会计报表附注

1、本基金在本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度报告相一致。

2、本基金在本报告期无重大会计差错。

3、重大关联方关系及关联交易

(1) 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2)关联方交易

① 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年度	
	成交量	占本年成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	679,526,392.70	32.86%
买卖债券	1,839,996.00	2.04%
买卖权证	2,592,970.91	45.71%
	佣金	占本年佣金总量的比例
长城证券	531,735.18	31.86%

	2005年度	
	成交量	占本年成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	81,905,123.03	30.89%
买卖债券	9,427,337.10	12.74%
买卖权证	655,200.00	46.91%
	佣金	占本年佣金总量的比例
长城证券	64,091.58	29.99%

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。债券及权证交易不计佣金。

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。

②关联方报酬

(a) 基金管理人报酬

支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的基金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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 5,869,642.54 元(2005 年：4,046,621.99 元)。

(b) 基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 978,273.75 元(2005 年：674,436.87 元)。

③与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

(a)本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年度
买入债券结算金额	398,843,077.74	112,334,328.73
卖出债券结算金额	9,918,500.00	158,490,446.71
卖出回购证券结算金额	835,750,000.00	53,900,000.00
卖出回购证券利息支出	238,559.28	14,216.31

(b) 本基金在本年度与基金管理人的股东长城证券通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年度
买入债券结算金额	–	19,522,000.00

④关联方持有本基金份额

本基金基金管理人在 2006 年及 2005 年均未持有本基金份额。

本基金基金管理人主要股东及其控制的机构在 2006 年 12 月 31 日及 2005 年 12 月 31 日均未持有本基金份额。

⑤由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

关联方	银行存款余额	
	2006年 12 月 31 日	2005年 12 月 31 日
中国银行	3,678,473.19	18,073,768.94

关联方	银行存款利息收入	
	2006年	2005年
中国银行	202,615.58	200,549.61

4 流通受限制不能自由转让的基金资产

(a)本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000423	S阿 股	06/12/04	13.69	未知	未知	1,786,810	24,268,124.42	24,461,428.90

(b)基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	106,260	525,987.00	860,706.00
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	374,000	7,061,120.00	7,061,120.00
002024	苏宁电器	06/06/22	07/06/22	48.00	45.40	100,000	4,800,000.00	4,540,000.00
002024	苏宁电器(转增股)	–	07/06/22	–	45.40	100,000	–	4,540,000.00
合 计						680,260	12,387,107.00	17,001,826.00

第七章 投资组合报告

第一节 优选股票基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	1,063,316,698.54	78.05%
债券	276,671,130.99	20.31%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	15,510,036.53	1.14%
资产支持证券	0.00	0.00%
其它资产	6,897,288.59	0.50%
资产总计	1,362,395,154.65	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比
A 农、林、牧、渔业		0.00	0.00%
B 采掘业	3,663,789	61,744,157.78	4.56%
C 制造业	26,936,691	397,413,876.31	29.32%
C0 食品、饮料	2,122,138	113,455,528.58	8.37%
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00%
C2 木材、家具		0.00	0.00%
C3 造纸、印刷		0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	895,147	21,089,663.32	1.56%
C5 电子		0.00	0.00%
C6 金属、非金属	21,199,351	200,107,772.38	14.77%
C7 机械、设备、仪表	1,544,342	33,497,415.46	2.47%
C8 医药、生物制品	1,175,713	29,263,496.57	2.16%
C99 其他制造业		0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		0.00	0.00%
E 建筑业		0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	2,548,440	20,642,364.00	1.52%
G 信息技术业	468,188	9,316,941.20	0.69%
H 批发和零售贸易	2,842,556	84,026,736.84	6.20%
I 金融、保险业	30,244,956	324,836,618.25	23.97%
J 房地产业	6,692,320	118,262,331.02	8.73%
K 社会服务业		0.00	0.00%
L 传播与文化产业	1,313,049	32,642,398.14	2.41%
M 综合类	186,210	14,431,275.00	1.06%
合计	74,896,199	1,063,316,698.54	78.46%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数 量(股)	市 值(元)	市值占净值比
600036	招商银行	5,687,645	93,049,872.20	6.87%
601398	工商银行	14,001,000	86,806,200.00	6.41%
600016	民生银行	6,779,906	69,155,041.20	5.10%
000002	万 科 A	4,409,257	68,078,928.08	5.02%
600519	贵州茅台	694,162	60,968,248.46	4.50%
000825	太钢不锈	4,570,883	59,695,731.98	4.40%
600005	武钢股份	7,740,000	49,226,400.00	3.63%
600694	大商股份	1,502,876	44,169,525.64	3.26%
600030	中信证券	1,569,950	42,985,231.00	3.17%
600583	海油工程	1,108,822	38,442,858.74	2.84%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于景顺长城基金管理有限公司网站的年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

(一)报告期内累计买入金额占期初基金资产净值前 20 名的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额	占期初净值比
601398	工商银行	60,274,190.35	5.32%
600320	振华港机	52,139,937.03	4.60%
600036	招商银行	45,410,511.81	4.01%
600016	民生银行	42,708,173.02	3.77%
600688	S上石化	41,199,570.06	3.64%
600005	武钢股份	37,516,384.31	3.31%
000792	盐湖钾肥	35,480,346.40	3.13%
000001	S深发展 A	33,928,256.18	2.99%
000825	太钢不锈	33,130,536.08	2.92%
600000	浦发银行	31,855,607.16	2.81%
000002	万 科 A	31,175,575.52	2.75%
600022	济南钢铁	27,963,600.20	2.47%
002024	苏宁电器	27,641,292.34	2.44%
600030	中信证券	27,323,396.16	2.41%
600694	大商股份	26,414,984.14	2.33%
000709	唐钢股份	25,599,735.55	2.26%
600316	洪都航空	25,417,350.36	2.24%
600331	宏达股份	25,101,077.89	2.21%
600685	广船国际	24,752,802.70	2.18%
600456	宝钛股份	22,461,961.76	1.98%

(二)报告期内累计卖出金额占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计卖出金额	占期初净值比
600320	振华港机	110,048,580.89	9.71%
600519	贵州茅台	94,084,262.20	8.30%
600000	浦发银行	71,200,493.06	6.28%
600583	海油工程	66,128,929.70	5.84%
000002	万 科 A	65,488,800.34	5.78%
600028	中国石化	62,731,838.55	5.54%
600009	上海机场	60,984,042.04	5.38%
600900	长江电力	58,238,462.67	5.14%
600019	宝钢股份	55,614,706.99	4.91%
600688	S上石化	48,878,358.47	4.31%
600887	伊利股份	46,994,787.35	4.15%
600050	中国联通	46,502,636.91	4.10%
600269	赣粤高速	42,303,895.61	3.73%
600012	皖通高速	41,227,670.97	3.64%
600685	广船国际	40,705,724.44	3.59%
600033	福建高速	39,707,528.94	3.50%
000792	盐湖钾肥	37,305,686.91	3.29%
000869	张 裕 A	34,883,137.02	3.08%
600036	招商银行	34,514,499.43	3.05%
600331	宏达股份	31,955,171.06	2.82%
000060	中金岭南	29,372,337.74	2.59%
000423	S 阿 股	28,571,665.78	2.52%
002024	苏宁电器	28,297,121.61	2.50%
000538	云南白药	27,767,754.78	2.45%
000858	五 粮 液	26,628,296.57	2.35%
600808	马钢股份	25,958,265.69	2.29%
600456	宝钛股份	25,394,700.60	2.24%
000063	中兴通讯	25,306,661.40	2.23%
000022	深赤湾 A	23,000,095.24	2.03%

(三)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票收入总额

单位：元

买入股票的成本总额	卖出股票的收入总额
1,286,871,097.77	1,946,523,989.00

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(元)	市值占基金资产净值比例
国家债券投资	49,248,015.00	3.63%
央行票据投资	0.00	0.00%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	227,423,115.99	16.78%
可转换债投资	0.00	0.00%
债券投资合计	276,671,130.99	20.42%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	数量(张)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
05农发 04	700,000	71,578,000.00	5.28%
06进出 04	550,000	54,281,509.99	4.01%
02国债⑩	490,030	49,248,015.00	3.63%
04国开 21	450,000	45,109,578.00	3.33%
04国开 01	200,000	20,151,000.00	1.49%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本报告期内本基金未投资资产支持证券。

八、报告期末权证投资明细

1、本报告期末未持有权证。

2、报告期内因股权分置改革被动持有的权证数量为 14,214,753.00 股，成本总额为 0.00 元，无主动投资的权证。明细如下：

序号	权证代码	权证种类	权证名称	权证数量(股)	市值	市值占基金净资产比例%	获得方式
1	030002	认购权证	五粮液 YGC1	939,027	–	–	被动获得
2	038004	认沽权证	五粮液 YGP1	987,182	–	–	被动获得
3	580996	认沽权证	沪场 JTP1	1,214,519	–	–	被动获得
4	580997	认沽权证	招行 CMP1	2,190,000	–	–	被动获得
5	038003	认沽权证	华菱 JTP1	3,051,117	–	–	被动获得
6	580994	认沽权证	脏水 CTP1	446,121	–	–	被动获得
7	038006	认沽权证	中集 ZYP1	1,120,000	–	–	被动获得
8	580990	认沽权证	茅台 JCP1	3,079,690	–	–	被动获得
9	038008	认沽权证	钾肥 JTP1	908,981	–	–	被动获得
10	580009	认购权证	伊利 CWB1	278,116	–	–	被动获得
	合计			14,214,753	–	–	

九、投资组合报告附注

1、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。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金的其他资产构成

项目	金额(元)
交易保证金	638,549.12
应收利息	4,458,595.91
应收申购款	1,798,752.69
其他应收款	1,390.87
合计	6,897,288.59

4、报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内基金管理人未运用基金固有资金投资本基金。

第二节 货币市场基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金资产总值比例
债券投资	204,984,038.96	74.81%
买入返售证券	0.00	0.00%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	1,329,429.18	0.48%
其中：定期存款	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00
其他资产	67,696,424.77	24.71%
资产总计	274,009,892.91	100.00%

二、报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融入的资金	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

1、上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

2、根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》(证监基金字[2005]41 号)，自 2005 年 4 月 1 日起，除发生巨额赎回，货币市场基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值 20%。本基金在 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日期间无债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

三、基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项 目	天 数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	152
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未发生违规超过 180 天的情况。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天内	27.66%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.72%	0.00%
2	30天(含)–60 天	7.34%	0.00%
3	60天(含)–90 天	15.69%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.64%	0.00%
4	90天(含)–180 天	14.55%	0.00%
5	180天(含)–397 天(含)	10.45%	0.00%
	合计	75.68%	0.00%

四、报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	37,888,937.54	13.90%
	其中：政策性金融债	37,888,937.54	13.90%
3	央行票据	156,954,602.89	57.57%
4	企业债券	10,140,498.53	3.72%
合 计		204,984,038.96	75.19%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		20,060,807.21	7.36%

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张) 自有投资	买断式回购	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	06央行票据 03	640,000		63,922,960.17	23.45%
2	06央行票据 24	300,000		29,768,700.18	10.92%
3	06央行票据 12	250,000		24,879,211.17	9.13%
4	04国开 01	200,000		20,005,627.12	7.34%
5	06央行票据 60	200,000		19,661,246.26	7.21%
6	05首都机场	100,000		10,140,498.53	3.72%
7	05国开 07	100,000		9,920,308.68	3.64%
8	06央行票据 37	100,000		9,888,601.44	3.63%
9	06央行票据 66	90,000		8,833,883.67	3.24%
10	06进出 04	80,000		7,963,001.74	2.92%

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

五、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项 目	偏离度
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%(含)–0.5%间的次数	120
报告期内偏离度的最高值	0.4856%
报告期内偏离度的最低值	0.0634%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值简单平均值	0.2682%

六、投资组合报告附注

1、基金计价方法说明：本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金采用固定单位净值，基金账面份额净值为 1.00 元。

2、本报告期内，本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过基金资产净值 20%的情况。

3、本报告期内无需要说明的证券投资决策程序。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	725,565.94
2	应收申购款	66,970,858.83
合计		67,696,424.77

5、本报告期内基金管理人未运用基金固有资金投资本基金。

第三节 动力平衡基金投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例
股票	1,511,737,106.65	77.53%
债券	392,191,368.13	20.11%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	12,641,086.94	0.65%
资产支持证券	0.00	0.00%
其它资产	33,411,294.70	1.71%
资产总计	1,949,980,856.42	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比
A 农、林、牧、渔业	1,950,000	26,403,000.00	1.38%
B 采掘业	2,896,830	34,003,096.10	1.78%
C 制造业	38,500,168	534,293,595.95	27.93%
C0 食品、饮料	2,807,431	147,836,324.34	7.73%
C1 纺织、服装、皮毛		0.00	0.00%
C2 木材、家具		0.00	0.00%
C3 造纸、印刷		0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,000,000	23,560,000.00	1.23%
C5 电子		0.00	0.00%
C6 金属、非金属	26,858,181	225,002,204.36	11.76%
C7 机械、设备、仪表	4,247,746	68,631,638.35	3.59%
C8 医药、生物制品	3,586,810	69,263,428.90	3.62%
C99 其他制造业		0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		0.00	0.00%
E 建筑业		0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	4,872,564	41,285,185.56	2.16%
G 信息技术业	10,300,000	83,260,000.00	4.35%
H 批发和零售贸易	4,508,640	122,089,105.60	6.38%
I 金融、保险业	35,704,195	507,771,861.04	26.54%
J 房地产业	8,779,160	145,303,842.40	7.60%
K 社会服务业		0.00	0.00%
L 传播与文化产业	697,000	17,327,420.00	0.91%
M 综合类		0.00	0.00%
合计	108,208,557	1,511,737,106.65	79.03%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数 量(股)	市 值(元)	市值占净值比
600036	招商银行	9,986,000	163,370,960.00	8.54%
600000	浦发银行	5,497,924	117,160,760.44	6.12%
600016	民生银行	11,416,291	116,446,168.20	6.09%
600519	贵州茅台	1,041,192	91,447,893.36	4.78%
000002	万 科 A	5,570,735	86,012,148.40	4.50%
600030	中信证券	2,429,980	66,532,852.40	3.48%
600005	武钢股份	10,199,950	64,871,682.00	3.39%
000825	太钢不锈	4,786,420	62,510,645.20	3.27%
600383	金地集团	3,208,425	59,291,694.00	3.10%
600694	大商股份	1,804,440	53,032,491.60	2.77%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于景顺长城基金管理有限公司网站的年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

(一)报告期内累计买入金额占期初基金资产净值 2%以上的股票明细

股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比
600036	招商银行	139,242,914.62	54.60%
600000	浦发银行	97,830,092.31	38.36%
600519	贵州茅台	80,073,261.67	31.40%
600016	民生银行	79,061,759.84	31.00%
000002	万 科 A	63,527,218.39	24.91%
600694	大商股份	55,002,028.32	21.57%
600030	中信证券	53,306,093.88	20.90%
600050	中国联通	51,338,396.71	20.13%
000538	云南白药	49,489,291.90	19.41%
600269	赣粤高速	45,368,540.57	17.79%
000063	中兴通讯	44,649,907.72	17.51%
600383	金地集团	42,470,150.71	16.65%
000825	太钢不锈	41,606,450.60	16.31%
600005	武钢股份	41,115,861.43	16.12%
000709	唐钢股份	36,946,189.15	14.49%
000987	广州友谊	36,274,003.42	14.22%
600438	通威股份	35,555,206.65	13.94%
000792	盐湖钾肥	34,567,939.02	13.55%
000550	江铃汽车	29,405,115.06	11.53%
600879	火箭股份	28,015,779.08	10.99%
600887	伊利股份	27,151,152.11	10.65%
002024	苏宁电器	25,196,438.74	9.88%
600028	中国石化	25,073,973.75	9.83%
000423	S 阿 股	24,268,