景顺长城景系列开放式证券投资基金暨景顺长城优选股票证券投资基金
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 2009 年第 2 号更新招募说明书摘要

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

重要提示

(一)景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称"本系列基金")是契约型开放式证券投资基金,下设景顺长城优选股票证券投资基金、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三只基金。三只基金作为独立的法律主体设立并存续,三只基金在基金财产管理、基金交易及交易单元、基金估值、基金收益分配、基金费用支出、基金终止等方面具有独立性。三只基金通过基金间转换构成一个统一的基金体系。

(二)本系列基金经中国证监会 2003 年 8 月 25 日证监基金字[2003]96 号文件批准发起设立,并于 2003 年 10 月 24 日正式成立。

(三)基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本系列基金募集的核准,并不表明其对本系列基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本系列基金没有风险。

(四)投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

(五)基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

(六)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(七)基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。

(八)托管人对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

(九) 本招募说明书所载内容截止日为 2009 年 10 月 24 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日。本招募说明书中财务数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名 称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层
法定代表人:徐 英
批准设立文号:证监基金字[2003]76 号
设立日期:2003 年 6 月 12 日
办公地址:深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层
电 话:0755–82370388
客户服务电话:4008888606
传 真:0755–22381339
联系人:杨皞阳

(二)基金管理人基本情况

本系列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,由长城证券有限责任公司、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%。

公司设立了两个专门机构:风险管理委员会和投资决策委员会。风险管理委员会负责公司整体运营风险的控制。投资决策委员会负责指导基金财产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设九个部门,分别是:投资部;国际投资部;中央交易室;市场部;机构理财部;法律、监察稽核部;运营部;财务、行政和人力资源部;总经理办公室。投资部负责根据投资决策委员会制定的投资原则进行国内股票及债券选择和组合的投资管理并完成对宏观经济、行业公司及市场的研究。国际投资部主要从事与 QDII、QFII 等国际业务相关的基金产品设计、投资管理、国际合作和培训等业务。中央交易室主要负责完成投资部、国际投资部下达的交易指令,并进行事前的风险控制。市场部从事基金产品设计、市场开发及销售、项目管理、客户服务等工作。机构理财部负责机构专户理财业务,开发机构客户,使其认识并了解我公司在企业年金、社保等方面所提供的基金产品及服务。法律、监察稽核部负责对公司管理和基金运作合规性进行全方位的监察稽核,并向公司管理层和监管机关提供独立、客观、公正的法律监察稽核报告。运营部负责公司开放式基金的注册登记、清算和会计工作并负责公司的计算机设备维护、系统开发及网络运行和维护。财务、行政和人力资源部负责公司财务管理、人力资源管理及日常行政事务管理等。总经理办公室主要受总经理委托,协调各部门的工作,并负责公司日常办公秩序监督、工作项目管理跟进、风险管理控制等工作。

公司现有员工 106 人,其中 62 人具有硕士及以上学历。所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

公司已经建立了健全的内部风险控制制度、内部稽核制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度体系。

(三)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

徐英女士,董事长,北京财贸学院金融系毕业,经济学学士。曾任北京燕山石化总厂研究院车间副主任、党支部书记,北京财贸学院金融系讲师,海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理,长城证券有限责任公司总裁、董事长。

罗德城先生,董事,毕业于美国 Babson 学院,获学士学位及工商管理硕士学位。现任景顺集团亚太区首席执行官。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House 亚洲分公司的董事总经理。1992 至 1996 年间出任香港投资基金公会管理委员会成员,并于 1996 至 1997 年间担任公会主席。1997 至 2000 年间,担任香港联交所委员会成员,并在 1997 至 2001 年间担任香港证监会顾问委员会成员。

许义明先生,董事,总经理,香港大学社会科学学士及香港城市大学金融工程学硕士,曾任职于前美国大通银行香港、台湾及伦敦分行财资部,汇丰银行总行中国环球市场部,历任台湾景顺证券投资信托股份有限公司董事兼总经理,景顺香港大中华区业务拓展总监。2009 年 8 月 6 日,公司发布公告,经董事会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]694 号文核准,聘任许义明先生担任本公司总经理。

杨平先生,董事,北京大学国际 MBA 学历。历任北京国际信托投资公司外汇部首席交易员、加拿大蒙特利尔银行北京分行资金部和市场部高级经理、中国人民保险公司投资部投资总监、中国人保资产管理有限公司银行/外汇业务部副总经理、中国人民保险(香港)有限公司投资部总经理、长城证券有限责任公司总裁助理等,现任长城证券有限责任公司副总经理。

童赠银先生,独立董事,高级会计师,现已离休。曾任民生银行监事会监事长、中国人民银行总行会计司副司长、司长,中国人民银行副行长(副部级),国务院证券委员会副主任兼中国证监会副主席(副部级)、中国民生银行行长。

伍同明先生,独立董事,香港大学文学士(1972 年毕业),香港会计师公会会员(HKSA)、英国特许公认会计师(ACCA)、香港执业会计师(CPA)、加拿大公认管理会计师(CMA)。现为"伍同明会计师行"所有者。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识,1972–1977 受训于国际知名会计师楼"毕马威会计师行"[KPMG]。

靳庆军先生,独立董事,1982 年毕业于安徽大学外语系英语专业,获文学学士,1987 年毕业于中国政法大学,获国际法专业法学硕士。现任金杜律师事务所合伙人。曾担任中信律师事务所涉外专职律师,在香港马士打律师行、英国律师行 C1yde & Co. 从事律师工作,1993 年发起设立信达律师事务所,担任执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄海洲先生,监事,硕士,毕业于武汉大学。现任长城证券有限责任公司副总经理。曾任招商银行股份有限公司人力资源部经理、工程管理部经理、深圳新江南投资有限公司副总经理及长城证券有限责任公司监事。

Mr. Dean Chisholm,监事,毕业于 London School of Economic,获得学士学位,并取得英格兰暨威尔斯特许会计师机构 (Institute of Chartered Accountants in England and Wales) 所颁发的英国特许会计师执照。现为景顺集团亚太区运营部总监。曾任职于景泰资产管理有限公司亚太地区运营部,普华永道会计师事务所(PwC)英国及香港核数师。现在出任 Hong Kong Securities Industry Group 主席及 Omgeo Hong Kong Advisory Board 的联席主席。

吴建军先生,监事,1989 年毕业于河南财经学院,获学士学位,1992 年毕业于人民银行总行研究生部,获经济学硕士学位。现任景顺长城基金管理公司副总经理兼任运营部总监。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理,长城证券有限责任公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003 年 6 月加入本公司,任运营部总监。2005 年 5 月起任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任运营部总监。

3、其他高级管理人员

吴建军先生,副总经理,1989 年毕业于河南财经学院,获学士学位,1992 年毕业于人民银行总行研究生部,获经济学硕士学位。曾任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理,长城证券有限责任公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003 年 6 月加入本公司,任运营部总监。2005 年 5 月起任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任运营部总监。

宋宜农先生,副总经理,英国雷丁大学国际证券与投资银行硕士。曾任长盛基金管理有限公司市场发展部副总监、总监,光大保德信基金管理有限公司首席市场营销总监。2005 年 9 月加入本公司,任市场部总监。2006 年 2 月起任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任市场部总监。

蔡宝美女士,副总经理,英国克兰菲尔德大学商学硕士。1997 年至 2006 年在汇丰银行资产管理有限公司台湾分公司担任国际投资部副总裁,兼任基金经理;也曾在摩根富林明投资信托股份有限公司担任研究员职务。加入本公司之前,在香港涌金资产管理有限公司担任投资经理职务;2008 年 5 月加入本公司,任投资执行长。2009 年 3 月起任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任投资总监。

4、督察长

刘焕喜先生, 1989 年毕业于武汉大学哲学系,获学士学位,1998 年毕业于华中农大经贸学院投资与金融系,获博士学位。曾任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师、《证券时报》社编辑记者、长城证券研发中心研究员、长城证券行政部副总经理等职务。

5、本系列基金基金经理简历

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。本系列基金下设三个基金,由基金经理小组负责本系列基金的投资管理,聘任基金经理如下:

(1)毛从容女士,华中理工大学经济学硕士。拥有 10 年金融、证券从业经验,1997 年进入交通银行深圳分行工作,2000 年 7 月加入长城证券金融研究所, 负责宏观和债券研究并担任研究所债券小组组长。2003 年 3 月加入景顺长城基金管理有限公司,担任投资部研究员。

(2)张继荣先生,清华大学,化学工程博士;东北大学,工学硕士。曾任大鹏证券研究所分析师,融通基金行业研究员、研究策划部总监助理及基金经理,银华基金投资管理部策略分析师及基金经理等职务。具有 9 年证券、基金行业从业经历。2009 年 3 月加入本公司。

6、本系列基金现任基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理张继荣先生曾于 2007 年 11 月至 2009 年 2 月担任银华优势企业证券投资基金基金经理。

7、本基金现任基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金现任基金经理张继荣先生目前兼任景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)基金经理。

8、本系列基金历任基金经理姓名及管理时间

基金经理姓名	管理时间
陈利宏 先生	2003年 10 月 24 日—2004 年 11 月 17 日
曾昭雄 先生	2004年 11 月 18 日—2005 年 5 月 31 日
杨兵兵 女士	2003年 10 月 24 日—2007 年 9 月 14 日
涂强 先生	2006年 11 月 22 日—2009 年 8 月 6 日
邓春鸣 先生	2007年 9 月 15 日—2009 年 8 月 6 日

9、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由总经理、分管投资的副总经理、投资总监、投资副总监等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下:

许义明先生,总经理;
蔡宝美女士,分管投资的副总经理,投资总监;
李志嘉先生,投资副总监;

10、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人的基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号
首次注册登记日期:1983 年 10 月 31 日
变更注册登记日期:2004 年 8 月 26 日
注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:董杰
托管部门联系人:宁敏
电话:(010)66594977
传真:(010)66594942

发展概况:

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域,其中,商业银行业务是中国银行的传统主营业务,包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务,以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务;个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、"中银理财"服务、私人银行业务和银行卡业务等;金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进,截至 2008 年末,中国银行境内外机构共有 10,789 家,其中内地机构 9,983 家,港澳及境外机构 806 家。内地商业银行部分,一级分行、直属分行 37 家,二级分行 284 家,基层分支机构 9,659 家,是中国国际化程度最高的银行。

2009 年上半年中国银行集团实现归属于母公司所有者的净利润 410.05 亿元,股本净回报率(不含少数股东权益,ROE)为 17.39%,总资产净回报率(ROA)为 1.14%,资本充足率为 11.53%。

多年来中国银行围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。在与国际同业和国内同业的激烈竞争中, 凭借雄厚的实力和优良的服务, 中国银行脱颖而出, 成为北京 2008 年奥运会唯一的银行合作伙伴;自 1990 年以来,中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜;2004 至 2008 年,中国银行连续被《环球金融》杂志评为"中国最佳外汇银行",并评为 2008 年度中国最佳债券和现金管理银行;2008 年,中国银行在《银行家》杂志"世界 1000 家大银行"中排名第 10 位;2008 年中国银行被《财资》评为中国最佳贸易融资银行;2008 年中国银行被《金融亚洲》评为最佳贸易融资银行、最佳外汇交易银行、最佳派息政策承诺奖、亚洲最佳公司(最佳股利政策);2008 年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为中国最佳外汇服务银行和中国本土最佳贸易服务银行;2008 年中国银行被《欧洲货币》评为中国区最佳商业银行、中国区债务资本市场最佳投资银行、香港区最佳商业银行和中国区最佳外汇服务奖;2008 年中国银行再次荣获"优信咨询(Universum)"评选的"最理想雇主奖"。

(二)主要人员情况

肖钢先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月,1981 年毕业于湖南财经学院,1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月,1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000 年 11 月加入本行并自此担任本行副行长。于 1980 年 11 月至 2000 年 11 月任职于中国建设银行,曾工作于多个岗位,先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978 年毕业于南京信息工程大学。2002 年 6 月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生, 自 2007 年 11 月 27 日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自 2005 年 9 月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员,1983 年 7 月至 2005 年 9 月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于 1962 年 11 月,获得西南财经大学博士学位。

(三)基金托管部门的设置及员工情况

中国银行总行于 1998 年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类, 中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队,现有员工 110 余人;另外,在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

(四)证券投资基金托管情况

截止 2009 年 8 月末, 中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合(二期)、国泰金鹏蓝筹混合、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、金鹰成份优选股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、万家 180 指数、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、招商先锋混合、泰达荷银精选股票、泰达荷银集利债券、友邦华泰盛世中国股票、友邦华泰积极成长混合、友邦华泰价值增长股票、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、宝盈核心优势混合、国富成长动力股票、泰信蓝筹精选股票、友邦华泰货币、国泰区位优势股票、招商行业领先股票、东方核心动力股票、金鹰行业优势股票、泰信债券增强收益、万家稳健增利债券、嘉实回报混合、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII–FOF)等 78 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型、指数型、行业型、创新型等多种类型的基金和理财品种,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(五)托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权,并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(六)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同的相关规定,托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项,对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中,如发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构:

名 称:景顺长城基金管理有限公司
住 所及办公地址:深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层
法定代表人:徐 英
批准设立文号:证监基金字[2003]76 号
电 话:(0755)82370388–1661
传 真:(0755)22381325
联系人:严丽娟

2、代销机构:

(1) 中国银行股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人:肖 钢
客户服务电话:95566(全国)
网址:www.boc.cn

(2) 中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市海淀区复兴路甲 23 号
办公地址:北京市西三环北路 100 号金玉大厦
法定代表人:杨明生
客户服务热线:95599
网址:www.abchina.com

(3)中国工商银行股份有限公司
注册地址及办公地址:中国北京复兴门内大街 55 号
法定代表人:姜建清
联系人:田耕
客户服务电话:95588(全国)
网址:www.icbc.com.cn

(4)深圳发展银行股份有限公司
注册地址及办公地址:深圳市深南东路 5047 号
法定代表人:周林
电话:(0755)82088888
传真:(0755)82080714
联系人:周勤、汪小苗
网址:www.sdb.com.cn

(5)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 154 号中山大厦
法定代表人:高建平
电话:(0591)87844211
联系人:陈丹
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

(6)招商银行股份有限公司
注册地址及办公地址:深圳市福田区深南大道 7088 号
法定代表人:秦晓
电话:95555
联系人:刘薇
网址:www.cmbchina.com

(7)广东发展银行股份有限公司
注册地址及办公地址:广州市农林下路 83 号
法定代表人:李若虹
服务热线:020–38322730、38322974
联系人: 罗环宇 张大奕
网址:www.gdb.com.cn

(8)中国光大银行股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
法定代表人:王明权
客户服务电话:95595(全国)
网址:www.cebbank.com

(9)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址:上海市北京东路 689 号
法定代表人:金运
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

(10)中国建设银行股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市西城区金融大街 25 号
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址: www.ccb.com

(11)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区正义路 4 号
注册地址及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:董文标
联系电话:010–58351666
传真:010–83914283
联系人:李群、吴海鹏
客户服务热线:95568
公司网站:www.cmbc.com.cn

(12)交通银行股份有限公司
注册地址及办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(13)北京银行股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市西城区金融大街丙 17 号
法定代表人:闫冰竹
电话: 010–66226044
传真: 010–66223314
联系人: 李娟
客户服务电话:010–96169(北京)022–96269(天津)021–53599688(上海)
网址:www.bankofbeijing.com.cn

(14)中信银行股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
电话:(010)65541585
传真:(010)6554–1230
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(15)浙商银行股份有限公司
注册地址:中国杭州市庆春路 288 号
办公地址:中国杭州市庆春路 288 号
法定代表人:张达洋
电话:(0571)87659084
传真:(0571)87659188
联系人:吴军阳
客户服务热线:95105665
公司网站:www.czbank.com

(16)长城证券有限责任公司
注册地址及办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层
法定代表人:黄耀华
联系人:匡婷
电话:0755–83516289
传真:0755–83516199
客户服务热线:0755–33680000、400 6666 888
网址:www.cc168.com.cn

(17)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:黎晓宏
联系人:魏明
联系电话:010–65186080
客户服务电话:4008888108(免长途费);
传真:010–65182261
网址:www.csc108.com

(18)申银万国证券股份有限公司
注册地址及办公地址: 上海市常熟路 171 号
法定代表人:丁国荣
联系人:曹晔
电话:021–54033888
传真:021–54038844
客户服务电话:021–962505
网站:www.sw2000.com.cn

(19)招商证券股份有限公司
注册地址及办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38–45 层
电话:0755–82943666
传真:0755–82943636
联系人:黄健
客户服务热线:95565、4008888111
网址:www.newone.com.cn

(20)兴业证券股份有限公司
地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:兰荣
客户服务热线:4008888123
业务联系电话:021–38565785
业务联系人:谢高得
网站:www.xyzq.com.cn

(21)国泰君安证券股份有限公司
地址:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼
法定代表人:祝幼一
联系人:芮敏祺
电话:021–62580818–213
传真:021–62569400
客户服务热线:4008888666
网站:www.gtja.com

(22)中国银河证券有限责任公司
注册地址及办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:胡关金
电话:010–66568047
传真:010–66568116
联系人:李洋
客服电话:4008–888–8888
网址:www.chinastock.com.cn

(23)广发证券股份有限公司
注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅
网址:www.gf.com.cn

(24)华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
办公地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人:马昭明
联系人:盛宗凌
电话:0755–82492000
传真:0755–82492962
客服电话:4008888555、95513
网址:www.lhzq.com

(25)国都证券有限责任公司
注册地址及办公地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 号 10 层
法定代表人:王少华
电话:010–84183389
传真:010–84183311–3389
客服电话:400–818–8118
联系人:黄静
网址:www.guodu.com

(26)海通证券股份有限公司
注册地址及办公地址:上海市淮海中路 98 号
法定代表人:王开国
电话:021–23219000
传真:021–23219100
联系人:金芸、李笑鸣
客服电话:95553
网址:www.htsec.com

(27)中信金通证券有限责任公司
注册地址:杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座
办公地址:杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座
法定代表人:刘军
电话:0571– 85783750
传真:0571–85783771
联系人:龚晓军
网址:www.bigsun.com.cn
www.96598.com.cn
客户服务热线:0571–96598

(28)中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人:唐新宇
网址:http://www.bocichina.com.cn
客户服务热线:4006208888 或各地营业网点咨询电话

(29)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
办公地址:深圳市深南大道 2028 号中国凤凰大厦 1 号楼 7 层
法定代表人:牛冠兴
开放式基金咨询电话:0755–82825555
开放式基金业务传真:0755–82558003
联系电话:0755–82558332
网址:http://www.axzq.com.cn

(30)国元证券有限责任公司
注册地址及办公地址:安徽省合肥市寿春路 179 号
法定代表人:凤良志
客服电话:400–888–8777、95578
联系人:程维
电话:0551–2207936
传真:0551–2207965
网址: www.gyzq.com.cn

(31)西部证券股份有限公司
注册地址及办公地址:西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16–17 层
法定代表人:刘建武
客服热线:029—87419999
网址:www.westsecu.com.cn

(32)名称:中国国际金融有限公司
注册地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层
办公地址:北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人:李剑阁
网址:www.cicc.com.cn
电话:010–65051166
客户服务电话:010–85679238,010–85679169
传真:010–65051156

(33)公司名称:华宝证券经纪有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
邮政编码:200120
注册资本:5 亿元人民币
法定代表人:陈林
电话:021–50122222
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
联系人:徐方亮
业务联系电话:021–50122128
网址:www.cnhbstock.com

(34)名称:爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路 758 号 23 楼
办公地址:上海市南京西路 758 号 24 楼
法定代表人:张建华
联系人:陈敏
电话:021–32229888
传真:021–62878783
客服热线:021–63340678
网址:www.ajzq.com

(35)名称:广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层
办公地址:福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591–87841160
传真:0591–87841150
客服热线:96326(福建省外请加拨 0591)
网址:www.gfhfzq.com.cn

(36)名称:平安银行股份有限公司
注册地址及办公地址:深圳市深南中路 1099 号
法定代表人:孙建一
联系人:蔡宇洲 霍兆龙
电话:0755–22197874 25879591
传真:0755–22197701
客服热线:40066–99999
网址:http://www.pingan.com/bank/

(37)名称:信达证券股份有限公司
注册地址及办公地址:北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010–88656100
传真:010–88656290
客服热线:400–800–8899
网址:www.cindasc.com

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本系列基金,并及时履行公告义务。

(二)注册登记人

名 称:景顺长城基金管理有限公司
住 所:深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层
法定代表人:徐 英
电 话:(0755)82370388–1668
传 真:(0755)22381325
联系人:杨波

(三)律师事务所及经办律师

名 称:北京市金诚同达律师事务所
住 所:北京建国门外大街甲 24 号东海中心 17 层
负责人:田予
电 话:(010)65155566
传 真:(010)65263519
经办律师:贺宝银、徐志浩

(四)会计师事务所及经办注册会计师

名 称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区沈家弄 325 号
办公地址:上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼
法人代表:Kent Watson
经办注册会计师:汪棣、单峰
联系电话:021–63863388
传真:021–63863300

四、基金的名称

景顺长城景系列开放式证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的申购、赎回

(一)本系列基金的申购、赎回费率

基金名称	申购费率	赎回费率
优选股票基金	M<50 万 1.5% 50 万≤M<100 万 1.2% 100 万≤M<200 万 1.0% 200 万≤M<500 万 0.6% M≥500 万 按笔收取,500 元/笔	1年以内 0.4% 1 年以上(含)–2 年 0.25% 2 年以上(含) 0
货币市场基金	0	0
动力平衡基金	M<50 万 1.5% 50 万≤M<100 万 1.2% 100 万≤M<200 万 1.0% 200 万≤M<500 万 0.6% M≥500 万 按笔收取,500 元/笔	1年以内 0.4% 1 年以上(含)–2 年 0.25% 2 年以上 (含) 0

M 表示申购金额。

1、本系列基金赎回费 75%归注册登记费用,25%归基金所有,作为对其他持有人的补偿。

2、就赎回费而言,1 年指 365 天,2 年指 730 天。

(二)申购份额、赎回金额的计算方式

1、基金申购费用及申购份额的计算

本基金的申购费用及申购份额的计算公式如下:

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中:

净申购金额 = 申购金额 /(1+ 申购费率);
申购费用 = 申购金额 – 净申购金额;
申购份额 = 净申购金额 /T 日基金份额净值。

基金申购份额保留到小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。

例:某投资者投资 5,000 元申购动力平衡基金,申购费率为 1.5%,假设申购当日基金份额净值为 1.1283 元,则其可得到的申购份额为:

净申购金额 =5000/(1+1.5%)=4926.11 元;
申购费用 =5000–4926.11=73.89 元;
申购份额 =4926.11/1.1283=4365.95

2、基金赎回金额的计算

赎回总额 = 赎回份额×赎回当日基金份额净值
赎回费用 = 赎回总额×赎回费率
赎回金额 = 赎回总额–赎回费用

例:某投资者持有优选股票基金 10,000 份基金份额,赎回费率为 0.4%,假设赎回当日基金份额净值是 1.1489 元,则可得到的赎回金额为:

赎回总额 = 10,000×1.1489 = 11,489 元
赎回费用 = 11,489×0.4% = 45.96 元
赎回金额 = 11,489–45.96 = 11,443.04 元

(三)货币市场基金申购份额、赎回金额的计算方式

1、基金申购份额的计算

申购份额 = 申购金额 /1.00 元

基金申购份额保留到小数点后两位。

2、基金赎回金额的计算

部分赎回时:
赎回金额 = 赎回份额×1.00 元
全额赎回时:
赎回金额 = 赎回份额×1.00 元 + 待结转收益

(四)本系列基金的转换费率

由货币市场基金向景顺长城优选股票基金、景顺长城动力平衡基金转换时,转换费率参见下表。

	转出份额(M)	转换费率
景顺长城优选股票基金 景顺长城动力平衡基金	M<50万	1.5%
	50万≤M<100 万	1.2%
	100万≤M<200 万	1.0%
	200万≤M<500 万	0.6%
	M≥500 万	按笔收取,500 元/笔

由景顺长城优选股票基金、景顺长城动力平衡基金向货币市场基金转换时,转换费率为 0,仅收取转出基金的赎回费。

由景顺长城优选股票基金、景顺长城动力平衡基金转换形成的货币市场基金份额再向上述基金转换时,转换费率为 0。

鉴于原恒丰债券基金与景系列开放式证券投资基金旗下另两只基金之间免收转换费,由恒丰债券基金转变而来的货币市场基金基金份额首次向景顺长城优选股票基金、景顺长城动力平衡基金申请转换时,仍然免收转换费。

赎回补差费的 25%计入转出基金的基金财产。

优选股票基金和动力平衡基金之间免费转换。

(五)转换份额的计算方式

转换份额根据申请转出基金份额乘以转出基金的份额净值,扣除与转换相关的手续费后再除以转入基金份额净值计算。

假设某基金份额持有人欲将原持有的基金 A 转换为基金 B, 基金间转换公式为:

$$B = 【A \times Anav / (1+x)】/ Bnav$$

其中:B 为转换后可得到的基金 B 的份额
A 为原来持有的基金 A 的份额
Anav 为基金间转换当日基金 A 的基金份额净值
x 为转换费率
Bnav 为基金间转换当日基金 B 的基金份额净值

基金转换份额保留到小数点后两位,舍去部分所代表的资产归基金所有。

例:某投资者持有货币市场基金 20,000 份基金份额,现将其中 10,000 份转换为优选股票基金,且该转换属于需要收取转换费的情形。假设优选股票基金当日基金份额净值是 1.0123 元,则可得到的优选股票基金份额为:

货币市场基金转出金额 =10,000×1.0000=10,000 元;
优选股票基金净转入金额 =10,000/(1+1.5%)=9,852.22 元;
转换费用 =10,000–9,852.22=147.78 元;
优选股票基金转入份额 =9,852.22/1.0123=9,732.51 份

例:某投资者持有优选股票基金 10,000 份基金份额,现将其转换为动力平衡基金。假设优选股票基金当日基金份额净值是 1.0888 元,动力平衡基金当日基金份额净值是 1.0633 元,则可得到的动力平衡基金份额为:

优选股票基金转出金额 = 10,000×1.0888 = 10,888 元
转换费用 = 0 元
动力平衡基金转入金额 = 10,888–0 = 10,888 元
动力平衡基金转入份额 = 10,888/1.0633 = 10,239.81 份

(六)货币市场基金转换份额的计算方式

$$Y = [X \times a \times (1-b)/(1+c)]/d$$

Y:转换后可得到的基金 Y 的份额
X:原来持有的基金 X 的份额
a:转换申请受理当日基金 X 的份额净值
b:赎回补差费率,b=max[基金 X 的赎回费率 – 基金 Y 的赎回费率,0]
c:转换费率,具体费率参见本章"(五)本系列基金的转换费率"
d:转换申请受理当日基金 Y 的份额净值

基金转换份额保留到小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

七、基金的投资目标

本系列基金的投资目标是:运用专业化的投资管理,为投资者提供长期稳定并可持续的资本增值。各基金投资目标如下:

1、优选股票基金利用"景顺长城股票数据库"对股票进行精密和系统的分析,构建具有投资价值的股票组合,力求为投资者提供长期的资本增值。

2、货币市场基金在保持本金的高流动性和安全性的前提下,获得高于基准的投资回报。

3、动力平衡基金以获取高于银行一年期定期存款年利率 2 倍的回报为目标,注重通过动态的资产配置以达到当期收益与长期资本增值的兼顾,争取为投资者提供长期稳定的回报。

八、基金的投资方向

本系列基金下设的优选股票基金和动力平衡基金的投资范围包括股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的 A 股;债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转换债券等。

本系列基金下设的货币市场基金投资于以下金融工具:

1、现金;
2、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;
3、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;
4、期限在一年以内(含一年)的债券回购;
5、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
6、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

九、基金的投资策略

1、资产配置

本系列基金下优选股票基金和动力平衡基金均有债券和股票资产,但是配置比例显著不同:

优选股票基金	动力平衡基金
股票:70–80% 债券:20–30%	股票:20–80% 债券:20–80%

* 百分比为占基金资产净值比例。

2、优选股票基金和动力平衡基金的股票选择及组合构建

(1)投资流程

在构建和管理投资组合过程中,这两只基金主要采取"自下而上"的投资策略,着重选择基本面良好或价值被过分低估的股票。同时,也会结合"自上而下"的投资策略,即基于对宏观经济运行状况及政策分析、金融货币运行状况及政策分析、产行业运行景气状况及政策分析,做出产行业偏好选择,进而结合证券市场状况和政策分析,做出资产配置及组合构建的决定。

(2)选股原则

股票投资以成长、价值及收益为基础,在合适的价位买入具有高成长性的成长型股票、价值被市场低估的价值型股票以及能提供稳定收益的收益型股票。

(3)选股程序

① 通过"景顺长城股票数据库"的详细分析与其他深入的研究,如实地考察、电话会议、行业分析等,判断股票是否值得投资,然后组建"股票买进名单";

② 在深入研究的基础上(包括对各种量化指标的分析,结合各券商的投资分析报告),综合公司的分析判断,做出对所研究股票的投资结论,并持续维护"股票买进名单";

③ 根据基金的投资目标、投资限制和投资策略等要求,考虑收益和风险的配比、股票的流动性以及其它因素,推荐不同基金的股票买进名单。

3、债券选择和组合构建

(1)投资流程

本系列基金下各基金债券投资部分着重本金安全性和流动性。综合分析宏观经济形势,并对货币政策与财政政策以及社会政治状况等进行研究,着重利率的变化趋势预测,建立对收益率曲线变动的预测模型。通过该模型进行估值分析,确定价格中枢的变动趋势;同时,计算债券投资组合久期、到期收益率和期限等指标,进行"自下而上"的选券和债券品种配置。

(2)债券投资组合管理

① 组合久期管理:为了充分地控制利率变动风险, 需要及时对债券投资组合进行调整。当预测利率将上升时,本系列基金将缩短组合债券的平均久期、持有短期债券、浮动债等来减低利率风险;反之,当预测利率将下降时,本系列基金将增大组合的平均久期并增持长期债券来提高组合的收益水平。在组合久期确定后, 本系列基金将通过不同期限债券的匹配组合, 从价格的相对变化中获得较高的收益。

② 资产配置: 在未来利率走势预期的基础上, 本系列基金通过久期与凸性管理的手段,在不同期限的债券以及固息债与浮息债之间进行配置。 同时,本系列基金以市场规模、收益率与流动性为基础,在不同市场以及不同的债券类别之间进行配置。

③ 债券选择

本系列基金在考虑信用质量和期限等因素后,将选择以下类型的债券:

- ● 到期收益率较高、具有较好流动性的债券
- ● 有较高当期收入的债券
- ● 有增值潜力、价格被低估(即收益率和久期过分偏离合理水平)的债券
- ● 预期信用质量将得到改善的金融债或企业债券
- ● 期权和债性突出的可转换债
- ● 收益率水平合理的新券或者市场尚未正确定价的创新品种

④ 组合构建: 本系列基金通过宏观经济分析,对利率走势做出判断,在此基础上对各类资产进行合理配置。同时,本系列基金根据收益率和流动性、债券资质"自下而上"地进行个券选择,组成最终的投资组合。在确定具体个券后, 须依据下列标准构建投资组合:

- ● 确保执行投资策略并确保投资组合久期在规定的范围内
- ● 保持投资组合分散化,基金持有单一债券品种不得超过基金净值的 10%
- ● 保持投资组合的流动性,以满足基金正常现金流的需要
- ● 控制投资组合风险在一定的范围内
- ● 债券投资组合中,债券信用等级最低为 BBB+ 或同等信用,投资组合的平均信用等级应在 AA+ 或以上

⑤ 组合优化:在债券组合管理中开发出独有的程序对债券组合定期进行量化分析,包括精确计算组合的 VAR 值、贡献分析、跟踪误差等指标,根据量化分析结果对债券组合品种进行相应的配置调整,并通过了解组合的风险特征、预算,按照宏观经济分析模型预测和企业信用分析的结果,对组合做出连续的优化调整。

⑥ 现金和回购资产: 保留足够的现金以应付基金日常的现金需要。

4、货币市场基金的投资决策程序和方法:

(1)投资决策程序

①基金经理依据投资部对宏观经济、货币政策、财政政策以及市场资金供求状况的综合分析,对短期利率变化趋势做出判断,结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议;

②投资决策委员审核基金经理提交的资产配置建议,并最终决定资产配置方案;

③基金经理对各投资品种进行收益率、流动性、信用风险、平均剩余期限分析,同时根据未来利率变化的预期以及投资品种的利率敏感性来综合评定各品种的投资价值;

④基金经理结合经审定的资产配置方案、基金日常申购、赎回情况进行具体的投资组合构建。

⑤投资总监审核投资组合方案,如无异议,由基金经理具体执行投资计划。

(2)投资管理方法

①深入分析宏观经济、货币政策和市场资金供求变化,对短期利率走势形成合理预期,并据此调整基金的资产配置策略。

②通过利率预期策略,确定组合的平均剩余期限和各类资产的配置比例。

③通过流动性管理策略,在保持基金资产高流动性的前提下,确保基金的稳定收益。

④以严谨的研究分析为基础,积极实施时机策略。

本系列基金会持续地进行定期与不定期的投资组合回顾与风险监控,适时做出相应调整。

十、基金的业绩比较基准

优选股票基金:上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80% + 中国债券总指数×20%。

货币市场基金:税后一年期定期存款利率。

动力平衡基金:一年期银行定期存款年利率的 2 倍。

十一、基金的风险收益特征

优选股票基金是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具。适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资群体。

货币市场基金具有低风险和收益稳定的特点, 投资目标是在保持本金的高流动性和安全性的前提下,获得高于基准的投资回报。

动力平衡基金是一种具有中等风险的投资工具,除了结合以上景顺长城股票及债券基金的风险管理程序以外,为达到平稳回报的目的,该基金还将独立地对风险来源进行评估,并设立额外的风险控制管理手段。

十二、基金投资组合报告(未经审计)

景顺长城基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,已经复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2009 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,019,154,027.59	75.16
	其中:股票	2,019,154,027.59	75.16
2	固定收益投资	586,592,397.60	21.84
	其中:债券	586,592,397.60	21.84
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	75,363,762.01	2.81
6	其他资产	5,211,279.81	0.19
7	合计	2,686,321,467.01	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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	22,404,985.69	0.85
B	采掘业	151,981,549.28	5.74
C	制造业	940,260,690.20	35.54
C0	食品、饮料	117,539,962.44	4.44
C1	纺织、服装、皮毛	5,508,111.32	0.21
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	25,008,701.40	0.95
C4	石油、化学、塑胶、塑料	105,583,731.54	3.99
C5	电子	11,423,569.10	0.43
C6	金属、非金属	145,486,902.23	5.50
C7	机械、设备、仪表	266,045,189.13	10.05
C8	医药、生物制品	263,664,523.04	9.96
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	16,935,345.74	0.64
H	批发和零售贸易	215,642,353.49	8.15
I	金融、保险业	386,686,707.24	14.61
J	房地产业	186,442,456.50	7.05
K	社会服务业	–	–
L	传播与文化产业	40,995,322.27	1.55
M	综合类	57,804,617.18	2.18
	合计	2,019,154,027.59	76.31

(三)报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,197,573	111,416,951.10	4.21
2	600000	浦发银行	5,336,930	104,870,674.50	3.96
3	000024	招商地产	3,720,981	93,024,525.00	3.52
4	000001	深发展 A	4,381,165	87,667,111.65	3.31
5	000425	徐工机械	2,200,568	70,638,232.80	2.67
6	000002	万 科 A	6,404,500	66,734,890.00	2.52
7	601328	交通银行	7,867,070	65,532,693.10	2.48
8	000513	丽珠集团	2,055,668	57,825,940.84	2.19
9	600703	三安光电	1,868,242	56,738,509.54	2.14
10	600031	三一重工	1,675,386	55,589,307.48	2.10

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	387,541,000.00	14.65
3	金融债券	196,717,000.00	7.43
	其中:政策性金融债	196,717,000.00	7.43
4	企业债券	419,705.80	0.02
5	企业短期融资券	–	–
6	可转债	1,914,691.80	0.07
7	其他	–	–
8	合计	586,592,397.60	22.17

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901047	09央行票据 47	1,500,000	149,505,000.00	5.65
2	0901037	09央行票据 37	1,400,000	139,538,000.00	5.27
3	050208	05国开 08	1,000,000	101,280,000.00	3.83
4	050207	05国开 07	950,000	95,437,000.00	3.61
5	0901045	09央行票据 45	400,000	39,868,000.00	1.51

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

8.1 本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。

8.2 本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。

8.3 其他资产构成

(下转 B22 版)