

## 景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)

## 2006年第1号更新招募说明书摘要

(基金简称:景顺资源 基金代码:162607)

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

## 重要提示

(一)景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“基金法”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“运作办法”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“销售办法”)、《证券投资基金信息披露办法》(以下简称“信息披露办法”)、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”或“本基金合同”)及其他有关规定募集,并经中国证监会2006年10月27日证监基金字【2006】1179号文核准募集。本基金的基金合同于2006年1月26日生效。

(二)基金管理人保证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,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三)投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

(四)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(五)本招募说明书所载基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。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,应仔细阅读基金合同。

(六)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,但不保证投资本金一定盈利,也不保证最低收益。

(七)本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2006年7月26日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年6月30日,本报告财务数据未经审计。

## 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:深圳市深南中路1093号中信城市广场中信大厦16层  
法定代表人:徐奕  
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1093号中信城市广场中信大厦16层  
电话:(0755)82370388  
客户服务电话:(0755)82370888  
传真:(0755)25987356  
联系人:陈强喜

(二)基金管理人基本情况  
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人,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日获得开业批准,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%。

公司设立了两个全资子公司: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控制,投资决策委员会负责指导基金财产的投资,确定基本的投资策略和投资组合的原则。

公司下设五个部门,分别是:投资部;销售营销部;法律、监察稽核部;运营部;财务、行政和人力资源部。投资部负责根据投资决策委员会确定的投资原则进行股票及债券选择和组合管理并完成宏观经济、行业公司及市场的研究。销售营销部从事基金产品设计、市场推广及销售、项目维护、客户服务等工作。法律、监察稽核部负责公司管理和基金运作合规性审查方面的监察稽核,并向公司管理层和监管机构提供独立、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维护。财务、行政和人力资源部负责公司财务管理、人事行政管理及日常行政事务管理,其中34人员具有本科以上学历。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。

公司已建立了健全的内部控制制度,内部控制制度、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,北京财政学院金融系毕业,经济学学士。曾任北京燕山石化总厂研究院车间主任、党支部书记,北京财政学院金融系讲师,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。

罗德福先生,董事,毕业于美国 Babson 学院,获学士学位及工商管理硕士学位。现任摩根大通亚洲区执行副总裁,曾任大通银行分析师,花旗银行投资管理师。

Capital House 现任董事总经理,1982至1986年出任香港证监会基金管理委员会成员,并于1986至1997年担任证监会主席,1997至2000年间,担任香港交易所会员成员,并在1997至2001年担任中国证监会国际委员会成员。

田乐先先生,董事,中共党员,研究生学历,经济师。曾任人民银行山西大同分行办公室副主任,主任,大同证券公司副总经理,长城证券有限责任公司综合部副总经理,董事兼办公室主任,现任长城证券总经理,现任长城证券副总裁。

梁华先生,董事,总经理,1976年毕业于台湾辅仁大学经济系(BA),获经济学学士学位,1999年获加纳西大学企业管理(MBA)学位。1990年到1998年担任景顺资产管理亚洲公司(LGT Asset Management Asia Ltd.)前代表及亚洲区董事,曾参与亚洲区有关基金及股票资产管理等决策事宜。1998年任景顺集团(INVESCO)并购策略集团(LGT Asset Management)前主任及景顺集团董事兼董事兼中国区总经理。

董耀辉先生,独立董事,高级会计师,注册会计师。曾任民生银行监事会监事长,中国人民银行总行计划司副司长,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。

伍国明先生,独立董事,香港大学文学士(1972年毕业),香港会计师公会会员(HKICPA),英国特许公认会计师(ACCA),国际执业会计师(CPA),加拿大公认管理会计师(CMA),现为“伍国明会计师事务所”负责人,拥有超过二十一年以上会计、稽核、审计师的专业经验及知识,1972-1977受训于国际公认会计师“毕马威会计师事务所”(KPMG)。

靳宏发先生,独立董事,1982年毕业于安徽大学外语系英语专业,获学士学位,1987年毕业于中国政法大学,获国际法专业硕士学位。现任金杜律师事务所合伙人,曾担任中律律师事务所海外专家顾问,在香港马尼拉担任律师,英国律师行 Clyde & Co.从事律师工作,1993年发起设立伍国明会计师事务所,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,2001年毕业于武汉大学商学院,获经济学硕士学位。现任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。曾任招商银行工程管理部经理、人力资源部副经理。

Mr. Dean Chisholm, 监事,毕业于 London School of Economic, 获经济学学士学位,并取得英格兰特许公认会计师机构(Institute of Chartered Accountants in England and Wales)所颁发的英国特许会计师,现任景顺集团亚太区运营部总监。曾任职于景顺资产管理英国及亚太大区运营部,曾任永道会计师事务所(PwC)英国及香港地区教师,现在出任 Hong Kong Securities Industry Group 主席及 Omgeo Hong Kong Advisory Board 的联席主席。

吴建群先生,董事,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有限公司副总经理,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。

3.其他高级管理人员  
岑伟昌先生,副总经理,美国印第安纳大学工商管理硕士,拥有19年亚太地区投资管理经验,担任过以前是亚洲国际投资管理公司(ASIM)合伙人兼投资总监,曾协助英国巴克莱银行集团在香港成立亚洲投资支部——巴克莱德融投资管理(香港)有限公司,并担任该公司的董事及高级基金经理,东南亚投资管理超过20亿美元。任内荣获由德悦及海华早报主办的1993年度“最佳基金经理奖”。曾任吉盛(香港)有限公司基金经理,专责投资日本以外之亚洲股票市场,任富达国际投资管理(香港)有限公司分析师,负责亚洲区投资组合及公司研究。曾任安达信(香港)公司管理咨询顾问部顾问,2004年11月加入本公司,任投资总监,具有基金从业资格。2005年6月任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任投资总监。

初伟斌先生,副总经理,毕业于东北财经大学会计系,获学士学位,中国注册会计师。曾任任职于财政部中国注册会计师协会、中国证监会首席会计师办公室主任、中国证监会基金监管部,历任主任科员、副处长,具有9年证券行业从业经验,2003年10月加入本公司,任法律、监察稽核部总监。2005年5月起任景顺长城基金管理有限公司副总经理,兼任法律、监察稽核部总监。

吴建群先生,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。

4.督察长  
刘焕辉先生,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济学院投资与金融系,获硕士学位。曾任武汉大学教师工作处副处长,武汉大学成人教育学院讲师,《证券时报》财经专栏记者,长城证券研发中心研究员,长城证券行政部副总经理等职。

5.本基金基金经理简历  
本公司采用轮值投资方式,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。本基金拟聘基金经理如下:

李学义先生,中国人民大学金融研究所,经济学硕士,7年基金从业经历,1998年7月加入博时基金管理有限公司,历任研究员,基金理财经理,2002年5月加入中融基金管理有限公司,任基金经理,2000年11月加入银华基金管理有限公司,任基金经理助理,基金经理。2005年9月加入本公司,任投资部副总监。

6.投资决策委员会成员  
本公司的投资决策委员会由总经理、投资总监、基金经理组成。

7.上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

本基金的基金托管人为中国农业银行,基本情况如下:

名称:中国农业银行  
住所:北京市复兴路甲23号  
办公地址:北京市复兴路甲23号  
法定代表人:杨明生  
成立时间:1979年2月23日  
注册资本:361亿元人民币

存续期间:持续经营

电话:68424199

联系人:李芳菲

## 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:深圳市福田区深南中路1093号中信城市广场中信大厦16层

批准设立文号:证监基金字【2003】76号

电话:(0755)82370388-283

传真:(0755)25987239

联系人:邵媛

2.代销机构

(1)中原银行股份有限公司

住所:北京市朝阳区复兴路甲23号

法定代表人:杨明生

电话:010-68297268

传真:010-68297268

联系人:蒋浩

网址:www.zybank.com

(2)长城证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区深南大道6008号深圳特区报业大厦

法定代表人:魏云鹏

联系人:高峰

电话:0755-82229888

网址:www.cc168.com.cn

(3)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:广东广州天河区北路大都会广场36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

电话:020-87559888

传真:020-87559865

联系人:肖梅

网址:www.gf.com.cn

(4)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:吕红

联系人:芮筱婷

电话:021-62590818-213

传真:021-62599400

客户服务热线:4008888966

网址:www.gtja.com

(5)中国银河证券股份有限公司

注册地址: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:朱利

电话:(010)66568613,66568687

联系人:赵炎

网址:www.chinastock.com.cn

(6)招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦

法定代表人:李少林

电话:4008881177,0755-26961111

联系人:王玉琴

网址:www.newone.com.cn

(7)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道1502号光大证券大厦南塔15楼

办公地址:上海市浦东新区世纪大道1502号光大证券大厦南塔15楼

(2)法定代表人:李永斌

联系人:刘晨

电话:021-68816000

传真:021-68815009

客户服务电话:021-68823988

网址:www.eastmoney.com

(8)中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京市朝阳区安立路64号4号楼

办公地址:北京市朝内大街188号

法定代表人:董乐

电话:(010)65198000

法定代表人:陈兆先

联系人:魏明

职务:中国银河证券股份有限公司(光大证券股份有限公司)副董事长

地址:中信建投证券网 www.csc108.com

3.场内销售机构  
具有中国证监会认可的基金代销资格且符合风险控制要求的深交所会员单位可以办理本基金的场内申购业务,具有中国证监会认定的基金代销资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务(具体办理场所以《基金开放申购、赎回公告》为准)。(二)注册登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层  
法定代表人:陈贵

电话:010-58568399

联系人:朱立元

(三)律师事务所及经办律师  
名称:北京信金通律师事务所  
住所:北京建国门内大街22号华夏银行11层  
负责人:于子  
电话:010-85227766  
传 真:010-66189567经办律师:贺建忠  
(四)会计师事务所及经办注册会计师  
法定名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
注册地址:上海市浦东新区东川路325号  
办公地址:上海市淮海中路333号瑞安广场12楼  
法定代表人:Kern Watson  
电话:021-63893389  
传真:021-63963300  
经办注册会计师:汪涛、单峰

## 四、基金的名称

## 五、基金的类型

上市契约开放式

## 六、基金的投资目标

本基金以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点,重点投资于具有自然资源优势及垄断优势的上市公司股票,以获取基金资产的长期稳定增值。

## 七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许其投资的金融衍生工具。

## 八、基金的投资策略

(1)投资原则依据  
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资产配置,运用景顺长城宏观经济研究数据库(SRD)等分析系统及 RFP、PVMC 等选股模型作为个股选择的依据,同时依据以 BARRA Aquis 投资组合风险管理模型和回报分析系统为核心的基金风险绩效评价体系进行投资组合的调整。(2)投资决策程序  
投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,以定期或不定期会议的形式讨论和决定基金投资的重大决策,并授权基金经理的投资方针及投资方向,审定基金资产的配置方案,投资决策委员会召开前,由基金经理依据对宏观经济走势的分析,提出基金的资产配置建议,交由投资决策委员会讨论。一旦做出决定,即为指导基金投资的正式文件,投资部据此制订具体的投资计划。

投资决策委员会下设研究部,研究部下设行业研究部,行业研究部下设研究数据库(SRD)与跟踪研究资料库,并为投资决策委员会、投资研究联席会议、投资总监和基金经理提供数据支持。基金投资决策和日常管理的日常工作。投资研究联席会议是投资决策议事机构,负责讨论研究计划、投资策略、资产配置方案、基金投资组合构建和调整方案,基金资产配置运作绩效评价与跟踪控制。投资研究委员会负责宏观经济研究、行业研究和投资组合研究、跟踪、维护股票库和买入名单等投资证券备选库,建立与维护跟踪库“股票研究数据库(SRD)”

跟踪控制,指导业务方向,并接受、审阅监察稽核报告,其中风险与回报对投资策略提出质疑,投资绩效评估与风险控制室负责投资组合风险与绩效的定期评估。法律、监察稽核部负责基金日常运作合规控制。

本基金投资决策过程为:  
(1)由基金经理依据宏观经济、股市政策、市场趋势判断,结合基金合同、投资原则的要求提出资产配置建议;

(2)投资决策委员会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)由投资部根据基金经理的投资目标,按照风险控制建设,投资组合配置方案;

(4)投资研究联席会议审核投资组合方案,如无异议,由基金经理具体执行投资计划。

2.投资管理的方法 and 标准  
(1)资产配置

本基金是一只高持股的股票型基金,对于股票的投资不少于基金资产净值的65%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优质上市公司股票的比例至少高于股票资产的30%。

(2)投资管理方法  
本基金主要采取“自下而上”的选股策略,同时结合“自上而下”的研究以确定投资范围及进行资产配置,其具体步骤主要包括:(1)确定备选投资股票  
根据既定的自然资源与垄断优势的定义和判断标准,确定符合投资标准的行业及各子行业上市公司,作为备选投资池(Stock Universe)。(1)构建备选名单  
针对具有自然资源与垄断优势的公司的基本特性,重点运用净资产收益率 ROE、市盈率 PE、价格与营运现金流 P/OCF 指标对备选投资股票中的上市公司进行筛选,构建股票监控名单。(2)制定买入名单  
在确定股票监控范围内,从业务价值、市场价值、管理能力、自由现金流量与分红政策四个方面结合必要的合理性分析对上市公司的品质和估值水平进行鉴别,确定股票买入名单。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准 = 新华富时 200 指数 × 80% + 中国债券总指数 × 20%。

选择上述业绩比较基准的主要理由为:  
1. 市场代表性  
新华富时 200 指数是由新华富时指数有限公司推出的可买卖的大盘股指数,由 A 股市场市值最大的 200 家上市公司组成,具有很好的市场代表性。2. 复合基准构成的公允性  
本基金是一只持股的股票型基金,股票投资比例范围为基金资产的 65%-95%,本基金股票和债券投资占比分别使用具有充分市场代表性和认同度的新华富时 200 指数和中国债券总指数,股票和债券投资的比较基准在基金整体业绩比较基准的占比按照两类资产配置比例加权平均的权重值确定,可以比较公允地反映基金管理人的投资管理能力。3. 易于观测性  
本基金的比较基准易于观测,任何投资者都可以使用公开的数据经过简单的算术运算获得比较基准,保证了基金业绩评价的透明性。

如果本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,本基金的管理人可以在报备中国证监会后,使用其他可以合理的作为业绩比较基准的指数代替原有指数。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,基金管理人在报中国证监会备案后可变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险投资策略

本基金是风险程度较高的投资品种,本基金将投资组合管理中面临的各类风险分类如下:  
1. 投资组合风险  
在投资组合风险管理过程中,由投资部对投资组合风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种:  
(1)系统性风险:基金在投资中因市场原因而无法规避的风险;  
(2)行业配置风险:基金中某行业投资比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险;  
(3)证券选择风险:基金中某只股票的持仓比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险;  
(4)风格风险:基金在投资风格上与基准之间产生偏差,偏向于某种风格而产生的风险。2. 个股风险  
在个股日常管理风险过程中,由投资部对个股风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种:  
(1)财务风险:基金在投资过程中,由于对上市公司基本面特别是财务状况判断出现失误,造成基金资产净值受损的风险;  
(2)流动性风险:基金资产不能迅速、低成本地转变成现金,或者不能应付可能出现地投资者大规模赎回的风险;  
(3)流动性风险:在一定时期限内,当基金中某只证券的二级市场股票价格波动幅度超出一定比例时;3. 操作执行风险  
在基金日常管理风险过程中,由运营部及法律、监察稽核部对作业风险进行实时预警与监控。此类风险主要包括基金在日常操作中因违反法规或公司相关管理制度,或者交易对手违约以及信息系统故障等带来的风险。

本基金管理人借鉴了外方股东摩根大通的投资风险管理经验,结合中国市场的实际情况,建立了景顺长城风险管理流程,通过严格的风险管理制度和流程有效降低投资的风险,保障基金资产的安全和投资者的合法利益,实现基金的投资目标。本基金的投资风险管理主要基于公司的风险管理系统和风控系统实现。

十一、基金投资组合报告(未经审计)  
景顺长城基金管理有限公司的董事会及高级管理人员不存在虚假记载、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的内容,保证投资组合报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
本投资组合报告所载数据截至 2006 年 6 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。  
(一)报告期末基金投资组合情况

项目 名称 金额(元) 占基金资产净值比例

银行存款和拆借清算备付金 58,960,497.41 6.32%

股票 843,016,801.90 90.39%

债券 0.00 0.00%

权证 0.00 0.00%

其它资产 30,675,601.64 3.29%

资产总计 932,652,900.95 100.00%

## (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 3,698,821 61,504,138.65 6.74%

C 制造业 21,516,227 399,211,328.24 43.76%

D 食品饮料 2,710,114 102,277,407.28 11.21%

E 纺织服装、皮毛 0.00 0.00%

F 木材、家具 0.00 0.00%

G 造纸、印刷 0.00 0.00%

H 石油、化学、塑胶、塑料 3,413,696 31,747,710.72 3.48%

I 电子 0.00 0.00%

J 金属、非金属 8,631,267 114,786,774.51 12.68%

K 机械、设备、仪表 5,623,981 117,478,102.72 12.88%

L 医药、生物制品 1,137,179 32,921,320.26 3.61%

O9 其他制造业 0.00 0.00%

M 电力、煤气及水的生产和供应业 0.00 0.00%

N 交通运输、仓储业 0.00 0.00%

O 交通运输、仓储业 8,189,160 74,579,692.40 8.22%

P 信息技术业 1,019,840 29,177,622.40 3.25%

Q 批发零售业 5,506,913 144,561,684.65 15.84%

R 金融、保险业 4,720,170 66,673,042.90 7.31%

S 房地产业 8,923,493 67,019,328.01 7.35%

T 社会服务业 0.00 0.00%

U 传播与文化产业 0.00 0.00%

M 综合类 0.00 0.00%

合计 53,574,624 843,016,801.90 92.41%

## (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) 市值占基金资产净值比

600094 大雁股份 1,320,997 54,622,398.95 5.99%

600030 XDX 中国 3,365,170 53,145,892.80 5.83%

600093 G 海工 2,305,498 52,795,868.40 5.79%

000669 G 张裕 1,310,474 49,268,927.14 5.40%

600269 G 赣粤 4,990,540 49,005,728.00 5.37%

600519 G 茅台 885,687 40,593,791.28 4.45%

600466 G 宝钛 843,228 40,213,543.32 4.41%

600320 G 振华 2,033,271 40,139,769.54 4.40%

002024 苏宁电器 765,096 39,172,915.20 4.29%

000825 G 太钢 5,834,665 36,583,226.65 4.01%

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合  
截至 2006 年 6 月 30 日,本基金无债券投资。(五)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  
截至 2006 年 6 月 30 日,本基金无债券投资。(六)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. 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。

3. 基金的其他资产构成