

## 长城久富核心成长股票型证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)由久富证券投资基金转型而成。依据中国证监会2007年2月1日证监基金字[2007]25号文核准的久富证券投资基金基金份额持有人大会决议,久富证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金,调整存续期限,终止上市,调整投资目标、范围和策略,修订基金合同,并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”。自2007年2月12日起,由《久富证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。

**重要提示**

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书;基金的过往业绩并不预示其未来表现,本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。

本摘要根据本基金的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《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》、《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》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。

本招募说明书所载内容截止日为2007年9月11日,有关财务数据和净值表现截止日为2007年6月30日(财务数据未经审计)。本招募说明书更新已经本基金托管人交通银行股份有限公司复核。

**一、基金管理人****(一)基金管理人概况**

- 名称:长城基金管理有限公司
- 注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
- 法定代表人:杨光裕
- 组织形式:有限责任公司
- 设立日期:2001年12月27日
- 电话:0755-2382338
- 传真:0755-2382328
- 联系人:于晓娟
- 客户服务电话:400-8968-666
- 注册资本:10000万元人民币
- 股权结构:

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	47.059%
中原信托投资有限公司	17.647%
北方国际信托投资股份有限公司	17.647%
东方证券股份有限公司	17.647%
合计	100%

13.管理基金情况:目前管理久富证券投资基金、长城久恒平衡型证券投资基金、泰达宏利泰信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金和长城品牌优选股票型证券投资基金8只基金

**(二)基金管理人主要人员情况****1.董事、监事及高管人员介绍****(1)董事**

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任,长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

邹平先生,博士研究生毕业,管理学博士,高级经济师。历任湖南省进出口总公司部门经理,中国宝安集团分公司副总经理,大鹏证券有限责任公司首席分析师,天元证券有限责任公司研究所所长,长城证券有限责任公司总裁助理。

龙熙霖先生,硕士研究生毕业,经济师。历任长城证券有限责任公司海口营业部总经理助理、总经理,公司经纪业务管理总部副总经理、资产管理总部总经理助理、证券财务部总经理,现任长城证券有限责任公司投资总监。

王国斌先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任上海万国证券公司投资银行部融资经理,申银万国证券公司国际业务部融资经理,中国经济开发信托投资公司证券发行部总经理、东方证券有限责任公司证券投资部总经理、总经理助理兼证券投资部总经理助理,东方基金管理有限责任公司总裁,东方证券股份有限公司副总经理兼受托资产管理业务部总经理,2006年9月至今任职于东方证券股份有限公司,任公司副总经理。

崔泽军先生,中共党员,硕士研究生毕业,高级会计师。历任中原信托投资有限公司财务部副经理、经理,公司副总经理,现任中原信托投资有限公司总经理。

陆妍女士,1965年生,1991年毕业于天津理工大学管理信息系统专业,获工学学士学位,1997年毕业于天津大学管理学院,获工学硕士学位,曾任天津国际信托投资公司进出口贸易咨询部部门经理、天津泰达集团证券发行部项目经理,现任北方国际信托投资股份有限公司证券管理部总经理。

任俊杰先生,大学本科毕业。历任中国人民银行深圳分行处长、深圳金融机构同业协会首任秘书长,赛格投资有限公司(香港注资)董事总经理,祥安新业有限公司(香港联交所会员)董事,中国投资环境协会副理事长,现任深圳怀新企业投资顾问有限公司副总经理。

马原女士,中共党员,研究生毕业。历任最高人民法院法官、副院长、庭长、副院长,中国法官协会会长,中国人民大学副教授。

谢志华先生,中共党员,经济学博士。历任湖南国营大通湖农场教师、湘西自治州商学院教师、北京商学院(现北京工商大学)副院长、北京工商大学校长助理。2003年至今任北京工商大学副校长。

刘彬,男,1964年生,经济学博士。曾任中华工商时报社海外部编辑、副主任、中华工商时报社财经新闻部主任;中国人民银行深圳分行金融早报社总编辑。现任职于中华工商时报社,曾任总编辑助理,现任副总编辑,兼任北京工商大学教授、中国人民大学信托与基金研究所研究员。

关林戈先生,中共党员,经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任,中共天津市委领导同志秘书,南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理,长城证券有限责任公司总裁助理,长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司总经理。

**(2)监事**

阮争先生,大学本科毕业。历任黄河证券有限责任公司发行部经理,港澳信托投资有限公司信托基金部投资经理,中国电力信托投资有限公司基金部经理,现任中原信托投资有限公司投资管理部经理,并担任长城基金管理有限公司监事长。

罗世蓉女士,大学本科毕业,会计师。历任四川轻工厅盐业学校财经教研室主任,海南信托投资公司证券部主办会计,长城证券总部财务主管、长城证券总部深圳二部财务部经理,长城证券有限责任公司成都营业部副总经理兼财务部经理,深圳一部副经理兼财务部经理、公司审计部总经理、公司审计监控部总经理,现任长城证券有限责任公司财务部副总经理。

张建辉先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任上海浦东发展银行信托证券发行部科员,东方证券股份有限公司经济业务管理部辽宁管理部总经理、总经理,现任东方证券股份有限公司资金财务管理部总经理。

田德良,男,1966年生,2005年毕业于中央广播电视大学会计学专业,经济师。曾任职于中国建设银行天津开发区分行,任经理助理、事后总稽核。现任职于北方国际信托投资股份有限公司,曾任会计部经理助理、会计部副经理、会计部经理、监察稽核部副经理、项目评估部项目经理、业务发展总部客户经理,现任自营业务总部项目经理。

桑煜,男,中共党员,经济学学士。曾任职于中国建设银行山东日照市分行、中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司,历任市场开发部业务主管、运行保障部副经理、运行保障部经理,现任市场开发部总经理。

韩刚,男,中共党员,1999年毕业于中国人民银行研究生部,经济学硕士。曾任国信证券发展研究中心研究员,2001年7月进入长城基金管理有限公司,历任研究员、长城久恒基金经理,现任基金管理部副总经理。

**(3)高级管理人员**

杨光裕先生,中共党员,硕士研究生毕业。历任江西省审计厅办公室主任,长城证券有限责任公司副总裁,现任长城基金管理有限公司董事长。

关林戈先生,中共党员,经济学硕士。历任中国汽车贸易公司办公室主任,中共天津市委领导同志秘书,南方证券天津分公司副总经理、常务副总经理、代总经理,长城证券有限责任公司总裁助理,长城基金管理有限公司副总经理、常务副总经理,现任长城基金管理有限公司董事、总经理。

余敏先生,硕士研究生毕业。曾任教于中国地质大学经济学院,历任中国人民银行湖北北部分行科监负责人,君安证券有限公司研究部宏观室负责人,长城证券有限责任公司营业部总经理,长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理,现任长城基金管理有限公司副经理兼运行保障部总经理。

汪欣先生,中共党员,博士研究生毕业。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处,海南港澳国际信托投资公司证券部,历任三亚东方实业股份有限公司副总经理,国信证券有限责任公司研究所所长,长城基金管理有限公司总经理助理,并先后兼任研究策划部总经理、市场开发部总经理,现任长城基金管理有限公司副总经理。

韩浩先生,硕士研究生毕业。历任长城证券有限责任公司资产管理部总经理,长城基金管理有限公司投资总监兼投资管理部总经理,“久富证券投资基金”基金经理、总经理助理,“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理,现任长城基金管理有限公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

彭洪波先生,经济学硕士,MBA,13年证券从业经验。曾就职于长城证券有限责任公司,历任深圳东部路营业部电脑部经理,公司电子商务筹备组项目经理,公司审计部技术专员,2002年3月加盟长城基金管理有限公司,历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理,现任长城基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总经理。

**2.本基金基金经理简历**

项志群先生,生于1969年,哈尔滨工业大学计算机工程及其应用系工学学士。曾就职于航天CAD开发有限公司程序员、经纪期货有限公司证券业务室、海南省证券公司交易管理部,2001年11月进入长城基金管理有限公司,曾任集中交易室交易主管,自2005年3月26日起至今任“久富证券投资基金”基金经理,该基金已转型为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”。

“久富证券投资基金”历任基金经理如下:许良胜先生自2001年12月18日该基金成立之日起至2005年3月25日任该基金基金经理。

3.本基金管理人投资决策委员会成员姓名和职务如下:  
关林戈先生,投资决策委员会主席,公司董事、总经理。  
韩浩先生,投资决策委员会执行委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理。

**4.上述人员之间不存在近亲属关系。****二、基金托管人****(一)基金托管人概况**

- 基本情况  
公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)  
公司法定英文名称: BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD  
法定代表人:蒋超良  
住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号  
邮政编码:200120  
注册时间:1987年3月30日  
注册资本:489.94亿元  
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号  
联系人:张咏东  
电话:021-6888917

**2.发展概况**

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行,自1987年重新组建以来,交通银行各项业务和机构建设持续健康发展,目前在我国143个大中城市设有分支行,全行员工近6万人。截至2006年末,资产总额为17194.83亿元人民币,实现净利润122.74亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名,交通银行资产总额排名世界1000家大银行中第73位。2005年6月23日,交通银行成功在香港主板市场上,成为首家在境外上市的内地商业银行。1998年被评为《欧洲货币》评为中国最佳银行,1999年被评为《环球金融》评为中国最佳银行,2005年被评为《金融亚洲》评为中国最佳银行。2006年,由世界品牌实验室(WBL)举办的2006年第三届(Brand China品牌中国)大型调查的调查结果,交通银行再次蝉联“中国品牌年度大奖(No.1)”(银行类),同时荣获2006年“中国最具影响力品牌”(TOP10)(银行类)排名第二,并获得2006年“中国十大诚信品牌”(唯一入选银行)。

**(二)基金托管人主要人员情况**

李俊先生,交通银行行长,华中理工大学经济学硕士,高级经济师。曾任交通银行武汉分行副经理、行长,交通银行总稽核、董事、常务董事,执行董事、副行长;2006年9月担任交通银行副董事长、行长。

王斌先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长,交通银行北京分行行长,2006年1月至今任交通银行副行长,党委委员兼北京分行党委书记。

阮红女士,交通银行资产托管部总经理,复旦大学企业管理专业博士研究生学历,高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验,在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任科员,交通银行办公室秘书处主任科员,交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长,交通银行办公室综合处处长,交通银行海外机构管理部副总经理、总经理,交通银行上海分行副行长、党委委员,2006年1月至今任交通银行资产托管部总经理。

**三、相关服务机构****(一)基金份额发售机构****1.直销机构:**

名称:长城基金管理有限公司  
住所:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层  
办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层  
法定代表人:杨光裕  
成立时间:2001年12月27日  
电话:0755-2382338  
传真:0755-2382328  
联系人:黄念英  
客户服务电话:400-8868-666  
网址:www.cctund.com.cn  
2.场外代销机构:

(1)交通银行股份有限公司  
住所:上海市浦东新区银城中路188号  
联系人:蒋鼎新  
客户服务电话:95559  
传真:021-58408942  
联系人:曹榕  
网址:www.bankcomm.com  
(2)中国建设银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街25号  
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
法定代表人:郭树清  
客户服务电话:95533  
网址:www.ccb.com.cn  
(3)招商银行股份有限公司  
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
法定代表人:秦晓  
电话:0755-83198888  
传真:0755-83195109  
联系人:李奇  
客户服务电话:95555  
网址:www.cmbchina.com

(4)华夏银行股份有限公司  
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号(100005)  
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号(100006)  
法定代表人:张佑辉  
设立日期:1992年10月14日  
联系人:陈宇  
电话:(010)85238423  
传真:(010)85238680  
网址:www.hxb.com.cn  
(5)兴业银行股份有限公司  
住所:福州市湖东路154号  
法定代表人:高建平  
电话:021-66277777  
传真:021-62569070  
联系人:陈晓辉  
客户服务电话:95561  
网址:www.cib.com.cn

(6)渤海证券股份有限公司  
办公地址:天津市河西区滨水道3号  
法定代表人:张志强  
联系人:徐晓勇  
联系电话:022-28451883  
客户服务热线:022-28455888  
网址:www.bwh.com.cn  
(7)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号特区报业大厦14、16、17层  
法定代表人:王宇光  
联系人:高峰  
电话:0755-83516094  
传真:0755-83516199  
客户服务热线:0755-82288968  
网址:www.cc168.com.cn  
(8)东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22-29层  
法定代表人:王益民  
联系人:吴宇  
电话:021-63325888  
传真:021-63326173  
客户服务热线:400-8888-506,021-962506  
网址:www.dfq.com.cn

(9)国都证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格广场45层  
办公地址:北京市东城区安外大街安外大厦3层  
法定代表人:王少华  
开放式基金业务传真:010-64482000  
联系人:马泽承  
联系电话:010-64482228-300  
全国免费业务咨询电话:800-810-8809  
网址:www.guodu.com  
(10)国信证券股份有限公司  
办公地址:江西省南昌市永叔路15号  
办公地址:江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼  
法定代表人:管培生  
联系电话:0791-6285337  
传真电话:0791-6289395  
联系人:徐永云  
客户服务电话:0791-6285337  
网址:www.guosen.com.cn

(11)国泰君安证券股份有限公司  
(13)广生证券有限责任公司  
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼5楼  
法定代表人:吴志明  
客户服务中心电话:020-961303  
基金业务联系人:曾洋  
联系电话:020-87322668  
传真:020-87325036  
网址:www.gzs.com.cn  
(14)海通证券股份有限公司  
通讯地址:上海市淮海中路98号  
法定代表人:王开国  
电话:021-53594566  
传真:021-5385849

联系人:金芸、李美鸣

客服电话:4008888001,021-962503

网址:www.htsec.com

(15)江南证券有限责任公司

法定代表人:姚江涛

公司名称:江南证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市抚河北路291号

联系人:方俊才

联系电话:07916772501

传真:(0791)6789414

网址:www.sctstock.com

(16)联合证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10,25层

法定代表人:马明明

联系人:盛宗荣

电话:0755-82492000

传真:0755-82492962

客户服务电话:400-8888-565,0755-25125666

网址:www.lhzc.com

(17)平安证券有限责任公司

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼

法定代表人:叶俊成

联系人:余江

电话:0755-82450826

传真:0755-82433794

全国统一客户服务热线:96511

网址:www.pa18.com

(18)世纪证券

住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人:段志刚

电话:0755-83199511

传真:0755-83199545

联系人:董磊、刘军辉

客服电话:0755-83199511

网址:www.cscs.com.cn

(19)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:021-54033888

传真:021-54038844

客服电话:021-962505

网址:www.sw2000.com.cn

(20)天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座

法定代表人:林义相

电话:(010)66045220

传真:(010)66045500

联系人:陈少震

网址:www.txsec.com、www.txjrn.com

(21)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人:兰荣

电话:021-68419974

联系人:易勇

客户服务专线:021-68419974

网址:www.xycj.com.cn

(22)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)66568887

联系人:郭京华

咨询电话:8008201868

网址:www.chinastock.com.cn

(23)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66号4号楼

办公地址:北京市朝阳区内大街188号

法定代表人:张佑辉

电话:010-85130577

联系人:权唐

网址:www.csc10.com

开放式基金咨询电话:4008888108

(24)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A座38-45层

法定代表人:宫少林

电话:0755-82943666

传真:0755-82960111

联系人:黄健

客户服务热线:4008888111,0755-26961111

网址:www.newone.com.cn

3.场内代销机构:

指具有基金代销业务资格的,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

基金管理人可以根据情况变化增加或者减少代销机构,并另行公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点,并另行公告。

**(二)注册登记机构**

名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层  
法定代表人:陈耀先  
办公地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场23层  
电话:(010)58598365  
传真:(010)58598076

**(三)律师事务所与经办律师**

律师事务所名称:北京市金杜律师事务所  
注册地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层  
负责人:王玲  
经办律师:靳庆军、宋萍萍  
电话:0755-22163333  
传真:0755-22163380

联系人:宋萍萍

(四)会计师事务所和经办注册会计师  
会计师事务所名称:深圳大华天诚会计师事务所  
注册地址:深圳市福田区滨河大道5022号联合广场B座11楼  
负责人:李秉心  
注册会计师:李秉心、徐海宁  
联系人:何慧仪  
电话:0755-82900952  
传真:0755-82900965

**四、基金名称**

本基金名称:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

**五、基金的类型**

本基金类型:契约型开放式

**六、基金的投资目标**

投资于具有核心竞争力的企业,分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续增长所带来的良好收益,力争为基金持有人实现稳定的超额回报。

**七、基金的投资范围**

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行并上市交易的股票、国债、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置为:股票资产占基金总资产60%-95%,债券基金总资产0%-35%,权证投资占基金总资产0%-3%。本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金股票资产中,不低于80%的资金将投资于具有良好成长优势的上市公司发行的股票。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

**八、基金的投资策略**

1.资产配置策略  
本基金为主动型股票基金,对于股票、债券、现金及其他金融产品等大类资产的配置策略,首次明确,以股票为主。基于对各类资产风险收益水平的分析,结合主要投资对象—具备核心竞争力上市公司持续成长能力及估值水平,参考基金流动性要求,在重点投资于具备持续成长能力与获取超额利润能力的优势企业的前提下实现大类资产配置,追求基金资产在股票、债券及短期金融工具的投资中实现风险水平和收益的最佳匹配。

2.股票投资策略  
本基金的股票投资策略将立足于公司的估值体系,在平衡市场总体估值水平的基础上,将重点投资于具备核心竞争力的持续成长性企业,强调对公司核心竞争力的判断,及核心竞争力所拥有的超额收益能力的评估。同时适度兼顾因行业发展、重组并购等因素带来的估值调整所带来的阶段性机会;对于新经济、新业态模式等创新型公司依据供求关系、市场地位、发展前景给予一定估值溢价;对于主题类资产则重点把握市场心理与企业重估的实质性基础。股票组合构建所追求的目标是双高:高、高复利比率。

3.基金操作策略  
本基金的操作策略核心有二:一是保持组合获得超额收益的能力,主要在于股票类资产的操作倾向向上;中、短期类目标的处理,其中中长期类资产依据估值水平的变化调整权重,而中、短期类资产的选择是为了发掘新的长期投资项目。二是风险组合的风险控制,保持组合均衡,主要通过行业配置、主题配置、持股集中度的调整以及均值回归度的评估等操作来保持组合的均衡,降低组合的风险。

4.债券及短期金融工具投资策略  
本基金认为股票市场投资风险较大时,将择机把部分股票资产转换为债券资产以获取较稳定的收益。由于目前中国债券市场仍处于制度完善与规则建立的发展阶段,本基金采取组合久期控制下的主动性投资策略,综合考虑利率曲线选择有利投资品种,构建债券投资组合,并综合运用久期控制、期限结构配置、跨市场套利、相对价值判断和信用风险评估等管理手段实现债券组合的动态优化调整。

5.衍生金融工具套利和风险管理策略

本基金在进行权证等金融工具投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。对于其他金融衍生产品则以控制风险为目标,作为主动型基金将始终持有较高比例的股票投资仓位,金融衍生产品将会是本基金锁定风险的工具,但不作为投资目标。

**九、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中信全债指数收益率。

**十、基金的风险收益特征**

本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

**十一、投资组合报告**

本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。  
本基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于2007年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合组合报告所载数据截至2007年6月30日,本报告中文财务资料未经审计。  
1、报告期末基金资产组合情况:

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	8,376,308,385.03	84.76%
2	债券	4,160,129.94	0.04%
3	银行存款和清算备付金合计	1,489,534,143.47	15.07%
4	权证	2,200,688.16	0.02%
5	资产支持证券	0.00	0.00%
6	其它资产	10,307,147.54	0.10%
合计		9,881,500,674.14	100.00%

**2、报告期末按行业分类的股票投资组合:**

分 类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	430,476,273.25	4.41%
C 制造业	4,490,564,400.51	