

# 景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)

## 2009 第 1 号更新招募说明书摘要

(基金简称: 景顺长城鼎益股票(LOF) 基金代码: 162605)

### 重要提示

(一) 景顺长城鼎益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管理办法》(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》、《景顺长城鼎益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 2005 年 1 月 12 日证监基金字【2005】7 号文核准募集。基金合同于 2005 年 3 月 16 日正式生效。

(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《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,但不保证投资本基金一定盈利,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 2009 年 3 月 16 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2008 年 12 月 31 日。本报告财务数据已经审计。

**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**

## 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) 22381399  
联系人：刘焕喜

### (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、国际投资部下发的交易指令，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 99 人，其中 54 人具有硕士以上学历。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。

田军先生，董事，中共党员，研究生毕业，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、董事会秘书兼董事会办公室主任、总裁办公会成员，现任长城证券有限责任公司副总经理。

梁华栋先生，董事、总经理，1975 年毕业于台湾辅仁大学经济系(BA)，获经济学学士学位，1999 年获田纳西大学企业管理硕士(MBA)学位。1990 年到 1998 年担任景泰资产管理亚洲公司(LGT Asset Management Asia Ltd.)首席代表及亚洲区董事，曾参与亚洲区有关基金及股票投资市场管理等决策事宜。1998 年景顺集团(INVESCO)并购原景泰集团(LGT Asset Management)，即担任景顺集团亚洲区董事兼台湾区总经理。3 月 25 日，公司发布公告，经董事会审议通过，同意梁华栋先生由于个人原因辞去公司总经理职务，并决定由公司副总经理吴建军先生代为履行公司总经理职务。

童贻银先生，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 Clyde & 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。曾任招商银行股份有限

公司人力资源部经理及工程管理部经理。

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。

### 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。3月25日，公司发布公告，经董事会审议通过，决定由公司副总经理吴建军先生代为履行公司总经理职务。

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。

### 5、本基金基金经理简历

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。本基金聘任的基金经理如下：

王新艳女士，中国人民银行总行研究生部硕士研究生，10年基金从业经验。1998进入长盛基金管理有限公司，历任长盛基金管理公司分析师、基金经理助理，2002年10月至2004年5月担任长盛成长价值开放式基金基金经理。2004年6月加入本公司，现任投资总监。

2009年3月17日，经公司公告，经公司董事会审议通过，同意王新艳女士不再担任景

顺鼎益基金基金经理职务，聘任涂强先生为景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理。

涂强先生，南京大学经济学硕士。曾任职于长城证券有限责任公司，历任投资部投资经理、资产管理部投资经理、资产管理部副总经理。具有 9 年证券行业从业经验，2005 年 3 月加入本公司，现任景顺长城景系列开放式证券投资基金基金经理。

有关变更事项请参见本公司 2009 年 3 月 17 日的《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告》

#### 6、本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王新艳女士曾于 2002 年 10 月至 2004 年 5 月担任长盛成长价值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王新艳女士目前兼任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金基金经理。

#### 8、本基金历任基金经理姓名及管理时间

从本基金基金合同生效起至今，王新艳女士一直担任本基金基金经理。

#### 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、副总经理、投资执行长、投资总监、投资副总监组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

梁华栋先生，总经理；

蔡宝美女士，投资执行长；

吴建军先生，副总经理；

王新艳女士，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。

截至 2008 年末，中国银行资产总额 69,556.94 亿元，负债总额 64,617.93 亿元，归属于母公司所有者权益合计 4,682.72 亿元，分别比上年末增长 16.01%、16.63%和 10.24%。实现净利润 650.73 亿元，比上年增长 4.93%；实现归属于母公司所有者的净利润 635.39 亿元，同比增长 13.00%；每股收益为 0.25 元，比上年增加 0.03 元。不良贷款率由 3.12%下降至 2.65%。集团年末总市值达到 6,699.97 亿元，列全球上市银行第六位。

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 月起任本行执行董事。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 90 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 2008 年 12 月末，中国银行已托管景宏、同盛、华夏行业精选、同智优势成长、易方达平稳增长、易方达策略成长、易方达策略成长二号、易方达积极成长、易方达货币、易方达月月收益、易方达深证 100 交易型开放式指数、嘉实服务增值、嘉实成长收益、嘉实理财通系列（含嘉实稳健、嘉实增长、嘉实债券）、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数、嘉实超短债、嘉实主题精选、银华优势企业、银华优质增长股票型、海富通收益增长、海富通货币、海富通股票、海富通精选 2 号、万家 180 指数、金鹰成份股优选、华夏回报、华夏回报二号、华夏大盘精选、景顺长城景系列（含景顺长城动力平衡、景顺长城货币、景顺长城优选股票）、景顺长城鼎益股票型、泰信天天收益、泰信优质生活、招商先锋、大成蓝筹稳健、大成财富管理 2020、大成优选、泰达荷银行业精选、国泰沪深 300 指数、国泰金鹏蓝筹价值、友邦华泰盛世中国、友邦华泰积极成长、南方高增长、工银瑞信核心价值股票型、华宝兴业动力组合、华宝兴业先进成长股票型、国海富兰克林潜力组合、银河竞争优势成长、国投瑞银稳定增利债券型、嘉实研究精选股票、长盛创新先锋灵活配置、国泰金鹿保本二期、易方达中小盘股票型、友邦华泰价值、工银瑞信大盘蓝筹、银华领先策略股票型、泰达荷银集利债券型基金、华宝兴业大盘精选股票型基金、华夏策略精选灵活配置混合型基金、富兰克林国海强化收益债券型等 64 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式、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：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、场外代销机构：

- (1) 中国银行股份有限公司  
注册地址：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](http://www.boc.cn)
- (2) 中国农业银行  
注册地址：北京市复兴路甲 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  
客户服务电话：95599  
网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)
- (3) 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  
法定代表人：郭树清  
客户服务电话：95533  
网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)
- (4) 中国工商银行股份有限公司  
住 所：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
法定代表人：姜建清  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
企业类型：股份有限公司  
客户服务电话：95588（全国）  
网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)
- (5) 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：上海市中山东一路 12 号  
法定代表人：金运  
客户服务热线：95528  
公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)
- (6) 广东发展银行股份有限公司  
注册地址：广州市农林下路 83 号  
注册资本：35 亿元  
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](http://www.gdb.com.cn)

- (7) 深圳发展银行股份有限公司  
注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦  
法定代表人：蓝德彰 (John D. Langlois)  
电话：0755-82080714  
联系人：周勤  
网址：www.sdb.com.cn
- (8) 招商银行股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号  
注册资本：102.72 亿元人民币  
法定代表人：秦晓  
电话：95555  
联系人：刘薇  
网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)、
- (9) 中国民生银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号  
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  
客户服务热线：95568  
公司网站：www.cmbc.com.cn
- (10) 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  
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
- (11) 中信银行股份有限公司  
住所：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
- (12) 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: 0755-82288968

网址: [www.cc168.com.cn](http://www.cc168.com.cn)

(13) 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: 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

网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(14) 中国银河证券有限责任公司

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、66568587

联系人: 赵荣春、郭京华

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(15) 中信建投证券有限责任公司 (原华夏证券股份有限公司)

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: 400888108 (免长途费);

传真: 010-65182261

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(16) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

法定代表人: 王开国

电话: 021-53594566-4125

联系人: 金芸

网址: [www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(17) 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: 宫少林

电话: 400888111、0755-26951111

联系人: 王玉亭

网址: [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(18) 国信证券有限责任公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人: 何如

电话: 0755-82130833-2181

联系人: 林建闽

咨询电话: 0755-82130833 800-810-8868

网址: [www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(19) 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](http://www.gf.com.cn)

(20) 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: 杨秀丽

电话: 0755-82422251、82440136

传真: 0755-82433794

联系人: 任磊、苗永华

咨询电话: 0755-82440136、全国统一客服电话: 95511

(21) 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

电话: 010-65051166

传真: 010-65051156

联系人: 罗强

咨询电话: 0755-83195000、021-58796226、010-65051166,

网址: [www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

(22) 兴业证券股份有限公司

地址: 福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人: 兰荣

电话: 021-68419125

联系人: 缪白

客户服务热线: (021) 68419974

网址: [www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(23) 联合证券有限责任公司

地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层

法定代表人：马国强

电话：(0755)82493561

联系人：盛宗凌

咨询电话：4008888555、0755-25125666

网址：www.lhzq.com

(24) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市朝阳区幸福村中路锦绣园 D 座

法定代表人：林义相

电话：010-84533151-822

联系人：陈少震

网址：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(25) 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

法定代表人：王少华

电话：010-64482828-390

传真：010-64482090

客服电话：800-810-8809

联系人：马泽承

网址：www.guodu.com

(26) 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：谢平

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：021-962505

联系人：黄维琳 曹晔

网址：www.sw2000.com.cn

(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](http://www.bigsun.com.cn)

[www.96598.com.cn](http://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：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

客服电话：0551-96888

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

(31) 西部证券股份有限公司

注册地址：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](http://www.westsecu.com.cn)

### 3、场内代销机构

具有中国证监会认定的基金代销业务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业务资格的深交所会员单位可以办理本基金的场内赎回业务。

#### (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：陈耀先

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

联系人：朱立元

（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：北京建国门内大街 22 号华夏银行 11 层  
负责人：田予  
电话：（010）85237766  
传真：（010）65185057  
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

法定名称：安永华明会计师事务所  
注册及办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城  
法定代表人：葛明  
电话：86-10-65246688  
传真：86-10-85188298  
联系人：罗国基  
经办注册会计师：葛明、金馨

## 四、基金的名称

景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

## 五、基金的类型

上市契约型开放式

## 六、基金份额的申购和赎回

（一）场外基金份额的申购与赎回

1、申购费率和赎回费率

（1）申购费率：

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减，可适用以下前端收费费率标准：

申购金额（M）	申购费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 500 万	1.2%

500 万 ≤ M < 1000 万	1.0%
M ≥ 1000 万	按笔收取, 1000 元/笔

(2) 本基金的赎回费率不高于 0.5%，随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年以上 (含) - 2 年	0.25%
2 年以上 (含)	0

注：就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

(3) 本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可按中国证监会规定的程序调整申购费率、赎回费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人调整申购费率、赎回费率应最迟在实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体和网站公告。

(4) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在取得有关监管机构核准之后，对促销期间的基金申购费等实行优惠。

## 2、申购和赎回的数额约定

(1) 申购份额及余额的处理方式：本基金的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算并四舍五入保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

### (2) 基金申购份额的计算

本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 / 申购当日基金份额净值

例：某投资人投资 10 万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000 元
基金份额净值 (NAV)	1.016 元
净申购金额	100,000 / (1 + 1.5%) = 98,522.17 元
申购费用	100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 元
申购份额	98,522.17 / 1.016 = 96,970.64 份

### (3) 基金赎回金额的计算

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例：某投资人赎回 10,000 份本基金，持有时间为半年。假设赎回当日的基金份额净值为 1.056 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回份额	10,000 份
基金份额净值 (NAV)	1.056 元
赎回总金额	$10,000 \times 1.056 = 10,560$
赎回费用	$10,560 \times 0.5\% = 52.80$ 元
净赎回金额	$10,560 - 52.80 = 10,507.20$ 元

(4) 赎回金额的处理方式:

本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。

(5) 基金份额净值的计算

本基金每个工作日公告基金份额净值,当日基金份额净值在当天收市后计算,并在下一工作日公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告,并报中国证监会备案。

当日基金份额净值=当日基金资产净值/当日基金份额数

(二) 场内基金份额的申购与赎回

本基金已于 2005 年 8 月 25 日开始办理在深圳证券交易所的场内申购、赎回业务。

1、申购、赎回费率

本基金的场内申购费率不高于 1.5%,随申购金额的增加而减少,如下表所示:

申购金额 M (单位: 元)	申购费率
$M < 50$ 万	1.5%
$50 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	1.2%
$500 \text{ 万} \leq M < 1000 \text{ 万}$	1.0%
$M \geq 1000 \text{ 万}$	按笔收取, 1000 元/笔

本基金的场内赎回费率为 0.5%。在发生巨额赎回的情况下,当日未获受理的场内赎回将自动撤消。

2、申购份额与赎回金额的计算

(1) 申购份额及余额的处理方式: 场内申购份额保留到整数位,零碎份额对应的资金返还至投资者资金账户。

(2) 申购份额的计算

本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 / 申购当日基金份额净值

例：某投资者通过场内投资 1 万元申购本基金，假定对应的申购费率为 1.5%，申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

$$\text{净申购金额} = 10000 / (1 + 1.5\%) = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 10000 - 9852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.025 = 9611.92 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9611 份，不足 1 份部分的申购资金零头返还给投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 9611 \times 1.025 = 9851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

(3) 赎回金额的处理方式：赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

(4) 赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回手续费} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回手续费}$$

例：某投资者通过场内赎回上市开放式基金 1 万份基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10000 \times 1.0250 = 10250 \text{ 元}$$

$$\text{赎回手续费} = 10250 \times 0.005 = 51.25 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 10250 - 51.25 = 10198.75 \text{ 元}$$

即：投资者赎回 1 万份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则可得到 10198.75 元净赎回金额。

## 七、基金的投资目标

### (一)、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以及垄断优势的优质上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。

通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。

## 八、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基金投资的其他金融工具。

## 九、基金的投资策略

### 1、投资管理的决策依据和决策程序

#### (1) 投资决策依据

本基金依据以宏观经济分析模型 MEM 为基础的资产配置模型决定基金的资产配置,并运用景顺长城股票研究数据库(SRD)及 GVI 等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时,本基金运用多因素模型等分析工具,结合基金管理人的主观判断,根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。

#### (2) 投资决策程序

(i) 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问题,包括确立各基金的投资方针及投资方向,审定基金财产的配置方案。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。一旦作出决议,即成为指导基金投资的正式文件,投资部据此拟订具体的投资计划。

(ii) 投资部是负责管理基金日常投资活动的具体部门,投资总监除履行投资决策委员会执行委员的职责外,还负责管理和协调投资部的日常运作。基金经理根据投资决策委员会及投资研究联席会议决议具体承担基金的日常管理工作。

(iii) 风险管理委员会作为风险管理的决策机构,由总经理、督察长、以及其他相关部门经理或主管组成,指导业务方向,并接受、审阅监察稽核报告,基于风险与回报对业务策略提出质疑。

#### (iv) 本基金决策投资过程为:

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投资部从景顺长城股票研究数据库(SRD)中精选个股,依据本基金的投资策略,由投资研究联席会议集体决定个股配置方案;

④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、投资管理的方法和标准

#### (1) 资产配置

本基金是一只较高持股的股票型基金,对于股票的投资不少于基金财产的 60%,持有现金和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%。

#### (2) 投资管理方法

本基金管理人充分发挥“自下而上”的主动选股能力，通过定量的业绩归因分析深入发掘主动性回报的相关信息，适当加大选股因素的贡献度，借助投资组合优化技术实现投资风险与收益的最佳配比。

同时，借鉴国外风险管理的成功经验，采用国际通行的风险管理方法实现风险的识别、测度和控制，通过调整风险结构，突出股票选择能力，从而保证股票投资组合相对于基准指数的年跟踪误差在预定目标之内，将投资管理的主动性风险控制合理的水平。

本基金在投资中利用多因素模型优化投资组合，将与行业、投资风格和市场敏感暴露度密切相关的非主观的风险因素控制在最低程度，借助主动选股获利，通过精选个股和优化组合两个环节增强超额收益。

### (3) 选股标准

本基金遵循基本面主动选股的原则，主要通过自下而上的基本面研究制定投资决策。通过选择基本面良好的优势企业的股票或估值偏低的股票，结合自上而下的宏观经济及政策分析、产业景气及产业政策分析，制定投资备选名单。对个股的选择以成长、价值及稳定收入为基础，依据 GVI 模型，选取价位合适的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，以及能提供稳定收入的收益型股票。

## 十、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=新华富时 A200 指数×80%+同业存款利率×20%。

使用上述业绩比较基准的主要理由如下：

(1) 公允性。本基金定位于高持股的股票型基金，同时始终持有不少于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。以上述基准对本基金的投资业绩进行评估，能够比较客观的反映资产的市场平均收益水平，也可以比较公允的反映基金管理人的投资管理能力。

(2) 关于以新华富时 A200 指数作为本基金业绩比较基准中的股票部分的理由：

(i) 客观性：新华富时 A200 指数编制方法明确，能为市场普遍接受。

(ii) 透明性：新华富时 A200 指数公开发布，投资者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。

(iii) 市场代表性：新华富时 A200 指数具有良好的市场代表性。

(iv) 新华富时 A200 指数自 2001 年 6 月 18 日正式发布至今，市场表现优于深沪 A 股加权综合指数，对基金管理人提出了更高要求。

(3) 关于业绩比较基准中股票指数与银行同业存款利率的权重的确定依据：

本基金股票资产的配置比例为 60-95%，基金股票投资的平均仓位接近 80%。

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，

基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十一、基金的风险收益特征

本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。

依据本基金投资组合管理方法的特征，本基金将投资组合管理中面临的各类别风险定义如下：

### 1、投资组合风险：

在基金日常管理风险过程中，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，偏重于某种风格而产生的风险；

### 2、个股风险：

在基金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额赎回的风险；
- (3) 价格风险：在一定时间期限内，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；

### 3、作业执行风险：

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出现违反法规或公司相关管理制度，或者交易执行中的操作失误以及信息系统故障产生的风险。

本基金管理人借鉴了外方股东景顺集团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系统。通过严格的风险管理制度和流程有效降低投资的风险，保障基金财产的安全和投资者的合法利益，实现基金的投资目标。本基金的股票风险管理主要基于公司的风险管理系统和回报分析系统实现。

## 十二、投资组合报告

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的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2008 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据已经审计。

1、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	4,941,371,549.43	69.93
	其中：股票	4,941,371,549.43	69.93
2	固定收益投资	1,726,201,921.24	24.43
	其中：债券	1,726,201,921.24	24.43
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	769,660.46	0.01
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	345,742,612.11	4.89
6	其他资产	51,937,806.61	0.74
7	合计	7,066,023,549.85	100.00

2、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	-	-
B	采掘业	694,718,262.38	9.85
C	制造业	1,122,695,654.46	15.92
C0	食品、饮料	712,822,001.42	10.11
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	567,060.00	0.01
C6	金属、非金属	154,849,895.54	2.20
C7	机械、设备、仪表	40,631,392.80	0.58
C8	医药、生物制品	213,825,304.70	3.03
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	191,098,610.85	2.71

E	建筑业	271,060,342.32	3.84
F	交通运输、仓储业	550,804,646.71	7.81
G	信息技术业	175,780,480.09	2.49
H	批发和零售贸易	149,486,449.84	2.12
I	金融、保险业	1,482,748,399.69	21.03
J	房地产业	276,123,721.42	3.92
K	社会服务业	6,207,750.00	0.09
L	传播与文化产业	20,647,231.67	0.29
M	综合类	-	-
	合计	4,941,371,549.43	70.09

3、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	600036	招商银行	37,818,039	459,867,354.24	6.52
2	600519	贵州茅台	3,953,037	429,695,121.90	6.09
3	601318	中国平安	14,943,981	397,360,454.79	5.64
4	600583	海油工程	23,229,966	353,792,382.18	5.02
5	601006	大秦铁路	31,570,358	253,194,271.16	3.59
6	601628	中国人寿	12,799,823	238,716,698.95	3.39
7	600009	上海机场	20,355,619	229,407,826.13	3.25
8	601390	中国中铁	37,417,156	202,800,985.52	2.88
9	600900	长江电力	25,999,811	191,098,610.85	2.71
10	600030	中信证券	10,000,000	179,700,000.00	2.55

4、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	1,463,916,000.00	20.76
3	金融债券	253,875,000.00	3.60
	其中:政策性金融债	253,875,000.00	3.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	8,410,921.24	0.12
7	其他	-	-
8	合计	1,726,201,921.24	24.48

5、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	0801035	08 央行票据 35	4,000,000	426,760,000.00	6.05
2	0801017	08 央行票据 17	3,000,000	319,170,000.00	4.53
3	040211	04 国开 11	2,500,000	253,875,000.00	3.60
4	0801019	08 央行票据 19	2,500,000	241,275,000.00	3.42
5	0801095	08 央行票据 95	2,400,000	234,936,000.00	3.33

6、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。

7、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

序号	权证代码	权证名称	数量 (份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	580019	石化 CWB1	433,290	634,336.56	0.01
2	580017	赣粤 CWB1	36,096	135,323.90	0.00

8、投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (人民币元)
1	存出保证金	918,885.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,630,646.55
5	应收申购款	388,275.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	51,937,806.61

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------	---------------

1	125709	唐钢转债	3,956,518.24	0.06
---	--------	------	--------------	------

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	191,098,610.85	2.71	筹划重大资产重组事宜

8.6 上述表格合计数中，由于四舍五入的原因可能出现小数尾差。

## 十三、基金的业绩

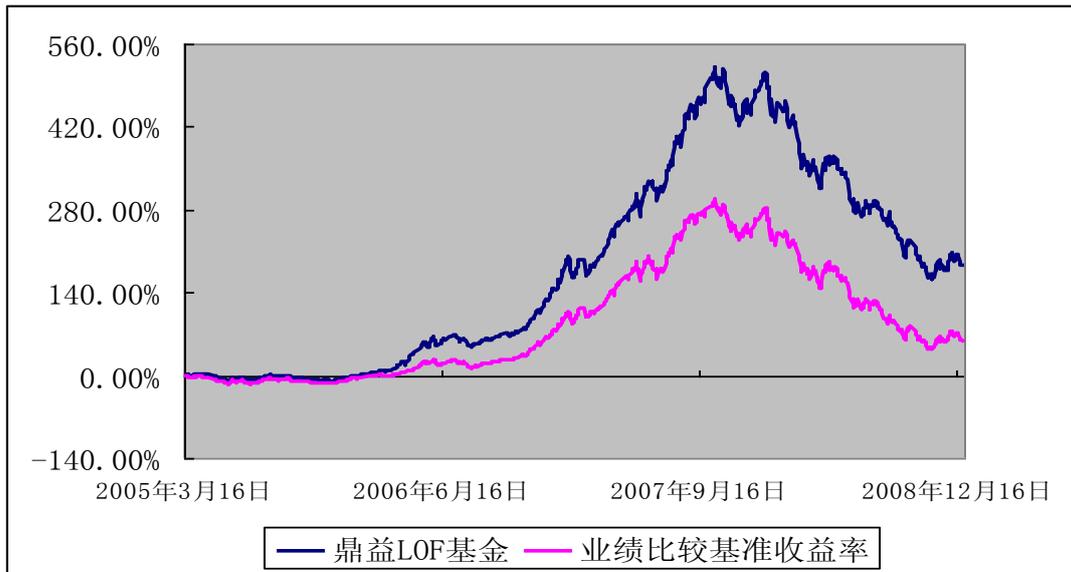
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2008 年 12 月 31 日。

### 1 净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

阶段	净值增长率(1)	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)
2005年3月16日 -2005年12月31日	-4.30%	0.83%	-9.11%	1.02%	4.81%	-0.19%
2006年	156.64%	1.29%	91.70%	1.10%	64.94%	0.19%
2007年	135.81%	1.90%	107.89%	1.83%	27.92%	0.07%
2008年	-50.74%	2.03%	-56.98%	2.40%	6.24%	-0.37%
2005年3月16日 -2008年12月31日	185.29%	1.64%	55.83%	1.73%	129.46%	-0.09%

### 2、本基金合同生效以来基金份额净值变动情况，及与同期业绩比较基准的变动比较 景顺鼎益基金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较图

(2005年3月16日至2008年12月31日)



备注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的 60%至 95%；债券投资和现金的比例为基金资产净值的 5%至 40%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2005 年 3 月 16 日合同生效日起至 2005 年 6 月 15 日为建仓期。建仓期满截至报告期末，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

## 十四、基金的费用概览

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关的费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### 2、与基金运作有关的费用的费率、计提方法、计提标准、收取方式和使用方式

##### (1) 基金管理人的管理费

本基金管理费年费率为 1.5%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从本基金财产中一次性支付给基金管理人。

## (2) 基金托管人的托管费

本基金托管费年费率为 0.25%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H：为每日应支付的基金托管费；

E：为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3) 上述（一）基金费用第（3）—（8）项费用，除上款规定的费用外，由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，从当期基金财产中支付。

(4) 基金首次发行中所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金财产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关规定列支；若本基金发行失败，发行费用由基金管理人承担。基金合同生效后的各项费用按有关规定列支。

## 3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

### （二）与基金销售有关的费用

#### 1、基金认购费用

##### 1) 场内认购费率

会员单位可按照基金招募说明书中约定的场外认购的认购费率设定投资人场内认购的发售费率。

认购费用用于本基金直接发售和代理发售时发生的开支，包括市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

##### 2) 场外认购费率

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但认购资金一旦交付，撤销申请不予接受。本基金份额的面值为人民币一元，按面值发售，投资人认购采用全额缴款的认购方式。本基金对认购设置级差费率，认购费率随认购金额的增加而递减，最高认购费率不超过 1.0%。

认购金额 (M)	认购费率
M < 50 万	1.0%
50 万 ≤ M < 500 万	0.8%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.6%
M ≥ 1000 万	按笔收取, 1000 元/笔

## 2、 申购费

本基金的申购费率不高于 1.5%，随申购金额的增加而递减：

申购金额 (M)	申购费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 500 万	1.2%
500 万 ≤ M < 1000 万	1.0%
M ≥ 1000 万	按笔收取, 1000 元/笔

例：某投资人投资 10 万元申购本基金，假设申购当日的基金份额净值为 1.016 元，则其可得到的申购份额为：

申购金额	100,000 元
基金份额净值 (NAV)	1.016 元
净申购金额	$100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17$ 元
申购费用	$100,000 - 98,522.17 = 1,477.83$ 元
申购份额	$98,522.17 / 1.016 = 96,970.64$ 份

## 3、 赎回费

(1) 场外赎回费率：

持有期	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年以上 (含) - 2 年	0.25%
2 年以上 (含)	0

注：①就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

(2) 本基金的场内赎回费率为 0.5%。

(3) 本基金收取的赎回费中 25% 的部分归入基金财产。

## 4、 定期定额投资计划适用的申购费及赎回费

(1) 申购费

通过“定期定额投资计划”前端收费方式申购本基金适用申购费率等同于正常申购费率，通过“定期定额投资计划”后端收费方式申购本基金适用申购费后端收费费率标准如下：

持有期	申购费率
12 期以内	1.0%
12 期 (含) 以上 24 期以内	0.8%
24 期 (含) 以上 36 期以内	0.5%

36 期(含)以上	0
-----------	---

注：①通过“定期定额投资计划”申购本基金适用申购费收费方式具体参照各代销机构相关业务规定；不通过“定期定额投资计划”申购本基金只适用申购费前端收费方式。

②后端收费方式定期定额申购费率按定期定额投资计划实际已成功申购的累计期数分档计算，期数的积累以投资者在销售机构的交易帐户为准，若在不同销售机构则分别统计。

③若后端收费方式“定期定额投资计划”终止后再重新参与的，则新定期定额申购累计期数重新计算；投资者在同一交易帐户内变更每期扣款金额、扣款日期、扣款帐户不影响期数的累积。

④前端收费方式定期定额投资计划不计申购累计期数。

(2) 赎回费

赎回费率不高于 0.5%，随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
1 年以内	0.5%
1 年以上(含)－2 年	0.25%
2 年以上(含)	0

注：①就赎回费而言，1 年指 365 天，2 年指 730 天。

②通过“定期定额投资计划”前端收费方式申购而来的基金份额在赎回时按单笔申购确认日分别计算持有期及赎回费用。通过“定期定额投资计划”后端收费方式申购而来的基金份额在计算赎回费时所依据的持有期是以该帐户第一笔后端定期定额申购确认日为起始日；投资者终止“定期定额投资计划”之后，尚未赎回的在本次“定期定额投资计划”期间内通过后端定期定额收费方式申购所得的基金份额，仍以此为起始日计算持有期。若投资者重新加入“定期定额投资计划”，则再次通过后端定期定额收费方式申购所得的基金份额持有期以新提交的首笔定期定额申购确认日为起始日。

(3) 例：某投资者于 2007 年 4 月 8 日在代销机构办理加入“定期定额投资计划”手续，约定自当月起，每月申购本基金 600 元，扣款日为每月 18 日。2008 年 9 月 1 日，赎回本基金 1,000 基金份额。期间定期定额业务扣款未中断。则该交易申购份额及申购费用计算如下：

(a) 2007 年 4 月 18 日提交第一笔定期定额申购申请，假设当日基金份额净值为 1.012 元，则其可得到的申购份额为：

**前端收费方式下：**

$$\text{净申购金额} = 600 / (1 + 1.5\%) = 591.13 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 600 - 591.13 = 8.87 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 591.13 / 1.012 = 584.12 \text{ 份}$$

**后端收费方式下：**

申购份额 =  $600/1.012 = 592.89$  份

假设 2007 年 5 月 18 日提交第二笔定期定额申购申请时当日基金份额净值为 1.021, 则前端收费方式下申购所得份额为 578.97 份 ( $591.13/1.021$ ), 后端收费方式下申购所得份额为 587.66 份 ( $600/1.021$ )。之后每个月的定期定额申购所得基金份额计算方法同上。

(b) 2008 年 9 月 1 日, 赎回本基金 1,000 份, 假设当日基金份额净值为 1.168 元。赎回时已成功定期定额申购 17 期 (2007 年 4 月至 2008 年 8 月, 未中断)。

**前端收费方式下:**

依先进先出法, 赎回该 1000 份, 其份额的持有期为超过一年不满两年, 适用赎回费率为 0.25%

赎回总金额 =  $584.12 \times 1.168 + 415.88 \times 1.168 = 1168$  元

赎回费用 =  $584.12 \times 1.168 \times 0.25\% + 415.88 \times 1.168 \times 0.25\% = 2.92$  元

赎回净金额 =  $1168 - 2.92 = 1165.08$  元

**后端收费方式下:**

其定期定额业务 1-11 期所属份额适用后端申购费率 1.0%, 12-17 期所属份额适用后端申购费率 0.8%; 赎回费持有期从 2007 年 4 月 18 日第一笔定期定额申购申请确认成功日 (假设为 2007 年 4 月 19 日) 起计算, 超过一年不满两年, 适用赎回费率 0.25%。

**(i) 后端申购费:**

依先进先出法, 赎回的 1000 份基金份额中 592.89 份来自 2007 年 4 月的申购, 份额所属期为 1 期, 申购金额为 600 元; 其余 407.11 份来自 2007 年 5 月的申购, 份额所属期为 2 期, 申购金额 415.66 元 ( $407.11 \times 1.021$ )。

1 期净申购金额 =  $600 / (1 + 1.0\%) = 594.06$  元

1 期后端申购费用 =  $600 - 594.06 = 5.94$  元

2 期净申购金额 =  $415.66 / (1 + 1.0\%) = 411.54$  元

2 期后端申购费用 =  $415.66 - 411.54 = 4.12$  元

**(ii) 赎回金额:**

1 期赎回费用 =  $1.168 \times 592.89 \times 0.25\% = 1.73$  元

1 期赎回金额 =  $1.168 \times 592.89 - 1.73 = 690.77$  元

2 期赎回费用 =  $1.168 \times 407.11 \times 0.25\% = 1.19$  元

2 期赎回金额 =  $1.168 \times 407.11 - 1.19 = 474.31$  元

(iii) 赎回净金额 =  $690.77 + 474.31 - 5.94 - 4.12 = 1,155.02$  元

#### 5、转换费

本基金将在未来开放与基金管理人管理的其他基金之间的基金份额的转换, 届时基金管理人将会同基金托管人制定基金的转换费收取水平并予公告。

#### (三) 其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用, 以及因故与本基金有关的其他费用, 将依照国家法律法规的规定, 予以收取和使用。

(四) 本基金运作过程中的各类纳税主体, 依照国家法律法规的规定, 履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

- 1、在“三、基金管理人”部分, 更新了公司部门设置、现有人员构成及投资决策委员会、内部控制的组织架构的相关信息; 并根据公司 2009 年 3 月 17 日公告内容, 增加披露了更新期后公司高级管理人员及基金经理变更信息。
- 2、在“四、基金托管人”部分, 更新了托管人相关情况信息。
- 3、在“六、基金的申购、赎回”部分, 更新了与定期定额投资计划相关的信息。
- 4、在“八、基金的投资”部分, 更新了基金的投资组合报告。数据截至 2008 年 12 月 31 日。
- 5、更新了“十、基金的业绩”部分; 数据截至 2008 年 12 月 31 日
- 6、在“二十二、其他应披露事项”更新近期发布与本基金有关的公告目录, 目录更新至 2009 年 1 月 26 日。
- 7、在“二十三、对基金份额持有人的服务”部分, 修改了基金份额持有人季度对账单寄送规则并补充了网络在线服务内容

景顺长城基金管理有限公司  
二〇〇九年四月二十八日