

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

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

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
7.6 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.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 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.....	34

7.9 投资组合报告附注.....	34
8 基金份额持有人信息.....	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
9 开放式基金份额变动.....	35
10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
11 备查文件目录.....	41
11.1 备查文件目录.....	41
11.2 存放地点.....	41
11.3 查阅方式.....	41

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	景顺长城鼎益股票（LOF）（场内简称：景顺鼎益）	
基金主代码	162605	
交易代码	162605	162606
基金运作方式	上市契约型开放式	
基金合同生效日	2005年3月16日	
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	
报告期末基金份额总额	5,924,668,329.30份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2005年5月25日	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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。
投资策略	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。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=富时中国A200指数×80%+同业存款利率×20%
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。

注：1、本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“景顺鼎益”。

2、鉴于新华富时指数系列的编制机构新华富时指数公司的股东富时集团已正式宣布成为新华富时指数公司的全资股东，其编制的新华富时指数系列已正式更名为富时中国指数系

列，本公司于2011年3月24日发布公告将本基金业绩比较基准修改为富时中国A200指数×80%+同业存款利率×20%。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皦阳	唐州徽
	联系电话	0755-82370388	010-66594855
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层	北京市西城区复兴门内大街1号
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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		赵如冰	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.invescogreatwall.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
---------------	---------------------------

本期已实现收益	-45,415,704.81
本期利润	-264,767,677.95
加权平均基金份额本期利润	-0.043
本期加权平均净值利润率	-4.37%
本期基金份额净值增长率	-4.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-1,044,129,662.67
期末可供分配基金份额利润	-0.176
期末基金资产净值	5,723,464,438.13
期末基金份额净值	0.966
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	282.76%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

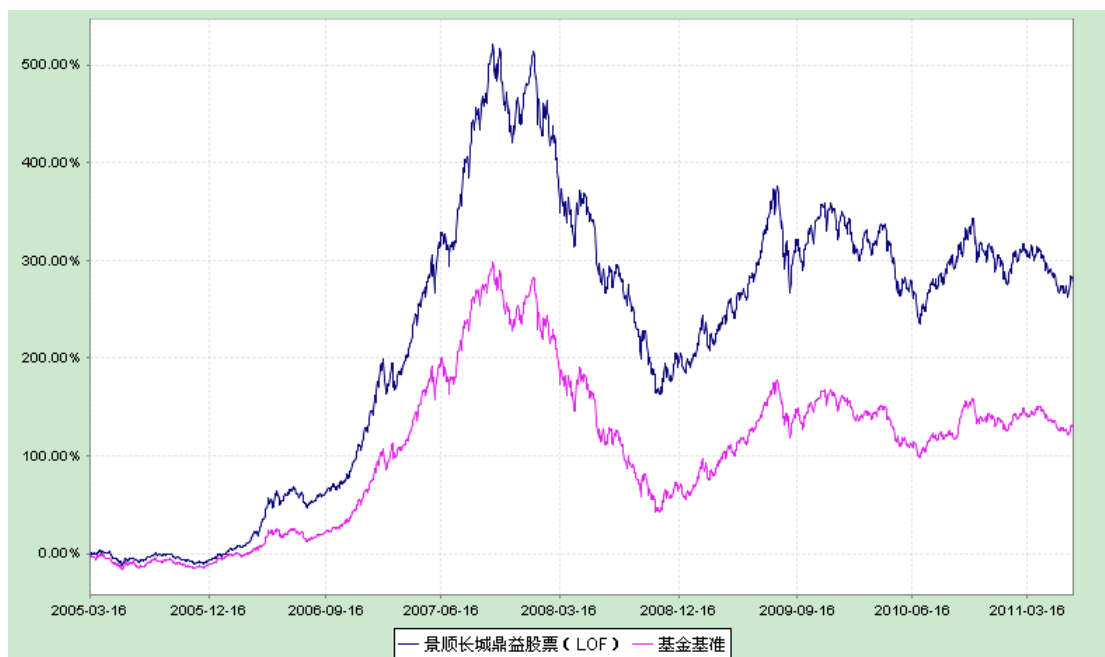
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.66%	1.16%	0.98%	0.96%	1.68%	0.20%
过去三个月	-4.17%	1.04%	-4.29%	0.88%	0.12%	0.16%
过去六个月	-4.45%	1.15%	-1.77%	0.98%	-2.68%	0.17%
过去一年	11.29%	1.30%	14.89%	1.10%	-3.60%	0.20%
过去三年	1.90%	1.58%	6.65%	1.59%	-4.75%	-0.01%
自基金合同生效起至今	282.76%	1.58%	131.34%	1.60%	151.42%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年3月16日至2011年6月30日)



注：本基金的资产配置比例为：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%。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。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2011 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司管理景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金。其中景系列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。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张继荣	本基金基金经理，投资副总监，景顺长城景系列开放式证券投资基金基金经理	2009-09-19	-	11	东北大学工学学士、硕士，清华大学工学博士。曾担任大鹏证券行业分析师，融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理，银华基金投资部首席策略分析师、基金经理等职务；2009年3月加入本公司。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公

平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年上证指数从 2852 点到 2762 点，跌幅仅为 1.64%，但期间沪指波动较大，走出一个“倒 V 字形”。从 1 月 25 日指数收低 2661 点后，大盘一路攀至 3067 点，期间涨幅超过 14%，但随后又从该高位一路跌至 6 月 20 日的 2610 点，将前期的涨幅悉数回吐。

受紧缩政策压制，市场估值水平整体下移，资金从去年下半年广受追捧的高估值的医药、电子等行业以及中小市值股票中撤出，转向建材、地产、煤炭、化工等低估值的周期性行业。这些周期性行业又受益于产能控制、周期性需求回升等利好因素影响，业绩普遍表现向好。

上半年本基金坚持年初的年度策略，自下而上选择股票，保持了较高的股票仓位。行业方面，主要布局于低估值稳定增长的金融、汽车、家电等可选消费品，以及盈利增长趋势仍然强劲的建材、工程机械等周期性行业，规避预期过高的电子等高估值行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年上半年，本基金份额净值增长率为-4.45%，低于业绩比较基准收益率 2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年下半年，随着全球经济复苏缓慢以及油价回落，通胀压力有所缓解，紧缩可能出现局部调整，但是通胀预期仍然存在很多不确定性，紧缩政策难以全面放松，这意味着流动性仍然面临着压力，在这样的背景下，证券市场目前还难以预期大级别的反转行情。下半年我们仍然会坚持从盈利的确定性和估值安全边际上出发，自下而上地去把握个股的投资机会。随着估值水平逐渐回落，以中小市值股票为代表的成长性股票以及非周期性股票下半年也有一定的投资机会，但策略上我们仍然会偏重估值便宜、增长确定的蓝筹股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资部、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险控制岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式或双方认可的其他方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资部人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险控制人员根据投资部提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资部共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。

本基金参与估值流程的各方之间不存在任何重大的利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人尚未与定价服务机构签署任何协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

本报告期末本基金可供分配利润为-1,044,129,662.67元，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期内本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日: 2011年6月30日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	805,998,725.54	933,054,720.18
结算备付金		7,004,320.00	18,553,952.74
存出保证金		7,432,762.95	7,666,637.73
交易性金融资产	6.4.7.2	4,607,098,851.52	5,439,216,658.35
其中: 股票投资		4,607,098,851.52	5,439,216,658.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00	-
应收证券清算款		10,591,215.82	-
应收利息	6.4.7.5	230,488.53	178,541.36
应收股利		2,595,766.75	-
应收申购款		119,819.78	629,476.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,741,071,950.89	6,399,299,987.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,121,281.19	2,023,144.16
应付管理人报酬		6,873,183.50	8,279,581.86
应付托管费		1,145,530.58	1,379,930.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,710,620.65	11,028,964.88

应交税费		8,092.80	8,092.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	748,804.04	634,893.59
负债合计		17,607,512.76	23,354,607.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	5,924,668,329.30	6,305,533,265.87
未分配利润	6.4.7.10	-201,203,891.17	70,412,113.55
所有者权益合计		5,723,464,438.13	6,375,945,379.42
负债和所有者权益总计		5,741,071,950.89	6,399,299,987.02

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值0.966元，基金份额总额5,924,668,329.30份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011 年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年6月30日
一、收入		-181,810,591.28	-1,778,733,672.93
1.利息收入		4,343,173.17	3,701,375.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,564,332.42	3,701,012.15
债券利息收入		10,389.39	363.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		768,451.36	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,171,656.63	-162,111,744.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,455,344.81	-179,675,403.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,632,306.91	85,612.56
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	37,994,694.53	17,478,046.44
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-219,351,973.14	-1,620,383,537.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.7.17	26,552.06	60,232.97
减：二、费用		82,957,086.67	101,789,871.46
1. 管理人报酬		45,119,478.35	54,347,690.16
2. 托管费		7,519,913.10	9,057,948.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	30,049,386.31	38,131,175.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	268,308.91	253,057.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		-264,767,677.95	-1,880,523,544.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-264,767,677.95	-1,880,523,544.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,305,533,265.87	70,412,113.55	6,375,945,379.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-264,767,677.95	-264,767,677.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列)	-380,864,936.57	-6,848,326.77	-387,713,263.34
其中：1.基金申购款	30,758,782.39	-340,449.51	30,418,332.88
2.基金赎回款	-411,623,718.96	-6,507,877.26	-418,131,596.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,924,668,329.30	-201,203,891.17	5,723,464,438.13

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,323,022,095.89	980,891,122.56	8,303,913,218.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,880,523,544.39	-1,880,523,544.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-347,193,868.46	-23,913,917.39	-371,107,785.85
其中：1.基金申购款	53,492,984.42	1,129,960.01	54,622,944.43
2.基金赎回款	-400,686,852.88	-25,043,877.40	-425,730,730.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	6,975,828,227.43	-923,546,339.22	6,052,281,888.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：许义明，主管会计工作负责人：吴建军，会计机构负责人：邵媛媛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2005]7 号文《关于同意景顺长城鼎益股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行业募集，基金合同于 2005 年 3 月 16 日正式生效，首次设立募集规模为 445,627,301.07 份基金份额。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

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。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。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A200 指数*80%+同业存款利率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本基金财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，

自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	805,998,725.54
定期存款	-
其他存款	-
合计	805,998,725.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,768,089,380.75	4,607,098,851.52	-160,990,529.23
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,768,089,380.75	4,607,098,851.52	-160,990,529.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上海交易所市场	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	101,236.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,836.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	126,319.46
应收申购款利息	39.81
其他	56.07
合计	230,488.53

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,710,355.15
银行间市场应付交易费用	265.50
合计	5,710,620.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,393.67
预提费用	247,410.37
合计	748,804.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,305,533,265.87	6,305,533,265.87
本期申购	30,758,782.39	30,758,782.39
本期赎回(以“-”号填列)	-411,623,718.96	-411,623,718.96
本期末	5,924,668,329.30	5,924,668,329.30

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,066,006,946.98	1,136,419,060.53	70,412,113.55
本期利润	-45,415,704.81	-219,351,973.14	-264,767,677.95
本期基金份额交易产生的变动数	67,292,989.12	-74,141,315.89	-6,848,326.77
其中：基金申购款	-5,220,848.73	4,880,399.22	-340,449.51
基金赎回款	72,513,837.85	-79,021,715.11	-6,507,877.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,044,129,662.67	842,925,771.50	-201,203,891.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	3,435,997.38

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	126,443.01
其他	1,892.03
合计	3,564,332.42

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	10,115,570,759.45
减：卖出股票成本总额	10,125,026,104.26
买卖股票差价收入	-9,455,344.81

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	54,920,696.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,278,000.00
减：应收利息总额	10,389.39
债券投资收益	4,632,306.91

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期和上年度可比期间的衍生工具收益项目发生额为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	37,994,694.53
基金投资产生的股利收益	-
合计	37,994,694.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-219,351,973.14
——股票投资	-219,351,973.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
合计	-219,351,973.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	26,552.06
合计	26,552.06

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	30,049,386.31
银行间市场交易费用	-
合计	30,049,386.31

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	64,464.96
信息披露费	148,765.71
银行费用	16,398.54
上市月费	29,752.78
债券托管账户维护费	8,926.92
合计	268,308.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

于 2011 年上半年，并无对本基金存在控制关系或重大影响关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金发起人、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”)	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	1,309,443,603.51	6.68%	4,832,874,731.05	19.47%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	1,112,036.98	6.80%	21,339.61	0.37%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	3,982,873.00	19.26%	1,621,844.74	17.26%

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	45,119,478.35	54,347,690.16

其中：支付销售机构的客户维护费	9,598,965.79	11,734,268.68
-----------------	--------------	---------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,519,913.10	9,057,948.32

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	805,998,725.54	3,435,997.38	1,672,661,750.64	3,575,472.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在 2011 年上半年度及 2010 年上半年度均未存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金在 2011 年上半年度内未实施利润分配。

6.4.12 期末 (2011 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000876	新希望	2011-06-29	证监会审核重大资产重组事项	19.95	2011-07-05	21.95	7,664,951	157,715,300.78	152,915,772.45
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票事项	31.39	2011-07-04	32.60	3,993,870	150,380,017.69	125,367,579.30

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的国债资产的公允价值。本基金于 2011 年 6 月 30 日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金、债券投资、应收申购款及买入返售金融资产等。

本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011年6月 30日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	805,998,725.54	-	-	-	-	-	805,998,725.54
结算备付金	7,004,320.00	-	-	-	-	-	7,004,320.00
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	7,294,213.83	7,432,762.95
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	4,607,098,851.52	4,607,098,851.52
买入返售金 融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	10,591,215.82	10,591,215.82
应收利息	-	-	-	-	-	230,488.53	230,488.53

景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告

应收股利	-	-	-	-	-	2,595,766.75	2,595,766.75
应收申购款	51,798.85	-	-	-	-	68,020.93	119,819.78
资产总计	1,113,193,393.51	-	-	-	-	4,627,878,557.38	5,741,071,950.89
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,121,281.19	3,121,281.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,873,183.50	6,873,183.50
应付托管费	-	-	-	-	-	1,145,530.58	1,145,530.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,710,620.65	5,710,620.65
应交税费	-	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	-	748,804.04	748,804.04
负债总计	-	-	-	-	-	17,607,512.76	17,607,512.76
利率敏感度缺口	1,113,193,393.51	-	-	-	-	-	-
上年度末 2010年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	933,054,720.18	-	-	-	-	-	933,054,720.18
结算备付金	18,553,952.74	-	-	-	-	-	18,553,952.74
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	7,528,088.61	7,666,637.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	5,439,216,658.35	5,439,216,658.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	178,541.36	178,541.36
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	397,578.87	-	-	-	-	231,897.79	629,476.66

资产总计	952,144,800.91	-	-	-	-	5,447,155,186.11	6,399,299,987.02
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,023,144.16	2,023,144.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,279,581.86	8,279,581.86
应付托管费	-	-	-	-	-	1,379,930.31	1,379,930.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	11,028,964.88	11,028,964.88
应交税费	-	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	-	634,893.59	634,893.59
负债总计	-	-	-	-	-	23,354,607.60	23,354,607.60
利率敏感度缺口	952,144,800.91	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日, 本基金未持有交易性债券投资 (2010 年 12 月 31 日: 无), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险, 并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资不少于基金总资产的 60%; 持有现金和到期在 1 年以内政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。于 2011 年 6 月 30 日, 本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,607,098,851.52	80.49	5,439,216,658.35	85.31
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,607,098,851.52	80.49	5,439,216,658.35	85.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	富时中国A200指数收益率*80%增加5%	300,481,883.00	328,361,187.04
	富时中国A200指数收益率*80%减少5%	-300,481,883.00	-328,361,187.04

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

本财务报表已于 2011 年 8 月 22 日经本基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,607,098,851.52	80.25
	其中：股票	4,607,098,851.52	80.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	300,000,000.00	5.23
	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	813,003,045.54	14.16
6	其他各项资产	20,970,053.83	0.37
7	合计	5,741,071,950.89	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	386,414,078.10	6.75
C	制造业	2,673,683,867.04	46.71
C0	食品、饮料	152,915,772.45	2.67
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	43,645,000.00	0.76
C4	石油、化学、塑胶、塑料	481,983,771.21	8.42
C5	电子	9,528,208.10	0.17
C6	金属、非金属	262,617,230.52	4.59
C7	机械、设备、仪表	1,471,543,186.50	25.71
C8	医药、生物制品	241,018,698.26	4.21
C99	其他制造业	10,432,000.00	0.18
D	电力、煤气及水的生产和供应业	85,103,258.44	1.49
E	建筑业	220,104,147.00	3.85
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	299,644,801.73	5.24
I	金融、保险业	880,357,618.19	15.38
J	房地产业	61,791,081.02	1.08
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,607,098,851.52	80.49

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	000157	中联重科	18,348,759	282,203,913.42	4.93
2	600104	上海汽车	14,866,677	278,601,526.98	4.87
3	600741	华域汽车	23,000,000	255,990,000.00	4.47
4	600000	浦发银行	25,536,758	251,281,698.72	4.39
5	600585	海螺水泥	9,000,000	249,840,000.00	4.37
6	601166	兴业银行	17,739,197	239,124,375.56	4.18
7	600036	招商银行	17,530,520	228,247,370.40	3.99
8	600970	中材国际	7,250,915	198,167,506.95	3.46
9	600690	青岛海尔	6,938,489	193,930,767.55	3.39
10	601088	中国神华	5,306,461	159,936,734.54	2.79
11	000876	新希望	7,664,951	152,915,772.45	2.67
12	002001	新和成	4,854,596	142,967,852.20	2.50
13	000651	格力电器	5,564,759	130,771,836.50	2.28
14	600216	浙江医药	3,993,870	125,367,579.30	2.19
15	600375	星马汽车	5,826,454	123,112,973.02	2.15
16	000527	美的电器	6,195,618	113,937,415.02	1.99
17	000937	冀中能源	3,971,076	100,666,776.60	1.76
18	600636	三爱富	2,727,709	96,915,500.77	1.69
19	600015	华夏银行	8,444,713	91,794,030.31	1.60
20	600160	巨化股份	2,740,239	88,948,157.94	1.55
21	600655	豫园商城	7,751,938	84,341,085.44	1.47
22	601101	昊华能源	1,237,956	78,127,403.16	1.37
23	601398	工商银行	15,674,920	69,910,143.20	1.22
24	002037	久联发展	2,748,500	67,008,430.00	1.17
25	000987	广州友谊	2,933,153	61,566,881.47	1.08
26	600486	扬农化工	2,829,845	61,520,830.30	1.07
27	600729	重庆百货	1,261,724	54,531,711.28	0.95
28	000666	经纬纺机	3,939,625	54,445,617.50	0.95
29	600631	百联股份	3,365,664	50,081,080.32	0.88
30	601808	中海油服	2,669,830	47,683,163.80	0.83
31	600518	康美药业	3,500,000	46,060,000.00	0.80
32	600795	国电电力	14,487,938	42,884,296.48	0.75
33	600236	桂冠电力	7,634,532	42,218,961.96	0.74
34	000002	万科A	4,595,801	38,834,518.45	0.68
35	600469	风神股份	3,204,417	38,549,136.51	0.67
36	000999	华润三九	1,999,997	35,899,946.15	0.63
37	002078	太阳纸业	2,500,000	26,525,000.00	0.46
38	601607	上海医药	1,460,175	24,530,940.00	0.43
39	600376	首开股份	1,737,817	22,956,562.57	0.40

40	601668	中国建筑	5,443,335	21,936,640.05	0.38
41	000715	中兴商业	1,908,578	19,448,409.82	0.34
42	000417	合肥百货	954,837	17,378,033.40	0.30
43	600963	岳阳林纸	2,000,000	17,120,000.00	0.30
44	002386	天原集团	1,000,000	13,420,000.00	0.23
45	000501	鄂武商 A	720,000	12,297,600.00	0.21
46	000589	黔轮胎 A	1,700,000	11,203,000.00	0.20
47	002345	潮宏基	400,000	10,432,000.00	0.18
48	300083	劲胜股份	693,970	9,528,208.10	0.17
49	600252	中恒集团	492,221	9,160,232.81	0.16
50	600019	宝钢股份	1,361,784	8,211,557.52	0.14
51	000401	冀东水泥	182,700	4,565,673.00	0.08

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600636	三爱富	351,933,304.43	5.52
2	600585	海螺水泥	296,035,200.31	4.64
3	000157	中联重科	293,949,221.35	4.61
4	601166	兴业银行	277,222,352.65	4.35
5	600031	三一重工	258,349,477.66	4.05
6	600015	华夏银行	233,542,216.58	3.66
7	601699	潞安环能	228,669,838.23	3.59
8	002078	太阳纸业	225,999,511.17	3.54
9	000024	招商地产	222,148,194.88	3.48
10	000876	新希望	220,230,579.77	3.45
11	601808	中海油服	210,830,085.91	3.31
12	002024	苏宁电器	209,868,880.06	3.29
13	600963	岳阳林纸	196,566,388.15	3.08
14	600160	巨化股份	193,391,549.05	3.03
15	600030	中信证券	192,608,703.92	3.02
16	002001	新和成	185,740,208.35	2.91
17	000401	冀东水泥	177,622,601.87	2.79
18	000338	潍柴动力	170,634,333.65	2.68
19	601088	中国神华	161,236,321.66	2.53
20	600104	上海汽车	152,154,927.30	2.39
21	600216	浙江医药	150,380,017.69	2.36

22	601101	昊华能源	143,715,832.94	2.25
23	000002	万 科A	142,117,331.89	2.23
24	601766	中国南车	140,509,304.45	2.20
25	601899	紫金矿业	129,422,582.30	2.03

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600636	三爱富	362,657,240.54	5.69
2	600031	三一重工	309,587,613.96	4.86
3	000983	西山煤电	299,346,884.97	4.69
4	601601	中国太保	278,340,313.33	4.37
5	601318	中国平安	260,452,197.61	4.08
6	601328	交通银行	254,334,404.37	3.99
7	601699	潞安环能	251,687,193.69	3.95
8	000002	万 科A	231,978,335.89	3.64
9	002024	苏宁电器	216,363,507.53	3.39
10	000024	招商地产	205,614,097.19	3.22
11	002008	大族激光	195,842,449.92	3.07
12	600030	中信证券	194,746,127.98	3.05
13	600690	青岛海尔	181,792,863.99	2.85
14	000338	潍柴动力	174,368,060.57	2.73
15	000401	冀东水泥	171,848,197.89	2.70
16	600963	岳阳林纸	162,752,036.21	2.55
17	000425	徐工机械	161,082,278.40	2.53
18	002078	太阳纸业	160,903,110.52	2.52
19	600160	巨化股份	142,082,383.61	2.23
20	601898	中煤能源	141,230,588.06	2.22
21	600970	中材国际	137,486,227.01	2.16
22	601766	中国南车	132,567,937.41	2.08
23	601111	中国国航	129,400,595.96	2.03

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,512,260,270.57
卖出股票的收入（成交）总额	10,115,570,759.45

注：买入股票成本、卖出股票收入均为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,432,762.95
2	应收证券清算款	10,591,215.82
3	应收股利	2,595,766.75
4	应收利息	230,488.53
5	应收申购款	119,819.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,970,053.83

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
295,356	20,059.41	15,660,171.60	0.26%	5,909,008,157.70	99.74%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	张萍	500,747.00	0.47%
2	李喜仪	460,000.00	0.43%
3	刘丽芬	417,995.00	0.39%
4	张爱招	415,100.00	0.39%
5	陈圭锡	400,000.00	0.37%
6	李锡祥	400,000.00	0.37%
7	牟德武	387,465.00	0.36%
8	郭文飞	376,691.00	0.35%
9	王华安	365,546.00	0.34%
10	关少兰	317,200.00	0.29%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	5,042.90	0.0001%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2005 年 3 月 16 日) 基金份额总额	445,627,301.07
本报告期期初基金份额总额	6,305,533,265.87
本报告期基金总申购份额	30,758,782.39
减：本报告期基金总赎回份额	411,623,718.96

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,924,668,329.30

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2011 年 4 月 7 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会表决通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可 [2011] 414 号文核准，同意刘焕喜先生辞去本公司督察长一职，转任本公司副总经理；同时聘任黄卫明先生担任本公司督察长。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内,本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰联合证券有限责任公司	1	5,329,559,313.72	27.21%	4,530,119.51	27.72%	未变
海通证券股份有限公司	2	3,342,708,117.58	17.06%	2,778,735.51	17.00%	未变
招商证券股份有限公司	2	2,463,567,216.50	12.58%	2,051,968.81	12.55%	未变
广发证券股份有限公司	1	2,018,432,659.27	10.30%	1,639,986.65	10.03%	未变
长城证券有限责任公司	2	1,309,443,603.51	6.68%	1,112,036.98	6.80%	未变
中信建投证券有限责任公司	2	1,213,174,321.89	6.19%	992,310.08	6.07%	未变
英大证券有限责任公司	1	1,163,703,978.43	5.94%	989,145.49	6.05%	新增
中国国际金融有限公司	1	1,059,996,377.98	5.41%	861,253.47	5.27%	未变
长江证券股份有限公司	1	898,755,878.68	4.59%	730,246.25	4.47%	新增
中航证券有限公司	1	430,994,790.85	2.20%	366,344.37	2.24%	新增
中国银河证券股份有限公司	1	359,646,771.61	1.84%	292,215.58	1.79%	未变
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变

注:基金专用交易单元的选择标准和程序如下:

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚,信誉良好;
- b、财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- c、经营行为规范,最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;
- d、内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足本基金运作高度保密的要求;
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求,提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰联合证券有限责任公司	54,920,696.30	100.00%	537,600,000.00	55.24%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	435,600,000.00	44.76%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-06-29
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-06-28
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增华夏银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-06-28
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券和爱建证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-06-16
5	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金在齐鲁证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-06-02

6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券开放式基金网上交易申购费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-02
7	景顺长城基金管理有限公司关于开通直销网上交易“精明定投”业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-05-28
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰联合证券开放式基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-05-19
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券开通基金“定期定额投资业务”并参加非现场交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-05-06
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为代销机构并参加非现场交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-05-06
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-28
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰联合证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-28
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰联合证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-28
14	景顺长城鼎益股票(LOF)2011第1号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-23
15	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2011年第一季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-22
16	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易优惠费率的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-11
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增东方证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-11
18	景顺长城基金管理有限公司关于新增东莞证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-09
19	景顺长城基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-07
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金	中国证券报, 上海	2011-04-07

	持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	证券报, 证券时报, 基金管理人网站	
21	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金参加工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-30
22	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2010年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-28
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准更名公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-24
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信银行开通转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-24
25	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金参加光大证券网上交易定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-08
26	景顺长城基金管理有限公司关于新增中投证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-24
27	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-22
28	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在中信证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-18
29	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在中信证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-18
30	景顺长城基金管理有限公司关于新增中航证券为旗下基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-11
31	景顺长城基金管理有限公司关于新增浙商证券为旗下基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-01-28
32	景顺长城基金管理有限公司关于开通工商银行借记卡基金网上直销业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-01-27
33	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2010年第四季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-01-21
34	景顺长城基金管理有限公司关于开展直销网上交易农业银行支付渠道申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-01-08

35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金2010年度最后一个交易日基金资产净值和份额净值的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011-01-04
----	--	--------------------------	------------

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 2、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
二〇一一年八月二十四日