

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF） 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 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

送出日期：2012 年 3 月 30 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 2012 年 3 月 28 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。

安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
8.3 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	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6 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	46
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
8.8 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	46
8.9 投资组合报告附注	46
§9 基金份额持有人信息	46

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	47
§10 开放式基金份额变动.....	47
§11 重大事件揭示.....	48
11.1 基金份额持有人大会决议.....	48
11.2 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.....	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4 基金投资策略的改变.....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8 其他重大事件.....	50
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 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	5,744,849,562.91 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	2005-05-25	

注：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”。

2.2 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	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：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	杨焱阳	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.invescogreatwall.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街27号投资广场23层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-617,313,218.89	29,176,501.02	-1,018,778,597.75
本期利润	-1,274,260,124.25	-858,555,790.97	3,761,057,933.46
加权平均基金份额本期利润	-0.2141	-0.1244	0.4374
本期加权平均净值利润率	-22.79%	-12.30%	45.10%
本期基金份额净值增长率	-21.66%	-10.85%	57.50%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-1,580,008,379.82	-1,066,006,946.98	-1,285,002,225.55
期末可供分配基金份额利润	-0.2750	-0.1691	-0.1755
期末基金资产净值	4,549,608,540.51	6,375,945,379.42	8,303,913,218.45
期末基金份额净值	0.792	1.011	1.134
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	213.82%	300.59%	349.33%

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、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

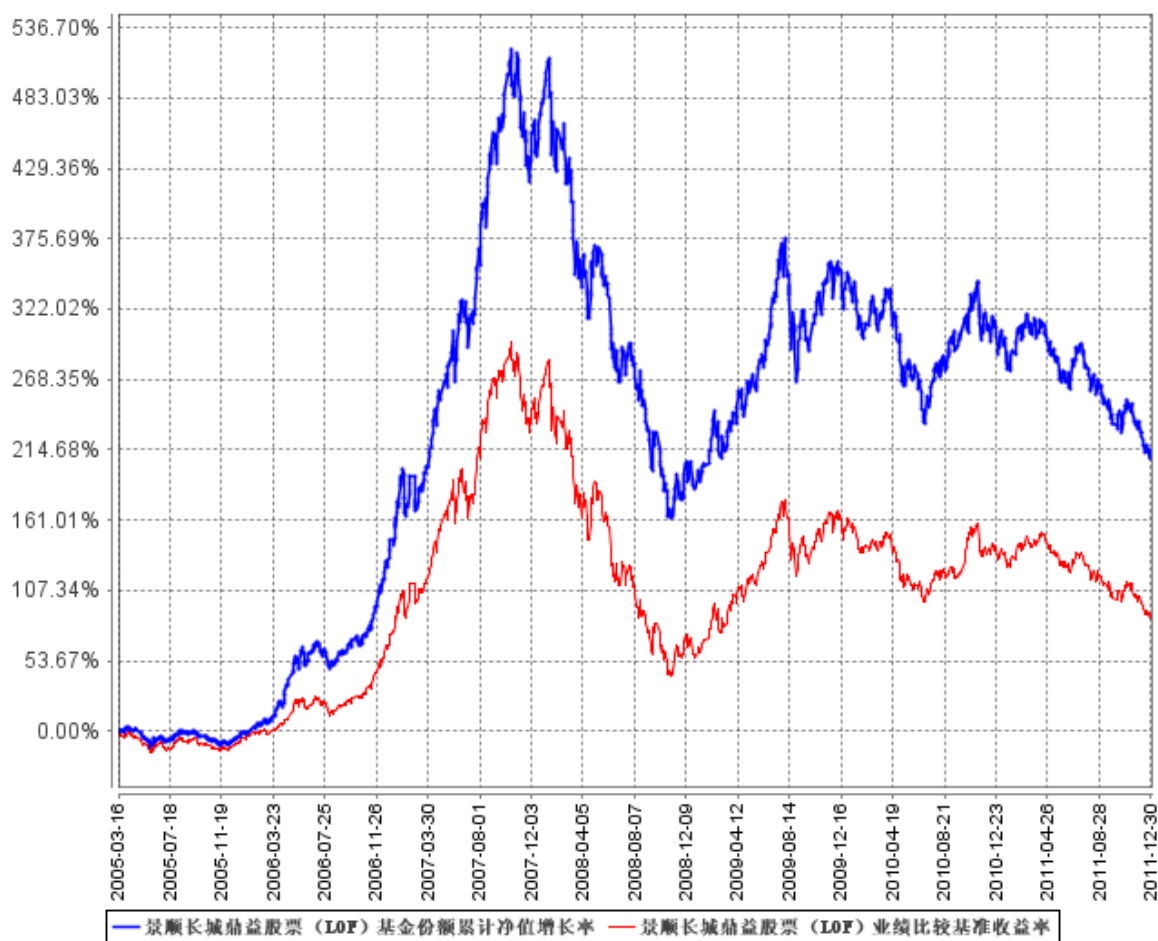
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

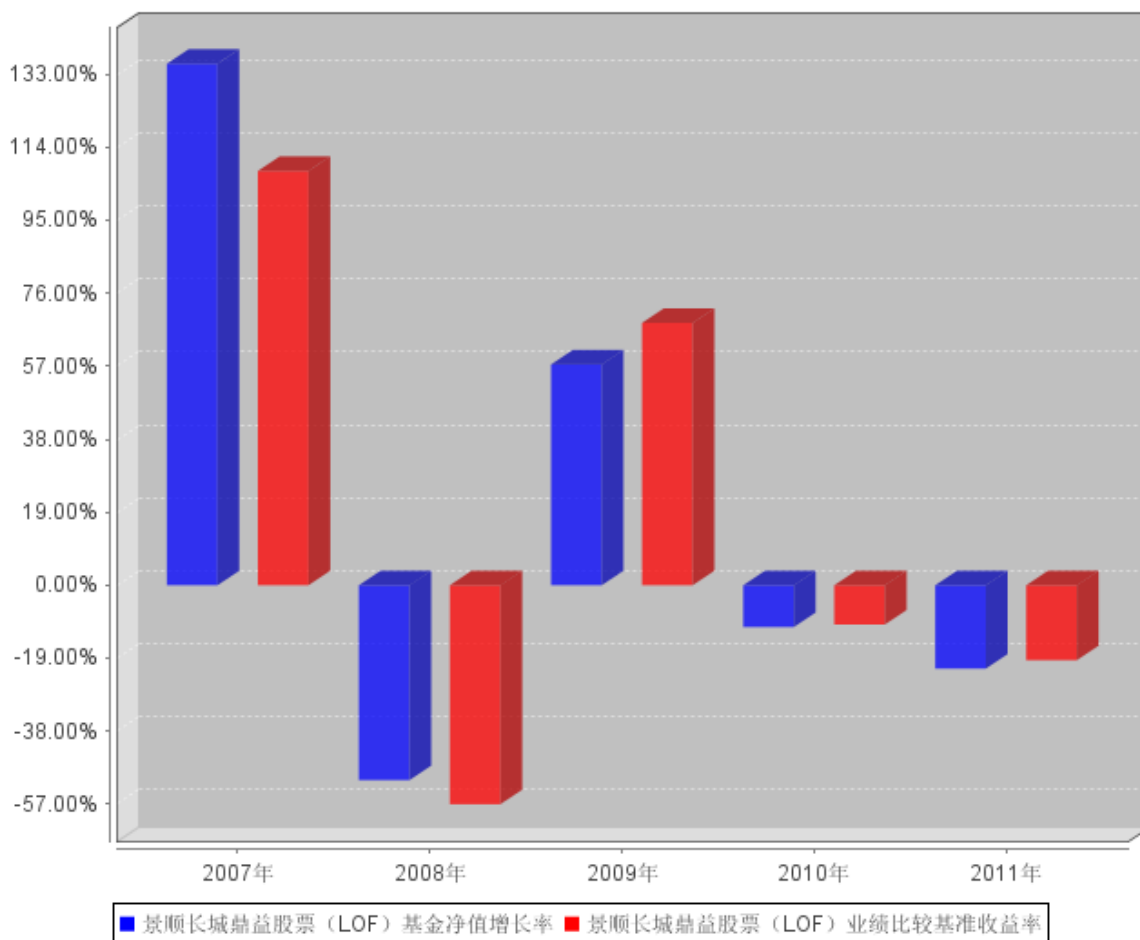
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.27%	1.02%	-6.21%	1.10%	-0.06%	-0.08%
过去六个月	-18.01%	0.99%	-18.01%	1.07%	0.00%	-0.08%
过去一年	-21.66%	1.07%	-19.47%	1.03%	-2.19%	0.04%
过去三年	10.00%	1.42%	21.72%	1.33%	-11.72%	0.09%
过去五年	27.77%	1.67%	8.86%	1.71%	18.91%	-0.04%
自基金合同生效起至今	213.82%	1.55%	89.67%	1.57%	124.15%	-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



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 1 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 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、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列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。

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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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 年 9 月 19 日	-	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”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指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。

3、张继荣先生已于 2012 年 1 月 16 日离任景系列基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，由于本基金管理人对外披露的 2010 年基金年度报告未对公司相关高级管理人员 2010 年度被深圳证监局采取监管谈话等行政监管措施的原因及结论进行披露，深圳证监局于 2011 年 7

月 1 日向本基金管理人出具了《监管提示函》，本基金管理人已及时向深圳证监局提交了书面整改报告。除此之外，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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年的中国 A 股市场遭遇内外交困的局面。欧债危机、美债危机接踵而至，全球经济复苏脚步受阻。国内 CPI 居高不下，经济增速下滑，上市公司盈利自高点逐步回落。坚决的房地产调控措施，贯穿全年的收缩货币，持续的大规模 IPO 扩容更使得股市雪上加霜。在政策面、基本面的重压下，2011 年 A 股走出了单边下跌的行情，除了 1 季度表现尚可、6 月份和 10 月份出现了两次反弹外，A 股市场持续下跌，年底跌至最低点 2149 点，创出两年来的新低，市场整体跌幅超过 20%。

本基金在 2011 年基本保持相对偏低的仓位水平，在行业配置与选股上也是以低估值的蓝筹股为主，增持了一些稳定性较高的消费类股票，规避强周期股票和估值高的中小股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年，本基金份额净值增长率为-21.66%，低于业绩比较基准收益率 2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全年的角度来看，2012 年中国股票市场仍然面临大幅扩容，货币政策仍然偏紧，供给状况和流动性难以明显好转，企业盈利仍处在下降趋势中，市场看起来难以有更乐观的预期。但是考虑到结构性估值水平的因素，我们对股市 2012 年的行情并不悲观，毕竟目前市场蓝筹股票的估值水平已经非常低，A 股市场已经连续下跌整整 2 年多，市场存在结构性机会。而短期看，对经济、对市场的悲观预

期仍处在自我强化阶段。经历过去 2 年大规模高价 IPO 之后，市场正处在纠正这种结构性偏错的阶段，市场仍在夯实底部等待积极因素出现。

2012 年我们在个股方面主要以低估值业绩平稳的蓝筹股为主，将更加重视商业模式、管理能力、创新能力等具有明显核心竞争力的企业。在行业方面，以零售、医药为代表的消费板块已经具有明显的投资价值，且消费行业有较大的成长空间，具有长期增长潜力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人进一步完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完

整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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及其适用性的情况时，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。

4.8 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。

截止本报告期末，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 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表，2011 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 基金管理人景顺长城基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	张小东 周刚
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2012 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	905,417,708.59	933,054,720.18
结算备付金		11,171,950.13	18,553,952.74
存出保证金		2,707,386.36	7,666,637.73
交易性金融资产	7.4.7.2	3,603,181,946.76	5,439,216,658.35
其中：股票投资		3,603,181,946.76	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	48,900,273.35	-
应收证券清算款		17,443,799.60	-
应收利息	7.4.7.5	220,997.11	178,541.36
应收股利		-	-
应收申购款		6,632.41	629,476.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,589,050,694.31	6,399,299,987.02
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		26,475,747.55	-
应付赎回款		1,055,938.15	2,023,144.16
应付管理人报酬		5,928,092.76	8,279,581.86
应付托管费		988,015.46	1,379,930.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,251,573.45	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	7.4.7.8	734,693.63	634,893.59
负债合计		39,442,153.80	23,354,607.60
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	5,744,849,562.91	6,305,533,265.87
未分配利润	7.4.7.10	-1,195,241,022.40	70,412,113.55
所有者权益合计		4,549,608,540.51	6,375,945,379.42
负债和所有者权益总计		4,589,050,694.31	6,399,299,987.02

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.792 元，基金份额总额 5,744,849,562.91 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-1,128,462,403.58	-659,090,274.39
1. 利息收入		10,399,336.25	6,877,762.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,190,550.91	6,867,319.51
债券利息收入		11,356.62	10,442.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,197,428.72	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-481,950,781.85	221,636,666.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-535,878,614.99	181,005,211.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,561,663.18	4,204,692.29
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	49,366,169.96	36,426,762.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-656,946,905.36	-887,732,291.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	35,947.38	127,588.37
减：二、费用		145,797,720.67	199,465,516.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	84,073,293.57	104,876,948.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,012,215.62	17,479,491.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	47,169,931.27	76,581,905.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	542,280.21	527,171.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,274,260,124.25	-858,555,790.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,274,260,124.25	-858,555,790.97

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	-	-1,274,260,124.25	-1,274,260,124.25
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）	-560,683,702.96	8,606,988.30	-552,076,714.66
其中：1. 基金申购款	52,804,504.51	-2,834,197.45	49,970,307.06
2. 基金赎回款	-613,488,207.47	11,441,185.75	-602,047,021.72
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）	5,744,849,562.91	-1,195,241,022.40	4,549,608,540.51
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	-	-858,555,790.97	-858,555,790.97
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）	-1,017,488,830.02	-51,923,218.04	-1,069,412,048.06
其中：1. 基金申购款	87,780,820.38	916,150.10	88,696,970.48
2. 基金赎回款	-1,105,269,650.40	-52,839,368.14	-1,158,109,018.54
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）	6,305,533,265.87	70,412,113.55	6,375,945,379.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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开放式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%。

7.4.2 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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止

确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（5）回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配利润的已实现部分占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配利润的未实现部分占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按融入资金应收或实际收到金额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配比例按有关规定制定；

(2) 场外投资者可以选择现金分红或红利再投资，场内投资者只能选择现金分红，本基金分红的默认方式为现金分红；

(3) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，才可进行当期收益分配；

(5) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(6) 本基金每年收益分配次数最多为 4 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；

(7) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(8) 每一基金份额享有同等分配权。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局研究决定，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》的规定，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；

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。

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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、

债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄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[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	905,417,708.59	933,054,720.18
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	905,417,708.59	933,054,720.18

注：本基金本期及上年度可比期间均未投资于定期存款和其他存款项目。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,201,767,408.21	3,603,181,946.76	-598,585,461.45
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	4,201,767,408.21	3,603,181,946.76	-598,585,461.45
项目	上年度末 2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,380,855,214.44	5,439,216,658.35	58,361,443.91
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	5,380,855,214.44	5,439,216,658.35	58,361,443.91

注：于本期及上年度可比期间，本基金所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末的衍生金融资产/负债余额均为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	48,900,273.35	-
合计	48,900,273.35	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	196,758.50	171,943.79
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	5,027.30	6,493.90
应收债券利息	-	-

应收买入返售证券利息	19,134.72	-
应收申购款利息	14.29	55.27
其他	62.30	48.40
合计	220,997.11	178,541.36

7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末的其他资产余额均为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,247,254.52	11,028,964.88
银行间市场应付交易费用	4,318.93	-
合计	4,251,573.45	11,028,964.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	193.63	393.59
预提费用	234,500.00	134,500.00
合计	734,693.63	634,893.59

7.4.7.9 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12月31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	52,804,504.51	52,804,504.51
本期赎回（以“-”号填列）	-613,488,207.47	-613,488,207.47
_年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,744,849,562.91	5,744,849,562.91

7.4.7.10 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	-617,313,218.89	-656,946,905.36	-1,274,260,124.25
本期基金份额交易产生的变动数	103,311,786.05	-94,704,797.75	8,606,988.30
其中：基金申购款	-9,933,766.70	7,099,569.25	-2,834,197.45
基金赎回款	113,245,552.75	-101,804,367.00	11,441,185.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,580,008,379.82	384,767,357.42	-1,195,241,022.40

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	7,980,984.93	6,595,352.70
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	206,019.19	267,793.17
其他	3,546.79	4,173.64
合计	8,190,550.91	6,867,319.51

7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	15,817,586,387.29	25,632,434,605.92
减：卖出股票成本总额	16,353,465,002.28	25,451,429,394.07
买卖股票差价收入	-535,878,614.99	181,005,211.85

7.4.7.13 债券投资收益

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12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到	59,264,019.80	21,960,623.00

期兑付) 成交总额		
减: 卖出债券 (债转股及债券到期兑付) 成本总额	54,691,000.00	17,740,936.24
减: 应收利息总额	11,356.62	14,994.47
债券投资收益	4,561,663.18	4,204,692.29

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	49,366,169.96	36,426,762.72
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	49,366,169.96	36,426,762.72

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-656,946,905.36	-887,732,291.99
——股票投资	-656,946,905.36	-887,654,820.23
——债券投资	-	-77,471.76
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-656,946,905.36	-887,732,291.99

7.4.7.17 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	35,947.38	127,588.37
合计	35,947.38	127,588.37

7.4.7.18 交易费用

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12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	47,169,931.27	76,581,905.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	47,169,931.27	76,581,905.38

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	34,280.21	19,171.08
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
上市月费	60,000.00	60,000.00
合计	542,280.21	527,171.08

7.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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	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
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东

注：本期并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	4,525,991,550.92	14.71%	10,619,639,411.74	21.18%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31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	3,824,780.78	14.89%	1,924,607.96	45.31%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	8,889,386.45	21.27%	2,308,298.89	20.93%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

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 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	84,073,293.57	104,876,948.69
其中：支付销售机构的客户维护费	18,076,314.42	22,705,340.14

注：1) 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。

2) 基金管理费于本期末尚未支付的金额为 5,928,092.76 元，于上年度末尚未支付的金额为 8,279,581.86 元。

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,012,215.62	17,479,491.43

注：1) 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。

2) 基金托管费于本期末尚未支付的金额为 988,015.46 元，于上年度末尚未支付的金额为 1,379,930.31 元。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本年度及上年度同期与关联方未进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 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

本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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12月31日		2010年1月1日至2010年12月31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	905,417,708.59	7,980,984.93	933,054,720.18	6,595,352.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601555	东吴证券	2011年12月6日	2012年3月12日	公开发行有明确锁定期	6.50	6.57	3,798,643	24,691,179.50	24,957,084.51	-
601336	新华保险	2011年12月9日	2012年3月16日	公开发行有明确锁定期	23.25	27.87	524,648	12,198,066.00	14,621,939.76	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

于本期末及上年度末，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 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 7.4.12 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 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011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	905,417,708.59	-	-	-	-	-	905,417,708.59
结算备付金	11,171,950.13	-	-	-	-	-	11,171,950.13
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	2,568,837.24	2,707,386.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,603,181,946.76	3,603,181,946.76
买入返售金融资产	48,900,273.35	-	-	-	-	-	48,900,273.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	17,443,799.60	17,443,799.60
应收利息	-	-	-	-	-	220,997.11	220,997.11
应收申购款	-	-	-	-	-	6,632.41	6,632.41
资产总计	965,628,481.19	-	-	-	-	3,623,422,213.12	4,589,050,694.31
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	26,475,747.55	26,475,747.55
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,055,938.15	1,055,938.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,928,092.76	5,928,092.76

应付托管费	-	-	-	-	-	988,015.46	988,015.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,251,573.45	4,251,573.45
应交税费	-	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	-	734,693.63	734,693.63
负债总计	-	-	-	-	-	39,442,153.80	39,442,153.80
利率敏感度缺口	965,628,481.19	-	-	-	-	-	-
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
应收利息	-	-	-	-	-	178,541.36	178,541.36
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	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对期末基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 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	3,603,181,946.76	79.20	5,439,216,658.35	85.31
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,603,181,946.76	79.20	5,439,216,658.35	85.31

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	“沪深 300 指数×80%”上升 5%	209,281,992.86	328,361,187.04
“沪深 300 指数×80%”下降 5%	-209,281,992.86	-328,361,187.04	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2012 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,603,181,946.76	78.52
	其中：股票	3,603,181,946.76	78.52
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	48,900,273.35	1.07
	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	916,589,658.72	19.97
6	其他各项资产	20,378,815.48	0.44
7	合计	4,589,050,694.31	100.00

8.2 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	35,063,046.68	0.77
B	采掘业	256,514,742.64	5.64
C	制造业	1,647,455,618.01	36.21
C0	食品、饮料	363,068,765.90	7.98
C1	纺织、服装、皮毛	25,121,550.00	0.55
C2	木材、家具	2,771,131.80	0.06
C3	造纸、印刷	8,705,048.80	0.19
C4	石油、化学、塑胶、塑料	146,415,996.55	3.22
C5	电子	124,961,608.90	2.75
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	675,038,673.06	14.84
C8	医药、生物制品	301,372,843.00	6.62
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	70,867,439.80	1.56
E	建筑业	38,699,971.46	0.85
F	交通运输、仓储业	26,250,549.44	0.58
G	信息技术业	143,995,176.89	3.17
H	批发和零售贸易	487,127,303.11	10.71
I	金融、保险业	801,259,488.04	17.61

J	房地产业	-	-
K	社会服务业	95,948,610.69	2.11
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,603,181,946.76	79.20

8.3 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	600690	青岛海尔	19,894,429	177,657,250.97	3.90
2	601166	兴业银行	14,067,698	176,127,578.96	3.87
3	600000	浦发银行	19,332,436	164,132,381.64	3.61
4	600036	招商银行	13,088,936	155,365,670.32	3.41
5	600188	兖州煤业	6,308,476	141,246,777.64	3.10
6	000423	东阿阿胶	3,108,528	133,511,277.60	2.93
7	000568	泸州老窖	3,479,658	129,791,243.40	2.85
8	000651	格力电器	5,823,573	100,689,577.17	2.21
9	600741	华域汽车	9,841,101	91,128,595.26	2.00
10	002024	苏宁电器	10,392,040	87,708,817.60	1.93
11	601601	中国太保	4,490,349	86,259,604.29	1.90
12	000987	广州友谊	5,223,691	82,429,843.98	1.81
13	601628	中国人寿	4,648,059	81,991,760.76	1.80
14	300171	东富龙	2,130,122	81,519,768.94	1.79
15	600519	贵州茅台	416,433	80,496,498.90	1.77
16	000876	新希望	4,765,410	79,820,617.50	1.75
17	000417	合肥百货	5,532,014	78,167,357.82	1.72
18	601088	中国神华	2,772,950	70,238,823.50	1.54
19	601398	工商银行	15,674,920	66,461,660.80	1.46
20	600655	豫园商城	7,751,938	64,961,240.44	1.43
21	600723	首商股份	6,364,369	62,116,241.44	1.37
22	002410	广联达	1,876,419	61,978,119.57	1.36
23	000422	湖北宜化	3,414,936	60,273,620.40	1.32
24	000858	五粮液	1,653,227	54,225,845.60	1.19
25	600031	三一重工	4,243,526	53,213,816.04	1.17
26	600827	友谊股份	4,305,257	48,950,772.09	1.08
27	000338	潍柴动力	1,541,681	48,562,951.50	1.07
28	600518	康美药业	4,077,663	45,751,378.86	1.01
29	002037	久联发展	2,340,000	44,811,000.00	0.98

30	002038	双鹭药业	1,353,191	44,452,324.35	0.98
31	002475	立讯精密	1,251,139	43,664,751.10	0.96
32	002415	海康威视	1,000,000	43,000,000.00	0.95
33	300216	千山药机	1,171,775	42,172,182.25	0.93
34	600557	康缘药业	2,543,313	37,412,134.23	0.82
35	600886	国投电力	6,050,280	36,059,668.80	0.79
36	601888	中国国旅	1,256,248	32,951,385.04	0.72
37	600015	华夏银行	2,790,900	31,341,807.00	0.69
38	600337	美克股份	3,465,256	29,905,159.28	0.66
39	002001	新和成	1,483,506	29,165,727.96	0.64
40	600588	用友软件	1,601,383	28,824,894.00	0.63
41	601117	中国化学	4,921,137	28,050,480.90	0.62
42	002325	洪涛股份	1,409,034	27,898,873.20	0.61
43	002430	杭氧股份	1,216,027	27,251,165.07	0.60
44	300115	长盈精密	732,296	26,765,418.80	0.59
45	600125	铁龙物流	2,828,723	26,250,549.44	0.58
46	600406	国电南瑞	827,993	25,833,381.60	0.57
47	002293	罗莱家纺	334,954	25,121,550.00	0.55
48	600153	建发股份	3,932,317	25,088,182.46	0.55
49	601555	东吴证券	3,798,643	24,957,084.51	0.55
50	002069	獐子岛	948,753	23,301,373.68	0.51
51	601898	中煤能源	2,584,000	23,281,840.00	0.51
52	002474	榕基软件	533,361	20,801,079.00	0.46
53	600168	武汉控股	3,029,850	20,784,771.00	0.46
54	600054	黄山旅游	1,324,334	19,666,359.90	0.43
55	300146	汤臣倍健	240,495	18,734,560.50	0.41
56	002340	格林美	866,477	16,896,301.50	0.37
57	601336	新华保险	524,648	14,621,939.76	0.32
58	600486	扬农化工	999,950	14,599,270.00	0.32
59	600236	桂冠电力	3,700,000	14,023,000.00	0.31
60	002341	新纶科技	804,631	13,397,106.15	0.29
61	002386	天原集团	1,500,000	13,335,000.00	0.29
62	002350	北京科锐	681,984	12,834,938.88	0.28
63	000826	桑德环境	508,300	12,809,160.00	0.28
64	300105	龙源技术	245,178	12,575,179.62	0.28
65	000527	美的电器	1,000,000	12,240,000.00	0.27
66	002299	圣农发展	793,100	11,761,673.00	0.26
67	002273	水晶光电	356,900	11,531,439.00	0.25
68	601607	上海医药	1,000,000	11,080,000.00	0.24

69	601186	中国铁建	2,849,894	10,801,098.26	0.24
70	002511	中顺洁柔	368,858	8,705,048.80	0.19
71	002441	众业达	512,800	7,799,688.00	0.17
72	002063	远光软件	386,657	6,557,702.72	0.14
73	601369	陕鼓动力	533,938	6,118,929.48	0.13
74	300124	汇川技术	95,176	5,158,539.20	0.11
75	002353	杰瑞股份	69,300	4,851,000.00	0.11
76	300260	新莱应材	154,286	3,915,778.68	0.09
77	601996	丰林集团	310,665	2,771,131.80	0.06
78	000430	ST 张家界	258,767	2,471,224.85	0.05

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002024	苏宁电器	384,963,515.24	6.04
2	600636	三爱富	363,222,632.49	5.70
3	600585	海螺水泥	350,224,054.56	5.49
4	600031	三一重工	310,903,002.58	4.88
5	600015	华夏银行	305,409,391.16	4.79
6	601166	兴业银行	296,661,037.65	4.65
7	000338	潍柴动力	296,440,542.33	4.65
8	000157	中联重科	293,949,221.35	4.61
9	600160	巨化股份	280,934,675.71	4.41
10	000876	新希望	240,010,819.00	3.76
11	601699	潞安环能	228,669,838.23	3.59
12	601088	中国神华	227,001,466.82	3.56
13	002078	太阳纸业	225,999,511.17	3.54
14	000024	招商地产	222,148,194.88	3.48
15	601808	中海油服	210,830,085.91	3.31
16	000937	冀中能源	210,641,320.05	3.30
17	601766	中国南车	206,922,894.16	3.25
18	000651	格力电器	204,675,341.44	3.21
19	600188	兖州煤业	203,738,227.69	3.20
20	002001	新和成	200,461,217.27	3.14
21	600963	岳阳林纸	196,566,388.15	3.08

22	000527	美的电器	195,304,154.14	3.06
23	600030	中信证券	192,608,703.92	3.02
24	000002	万科A	186,824,178.26	2.93
25	000858	五粮液	184,999,698.07	2.90
26	000401	冀东水泥	177,622,601.87	2.79
27	600690	青岛海尔	176,753,910.56	2.77
28	601117	中国化学	174,489,821.97	2.74
29	600104	上汽集团	171,799,140.83	2.69
30	600216	浙江医药	163,225,735.51	2.56
31	000987	广州友谊	151,317,952.58	2.37
32	000568	泸州老窖	147,934,552.82	2.32
33	601101	昊华能源	143,715,832.94	2.25
34	000423	东阿阿胶	142,289,934.76	2.23
35	600252	中恒集团	136,495,922.17	2.14
36	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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	462,212,656.05	7.25
2	600970	中材国际	399,197,105.08	6.26
3	600585	海螺水泥	392,417,720.83	6.15
4	600104	上汽集团	374,407,163.59	5.87
5	601318	中国平安	354,923,477.30	5.57
6	600031	三一重工	309,587,613.96	4.86
7	000002	万科A	305,432,130.24	4.79
8	000983	西山煤电	299,346,884.97	4.69
9	600160	巨化股份	293,359,616.52	4.60
10	002024	苏宁电器	281,660,788.18	4.42
11	000157	中联重科	279,213,338.80	4.38
12	601601	中国太保	278,340,313.33	4.37
13	600741	华域汽车	270,527,590.24	4.24
14	601328	交通银行	254,334,404.37	3.99
15	600690	青岛海尔	253,354,678.15	3.97
16	000338	潍柴动力	252,057,212.91	3.95

17	601699	潞安环能	251,687,193.69	3.95
18	600015	华夏银行	236,569,109.75	3.71
19	000937	冀中能源	231,487,386.67	3.63
20	000024	招商地产	205,614,097.19	3.22
21	002008	大族激光	195,842,449.92	3.07
22	600252	中恒集团	194,956,470.80	3.06
23	600030	中信证券	194,746,127.98	3.05
24	601766	中国南车	192,666,246.00	3.02
25	002078	太阳纸业	187,677,695.80	2.94
26	600963	岳阳林纸	177,996,248.24	2.79
27	000401	冀东水泥	176,589,029.76	2.77
28	601166	兴业银行	170,293,901.61	2.67
29	601808	中海油服	166,328,425.30	2.61
30	000425	徐工机械	161,082,278.40	2.53
31	601101	昊华能源	156,913,239.56	2.46
32	601607	上海医药	154,893,393.91	2.43
33	600518	康美药业	149,311,284.21	2.34
34	000417	合肥百货	146,462,161.76	2.30
35	600729	重庆百货	141,887,857.56	2.23
36	601898	中煤能源	141,230,588.06	2.22
37	000527	美的电器	140,324,389.13	2.20
38	002001	新和成	135,933,341.75	2.13
39	601117	中国化学	131,872,010.32	2.07
40	000876	新希望	130,731,834.67	2.05
41	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,174,377,196.05
卖出股票收入（成交）总额	15,817,586,387.29

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	2,707,386.36
2	应收证券清算款	17,443,799.60
3	应收股利	-
4	应收利息	220,997.11
5	应收申购款	6,632.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,378,815.48

8.9.4 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的可转换债券。

8.9.5 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不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 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
286,493	20,052.32	9,609,193.74	0.17%	5,735,240,369.17	99.83%

9.2 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	0.48%
2	李喜仪	460,000.00	0.44%
3	刘丽芬	417,995.00	0.40%
4	张爱招	415,100.00	0.40%
5	陈圭锡	400,000.00	0.38%
6	李锡祥	400,000.00	0.38%
7	牟德武	387,465.00	0.37%
8	郭文飞	376,691.00	0.36%
9	王华安	365,946.00	0.35%
10	关少兰	317,200.00	0.30%

注：持有人为场内持有人。

9.3 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	2,521.45	0.0000%

§ 10 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	52,804,504.51
减：本报告期基金总赎回份额	613,488,207.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,744,849,562.91

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1、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。

2、基金管理人于 2012 年 1 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意蔡宝美女士辞去本公司副总经理一职。

3、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，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所已经连续 7 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 130,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	8,274,017,428.62	26.89%	7,032,900.27	27.38%	-
长城证券有限责任公司	2	4,525,991,550.92	14.71%	3,824,780.78	14.89%	-
海通证券股份有限公司	2	3,934,739,295.57	12.79%	3,271,672.66	12.74%	-
招商证券股份有限公司	2	2,826,305,679.21	9.18%	2,360,295.44	9.19%	-
中信建投证券股份有限公司	2	2,734,087,091.52	8.88%	2,228,062.15	8.68%	-
广发证券股份有限公司	1	2,337,307,188.99	7.59%	1,899,073.42	7.39%	-
中国国际金融有限公司	1	1,402,649,459.92	4.56%	1,139,660.87	4.44%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,384,471,042.67	4.50%	1,124,891.07	4.38%	-
长江证券股份有限公司	1	1,377,183,574.14	4.47%	1,118,971.34	4.36%	本期新增一个
英大证券有限责任公司	1	1,163,703,978.43	3.78%	989,145.49	3.85%	本期新增一个
中航证券有限公司	1	814,911,551.45	2.65%	692,672.26	2.70%	本期新增一个
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	59,264,019.80	100.00%	737,600,000.00	62.87%	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	435,600,000.00	37.13%	-	-
浙商证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定期定额投资优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 12 月 30 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行申购与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 年 12 月 29 日
3	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与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 年 12 月 29 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于继续参加深圳发展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 年 12 月 29 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增中信万通证券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 年 12 月 15 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增国海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 年 12 月 1 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在国海证券开通基金“定期定额投资业务”并参加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 年 12 月 1 日
8	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 11 月 30 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于开通汇付天下直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 11 月 3 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券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 年 11 月 3 日
11	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2011 年第 2 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 年 11 月 1 日
12	景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2011 年第三季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 10 月 24 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券网上	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 8 月 31 日

	交易申购费率优惠活动的公告		
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券开通基金“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年8月31日
15	景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF) 2011年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年8月24日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信金通证券开通基金“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年8月4日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金在长城证券开通基金“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年7月29日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国盛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年7月29日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增国盛证券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年7月29日
20	景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF) 2011年第二季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年7月20日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券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年7月13日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2011 年上半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年7月1日
23	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年6月29日
24	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年6月28日
25	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年6月28日
26	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年6月16日

27	景顺长城基金管理有限公司关于新增齐鲁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 年 6 月 2 日
28	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 年 6 月 2 日
29	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 年 6 月 2 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于开通直销网上交易“精明 i 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 年 5 月 28 日
31	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 年 5 月 19 日
32	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 年 5 月 6 日
33	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 年 5 月 6 日
34	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 年 4 月 28 日
35	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 年 4 月 28 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券网上交易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 年 4 月 28 日
37	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 年 4 月 23 日
38	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 年 4 月 22 日
39	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 年 4 月 11 日

40	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 年 4 月 11 日
41	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 年 4 月 9 日
42	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 4 月 7 日
43	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 年 3 月 30 日
44	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 年 3 月 28 日
45	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 年 3 月 24 日
46	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 年 3 月 24 日
47	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在天相投顾开通基金“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 年 3 月 9 日
48	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 年 3 月 8 日
49	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 年 2 月 24 日
50	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 年 2 月 22 日
51	景顺长城基金管理有限公司关于新增中信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 年 2 月 18 日
52	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 年 2 月 18 日
53	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 年 2 月 11 日
54	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	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 28 日

	构并开通基金转换业务的公告		
55	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在浙商证券开通基金“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 年 1 月 28 日
56	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 年 1 月 27 日
57	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 年 1 月 21 日
58	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 年 1 月 8 日
59	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 年 1 月 4 日

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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
2012 年 3 月 30 日