

# 景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)

## 2019年第1号更新招募说明书摘要

### 重要提示

(一)景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)由景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)变更而来。景顺长城鼎益混合型证券投资基金(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》)、《公开募集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》、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金(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。本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准,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)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)本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年3月16日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日。本招募说明书所载财务数据未经审计。

**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1座21层

设立日期：2003年6月12日

法定代表人：丁益

注册资本：1.3亿元人民币

批准设立文号：证监基金字[2003]76号

办公地址：深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第1座21层

电话：0755-82370388

客户服务电话：400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨崑阳

股东名称及出资比例：

序号	股东名称	出资比例
1	长城证券股份有限公司	49%
2	景顺资产管理有限公司	49%
3	开滦（集团）有限责任公司	1%
4	大连实德集团有限公司	1%
合计		100%

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

丁益女士，董事长，经济学博士。曾担任中国人民大学财政金融学院讲师；华能国际电力股份有限公司证券融资部干部，证券融资部投资关系处副处长、处长，证券融资部副经理兼投资关系处处长；中国人民保险公司投资管理部副总经理；中国人保资产管理有限公司党委委员、董事、总裁助理；华能资本常务副总经理（主持工作）、党组副书记；华能资本总经理、党组副书记。现任华能资本服务有限公司董事长、党组书记，景顺长城基金管理有限公司董事长。

康乐先生，董事，总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司董事兼总经理。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。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。现任景顺集团亚太区首席执行官。

李翔先生，董事，高级管理人員工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

伍同明先生，独立董事，文学学士。香港会计师公会会员（HKICPA）、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）。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]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。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。现任金杜律师事务所合伙人。

闵路浩先生，独立董事，经济学硕士。曾担任中国人民银行金融管理公司科员、主任科员；中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行业监督管理委员会非银行金融机构监管部处长、副巡视员、巡视员；中国小额贷款公司协会会长；重庆富民银行行长。现担任北京中泰创汇股权投资基金管理有限公司总裁。

## 2、基金管理人监事会成员

阮惠仙女士，监事，会计学硕士。现任长城证券股份有限公司财务部总经理。

郭慧娜女士，监事，管理理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生，监事，工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

丁益女士，董事长，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

CHEN WENYU（陈文字），副总经理，工商管理硕士。曾担任中国海口电视台每日新闻记者及每周金融新闻节目制作人，安盛罗森堡投资管理公司（美国加州）美洲区副首席投资官、以及研究、投资组合管理和策略等其他多个职位，安盛投资管理亚洲有限公司（新加坡）泛亚地区首席投资官，主要负责投资组合管理、研究、交易等相关业务。2018年9月加入本公司，现任公司副总经理。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部，担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

黎海威先生，副总经理，经济学硕士。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，现任公司副总经理。

赵代中先生，副总经理，理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏嘉川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事会境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副总经理。2016年3月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。曾担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、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

杨皞阳先生，督察长，法学硕士。曾担任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经理、总监助理。2008年10月加入本公司，现任公司督察长。

### 4、本基金现任基金经理简历

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。本基金现任的基金经理如下：

刘彦春先生，管理学硕士。曾担任汉唐证券研究员，香港中信投资研究有限公司研究员，博时基金研究员、基金经理助理、基金经理等职务。2015年1月加入本公司，自2015年4月起担任股票投资部基金经理，现任总经理助理兼研究部总监兼股票投资部基金经理。具有16年证券、基金行业从业经验。

#### 5、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刘彦春先生曾于2008年7月至2011年4月管理博时基金管理有限公司博时新兴成长股票型证券投资基金基金经理；2010年8月至2014年6月管理博时基金管理有限公司博时第三产业成长股票证券投资基金基金经理；2015年7月至2016年11月管理景顺长城动力平衡证券投资基金；2015年7月至2016年11月管理景顺长城优质成长股票型证券投资基金。

#### 6、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刘彦春先生兼任景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金和景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金基金经理。

#### 7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

基金经理姓名	管理时间
王新艳	2005年3月16日—2009年3月16日
涂强	2009年3月17日—2009年9月18日
张继荣	2009年9月19日—2015年7月9日
刘彦春	2015年7月10日—至今

#### 8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

康乐先生，总经理；

CHEN WENYU（陈文宇），副总经理；

毛从容女士，副总经理；

黎海威先生，副总经理兼量化及指数投资部投资总监；

余广先生，总经理助理兼股票投资部投资总监；

刘彦春先生，总经理助理兼研究部总监。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）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

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至2018年12月31日，中国银行已托管700只证券投资基金，其中境内基金662只，QDII基金38只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，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。



#### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人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，及时通知基金管理人，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，应当及时通知基金管理人，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

注册（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

法定代表人：丁益

批准设立文号：证监基金字[2003]76号

电话：(0755) 82370388-1663

传真：(0755) 22381325



联系人：周婷

客户服务电话：0755-82370688、4008888606

网 址：www.igwfm.com

注：直销机构包括本公司深圳直销中心及直销网上交易系统/电子交易直销前置式自助前台（具体以本公司官网列示为准）

## 2、场外销售机构：

序号	全称	销售机构信息
1	中国银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街1号 法定代表人：陈四清 联系人：宋亚平 客户服务电话：95566（全国） 网址：www.boc.cn
2	中国农业银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人：周慕冰 联系人：张伟 电话：010-85109219 传真：010-85109219 客户服务电话：95599 网址：www.abchina.com
3	中国工商银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街55号 法定代表人：易会满 客户服务电话：95588（全国） 网址：www.icbc.com.cn
4	中国建设银行股份有限公司	注册（办公）地址：北京市西城区金融大街25号 法定代表人：田国立 客户服务电话：95533 网址：www.ccb.com
5	交通银行股份有限公司	住所（办公）地址：上海市浦东新区银城中路188号 法定代表人：彭纯 联系人：王菁 电话：021-58781234-1601 传真：021-58408483 客户服务电话：95559 网址：www.bankcomm.com
6	招商银行股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道





		<p>7088 号            法定代表人：李建红            联系人：邓炯鹏            客户服务电话：95555            网址：www.cmbchina.com</p>
7	广发银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：广州市越秀区东风            东路 713 号            法定代表人：杨明生            客户服务电话：400 830 8003            网址：www.cgbchina.com.cn</p>
8	上海浦东发展银行股份有限公司	<p>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：吉晓辉            联系人：高天、于慧            电话：（021）61618888            传真：（021）63604199            客户服务热线：95528            公司网站：www.spdb.com.cn</p>
9	兴业银行股份有限公司	<p>注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦            法定代表人：高建平            联系人：陈丹            电话：（0591）87844211            客户服务电话：95561            网址：www.cib.com.cn</p>
10	中国民生银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内            大街 2 号            法定代表人：洪崎            联系人：穆婷            联系电话：010-58560666            传真：010-57092611            客户服务热线：95568            网址：www.cmbc.com.cn</p>
11	中信银行股份有限公司	<p>注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号            富华大厦 C 座            办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号            文化大厦            法定代表人：李庆萍            电话：010-89937369            传真：010-85230049            客户服务电话：95558            网址：www.bank.ecitic.com</p>
12	平安银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047            号深圳发展银行大厦            法定代表人：孙建一</p>



		<p>联系人：张莉 电话：021-38637673 传真：021-50979507 客户服务电话：95511—3 网址：www.bank.pingan.com</p>
13	浙商银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：中国杭州市庆春路 288 号 法定代表人：张达洋 电话：0571-87659546 传真：0571-87659188 联系人：毛真海 客户服务热线：95527 银行网址：www.czbank.com</p>
14	华夏银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街 22 号 法定代表人：吴建 联系人：马旭 联系电话：010-85238425 客户服务电话：95577 公司网址：www.hxb.com.cn</p>
15	南京银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：南京市中山路 288 号 法定代表人：林复 联系人：李冰洁 电话：025-86775317 传真：025-86775376 客户服务电话：40088-96400(全国)、96400（江苏） 网址：www.njcb.com.cn</p>
16	江苏江南农村商业银行股份有限公司	<p>注册（办公）地址：常州和平中路 413 号 法定代表人：陆向阳 联系人：蒋姣 电话：0519-80585939 传真：0519-89995017 客户服务电话：96005 网址：www.jnbank.com.cn</p>
17	长城证券股份有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层 法定代表人：曹宏 办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层 客户服务电话：4006666888 联系人：金夏 联系电话：0755-83516289 邮箱：jinxia@cgws.com</p>



		网址: <a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a>
18	广发证券股份有限公司	注册地址: 广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房) 办公地址: 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 法定代表人: 孙树明 联系人: 黄岚 电话: 020-87555888 传真: 020-87555305 客户服务电话: 95575 网址: <a href="http://www.gf.com.cn">www.gf.com.cn</a>
19	中国银河证券股份有限公司	办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层 法定代表人: 陈共炎 联系人: 辛国政 联系电话: 010-83574507 传真: 010-83574807 客服电话: 4008-888-888 或 95551 公司网址: <a href="http://www.chinastock.com.cn">www.chinastock.com.cn</a> 邮政编码: 100033
20	国泰君安证券股份有限公司	注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼 法定代表人: 杨德红 联系人: 芮敏祺 电话: 021-38676666 传真: 021-38670161 客户服务电话: 95521 网址: <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a>
21	中信建投证券股份有限公司	注册 (办公) 地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 法定代表人: 王常青 联系人: 许梦园 电话: (010) 85156398 传真: (010) 65182261 客户服务电话: 4008888108/95587 网址: <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a>
22	申万宏源证券有限公司	注册 (办公) 地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 法定代表人: 李梅 联系人: 曹晔



		<p>电话：021-33389888          传真：021-33388224          客户服务电话：95523 或 4008895523          网址：www.swhysc.com</p>
23	申万宏源西部证券有限公司	<p>注册（办公）地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室          法定代表人：李季          联系人：王君          电话：0991-7885083          传真：0991-2310927          客户服务电话：400-800-0562          网址：www.hysec.com</p>
24	招商证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：深圳市益田路江苏大厦38-45层          法定代表人：宫少林          联系人：黄婵君          电话：0755-82943666          传真：0755-83734343          客户服务电话：400-8888-111，95565          网址：www.newone.com.cn</p>
25	国都证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9号10层          联系人：黄静          电话：010-84183333          传真：010-84183311-3389          客服电话：400-818-8118          网址：www.guodu.com</p>
26	兴业证券股份有限公司	<p>注册地址：福州市湖东路268号          办公地址：上海市浦东新区长柳路36号          法定代表人：杨华辉          联系人：乔琳雪          联系电话：021-38565547          传真：0591-38507538          客户服务电话：95562          网址：www.xyzq.com.cn</p>
27	光大证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：上海市静安区新闻路1508号          法定代表人：周健男          联系人：郁疆          电话：021-22169999          传真：021-22169134          客户服务电话：95525、4008888788、10108998</p>



		网址: <a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>
28	海通证券股份有限公司	注册(办公)地址: 上海市广东路 689 号 法定代表人: 周杰 联系人: 李笑鸣 电话: 021-23219000 传真: 021-23219100 客服电话: 95553 网址: <a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
29	中银国际证券股份有限公司	注册(办公)地址: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼 法定代表人: 宁敏 联系人: 许慧琳 电话: 021-20328531 客户服务电话: 4006208888 网址: <a href="http://www.bocichina.com">www.bocichina.com</a>
30	安信证券股份有限公司	注册(办公)地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 法定代表人: 牛冠兴 联系人: 郑向溢 电话: 0755-82558038 传真: 0755-82558355 客户服务电话: 4008001001 网址: <a href="http://www.essence.com.cn">www.essence.com.cn</a>
31	国元证券有限责任公司	注册(办公)地址: 安徽省合肥市寿春路 179 号 法定代表人: 蔡咏 联系人: 李飞 电话: 0551-62246298 传真: 0551-62272108 客服电话: 全国统一热线 95578, 4008888777, 安徽省内热线 96888 网址: <a href="http://www.gyzq.com.cn">www.gyzq.com.cn</a>
32	平安证券股份有限公司	注册(办公)地址: 深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层 法人代表: 何之江 联系人: 王阳 电话: 021-38632136 传真: 021-33830395 客户服务电话: 95511-8 网址: <a href="http://stock.pingan.com">stock.pingan.com</a>
33	国信证券股份有限公司	注册(办公)地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层 法定代表人: 何如 联系人: 李颖



		<p>电话：0755-82130833          传真：0755-82133952          客户服务电话:95536          网址：www.guosen.com.cn</p>
34	中国国际金融股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层          法定代表人：丁学东          联系人：杨涵宇          电话：010-65051166          客户服务电话：400 910 1166          网址：www.cicc.com.cn</p>
35	方正证券股份有限公司	<p>注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层          办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼2701-3717          法定代表人：高利          联系人：胡创          电话：010-59355941          传真：010-56437013          客服热线：95571          网址：www.foundersc.com</p>
36	天相投资顾问有限公司	<p>注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701          办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层          法定代表人：林义相          联系人：尹伶          电话：010-66045529          传真：010-66045518          客服热线：010-66045678          网址：www.txsec.com</p>
37	西部证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：西安市东大街232号陕西信托大厦16-17层          法定代表人：刘建武          联系人：梁承华          电话：029-87406168          传真：029-87406710          客服热线：95582          网址：www.westsecu.com.cn</p>
38	华宝证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57层          法定代表人：陈林          联系人：刘闻川          电话：021-68778808</p>



		<p>传真：021-68778108          客户服务电话:4008209898          网址：www.cnhbstock.com</p>
39	爱建证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：上海市南京西路 758 号 24 楼          法定代表人：宫龙云          联系人：陈敏          电话：021-32229888          传真：021-68728703          客服热线：021-63340678          网址：www.ajzq.com</p>
40	华福证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层          法定代表人：黄金琳          联系人：张腾          电话：0591-87383623          传真：0591-87383610          客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）          网址：www.hfq.com.cn</p>
41	信达证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼          法定代表人：张志刚          联系人：唐静          电话：010-63081000          传真：010-63080978          客服热线：95321          网址：www.cindasc.com</p>
42	英大证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层          法定代表人：吴骏          联系人：杨洪飞          电话：0755-83007323          传真：0755-83007034          客服热线：4000 188 688          网址：www.ydsc.com.cn</p>
43	华泰证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：江苏省南京市江东中路 228 号          法定代表人：周易          联系人：庞晓芸          电话：0755-82492193          客户服务电话：95597          网址：www.htsc.com.cn</p>
44	华龙证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：兰州市城关区东岗西路</p>





		<p>638 号兰州财富中心          法定代表人：李晓安          联系人：李昕田          电话：0931-4890208          客户服务电话：0931-96668，4006898888          网址：www.hlzqgs.com</p>
45	国金证券股份有限公司	<p>注册地址：成都市东城根上街 95 号          办公地址：成都市东城根上街 95 号          法定代表人：冉云          联系人：刘婧漪、贾鹏          电话：028-86690057、02886690058          传真：028-86690126          客服电话：95310          公司网站：www.gjzq.com.cn</p>
46	浙商证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：浙江杭州市杭大路 1 号          黄龙世纪广场 A-6/7 楼          法定代表人：吴承根          联系人：许嘉行          客服电话：0571-967777          网址：www.stocke.com.cn</p>
47	中航证券有限公司	<p>注册（办公）地址：南昌市红谷滩新区红谷          中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼          法定代表人：杜航          联系人：戴蕾          联系电话：0791-86768681          客户服务电话：400-8866-567          公司网址：www.avicsec.com</p>
48	中信证券股份有限公司	<p>注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8          号卓越时代广场（二期）北座          办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中          信证券大厦          法定代表人：张佑君          联系人：王一通          电话：010-60838888          传真：010-60833739          客服电话：95548          网址：www.cs.ecitic.com</p>
49	中国中投证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：深圳市福田区益田路与          福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21          层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、          13、15、16、18、19、20、21、22、23 单          元          联系人：刘毅          联系电话：0755-82023442</p>



		<p>传真：0755-82026539          客服电话：400 600 8008          网址：www.china-invs.cn</p>
50	长江证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦          法定代表人：杨泽柱          联系人：奚博宇          电话：027-65799999          传真：027-85481900          客户服务电话：95579 或 4008-888-999          网址：www.95579.com</p>
51	东莞证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：东莞市莞城区可园南路一号          法定代表人：张运勇          联系人：张巧玲          电话：0769-22116572          传真：0769-22119426          客户服务电话：-95328          网址：www.dgzq.com.cn</p>
52	东方证券股份有限公司	<p>法定代表人：潘鑫军          注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层          办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层          联系人：胡月茹          电话：021-63325888          传真：021-63326729          客户服务热线：95503          公司网站：http://www.dfzq.com.cn</p>
53	中泰证券股份有限公司	<p>注册（办公）地址：济南市市中区经七路 86 号          法定代表人：李玮          联系人：许曼华          电话：021-20315290          传真：021-20315125          客户服务电话：95538          网址：www.zts.com.cn</p>
54	国盛证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼          法定代表人：徐丽峰          联系人：占文驰          电话：0791-86283372          传真：0791-86281305          客户服务电话：400 8222 111</p>



		网址： <a href="http://www.gszq.com">www.gszq.com</a>
55	国海证券股份有限公司	注册地址：广西桂林市辅星路13号 办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼 法定代表人：张雅锋 联系人：牛孟宇 联系电话：0755-83709350 传真：0755-83700205 客户服务电话：95563 公司网址： <a href="http://www.ghzq.com.cn">www.ghzq.com.cn</a>
56	中信证券（山东）有限责任公司	注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 法定代表人：姜晓林 联系人：刘晓明 联系电话：0531-89606165 传真：0532-85022605 客户服务电话：95548 网址： <a href="http://www.zxwt.com.cn">www.zxwt.com.cn</a>
57	西南证券股份有限公司	注册（办公）地址：重庆市江北区桥北苑8号 法定代表人：吴坚 联系人：张煜 电话：023-63786141 传真：023-63786212 客服电话：400 809 6096 公司网站： <a href="http://www.swsc.com.cn">www.swsc.com.cn</a>
58	东海证券股份有限公司	注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层 办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人：赵俊 电话：021-20333333 传真：021-50498825 联系人：王一彦 客服电话：95531；400-8888-588 网址： <a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>
59	第一创业证券股份有限公司	注册（办公）地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼 法定代表人：刘学民 联系人：毛诗莉 电话：0755-23838750 传真：0755-23838750 客服电话：400-888-1888 网址： <a href="http://www.fcsc.com">www.fcsc.com</a>



60	川财证券有限责任公司	<p>注册（办公）地址：成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17层          法定代表人：孟建军          联系人：匡婷          电话：028-86583053          传真：028-86583053          客户服务电话：028-95105118          公司网址：<a href="http://www.cczq.com">http://www.cczq.com</a></p>
61	天风证券股份有限公司	<p>注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼          办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼          法定代表人：余磊          联系人：崔成          电话：027-87610052          传真：027-87618863          客户服务电话：4008005000          网址：<a href="http://www.tfzq.com">www.tfzq.com</a></p>
62	中信期货有限公司	<p>注册（办公）地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层          法定代表人：张皓          联系人：洪诚          电话：0755-23953913          传真：0755-83217421          客户服务电话：400-990-8826          网址：<a href="http://www.citicsf.com">www.citicsf.com</a></p>
63	上海证券有限责任公司	<p>注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼          办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼          法定代表人：李俊杰          联系人：邵珍珍          电话：021-53686888          传真：021-53686100-7008, 021-53686200-7008          客户服务热线：4008918918</p>
64	开源证券股份有限公司	<p>注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层          办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层          法定代表人：李刚          联系人：黄芳          电话：029-63387256</p>



		<p>传真：029-81887256          客户服务电话：400-860-8866 或 95325          网址：www.kysec.cn</p>
65	中国民族证券有限责任公司	<p>注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼          办公地址：北京市朝阳区五北四环中路盘古大观 A 座 40—43F          法定代表人：何亚刚          联系人：齐冬妮          电话：010-59355807/13811475559          传真：010-56437013          客户服务电话：4008895618          网址：http://www.e5618.com</p>
66	华鑫证券有限责任公司	<p>注册(办公)地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元          法定代表人：俞洋          联系人：朱泽乾          电话：021-54967367          传真：021-54967032          客户服务电话：95323, 4001099918 (全国)          021-32109999; 029-68918888          网址：www.cfsc.com.cn</p>
67	财通证券股份有限公司	<p>注册(办公)地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201、501、502、1103、1601-1615、1701-1716          法定代表人：陆建强          客户服务电话：95336、4008696336          网址：www.ctsec.com</p>
68	广州证券股份有限公司	<p>注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层          办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层          法定代表人：胡伏云          联系人：梁微          电话：020-88836999          传真：020-88836984          客户服务电话：95396          网址：www.gzs.com.cn</p>
69	蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	<p>注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室          办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F          法定代表人：陈柏青          联系人：韩爱彬</p>



		<p>电话：021-60897840          传真：0571-26697013          客户服务电话：4000-766-123          网址：www.fund123.cn</p>
70	上海好买基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 4494          办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼          法定代表人：杨文斌          联系人：张茹          电话：021-58870011          传真：021-68596916          客户服务电话：400 700 9665          网址：www.ehowbuy.com</p>
71	上海天天基金销售有限公司	<p>注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号东方财富大厦 2 楼          办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层          法定代表人：其实          联系人：潘世友          电话：021-54509977-8400          传真：021-54509953          客服电话：400-1818-188          网址：http://www.1234567.com.cn</p>
72	腾安基金销售（深圳）有限公司	<p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）          办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼          法定代表人：刘明军          联系人：谭广锋          电话：95017 转 1 转 8          客户服务电话：95017 转 1 转 8          网址：www.tenganxinxi.com</p>
73	北京百度百盈基金销售有限公司	<p>注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101          办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦          法定代表人：张旭阳          联系人：孙博超          电话：010-61952703          传真：010-61951007          客户服务电话：95055          网址：www.baiyingfund.com</p>

基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

### 3、场内销售机构

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：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：（010）59378856

传真：（010）59378907

联系人：崔巍

#### （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

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：（010）58153000



传真：（010）85188298

经办注册会计师：吴翠蓉、高鹤

联系人：吴翠蓉

## 四、基金的名称

景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

## 五、基金的类型

上市契约型开放式

## 六、基金的投资目标

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。

## 七、基金的投资方向

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

## 八、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公司投资的重大问题，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。一旦做出决议，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) 投资研究部是负责管理基金日常投资活动的具体部门，分管投资的副总经理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研究部的日常运作。投资研究联席会议是投资研究部常设议事机构，负责讨论行业信息、个股信息、回顾行业表现、行业配置、模拟组合表现、近期研究计划及成果、市场热点、当日投资决策、代行表决权、投资备选库调整等问题。投资研究部主要负责宏观经济研究、行业研究和投资品种研究，负责编制、维护投资备选库，建立、完善、管理并维护股票研究数据库与债券研究资料库，并为投资决策委员会、投资研究联席会议、分管投资的副总经理、各投资总监和基金经理提供基金投资决策依据。投资研究部负责根据投资决策委员会决议，负责基金投资组合的构造、优化、风险管理及头寸管理等日常工作；拟订基金的总体投资策略、资产配置方案、重大投资项目提案和投资组合方案等并上报投资决策委员会讨论决定；组织实施投资决策委员会及投资研究联席会议决定的投资方案并在授权范围内作出投资决定；依据自主的研究积极把握市场动态，积极提出基金投资组合优化方案，并对管理基金的投资业绩负责。其中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本基金的日常管理工作。

(iii) 风险管理委员会是公司日常经营中整体风险控制的决策机构，该委员会是对公司各种风险的识别、防范和控制的非常设机构，由总经理、副总经理、督察长、以及其他相关部门负责人或相关人员组成，其主要职责是：负责评估公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；对公司重大业务可行性及风险进行论证；负责组织公司内部员工严重违法违规事件的调查，并根据调查报告做出具体的决定；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施；其他风险管理职能。绩效评估与风险控制人员负责建立和完善投资风险管理系

统，并负责对基金历史业绩进行分解和分析。法律、监察稽核部负责基金日常运作的合规控制。

(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投资研究部从景顺长城股票研究数据库（SRD）中精选个股，由基金经理依据本基金的投资目标、投资策略、投资限制以及资产配置方案，制订具体的投资组合方案；

④投资决策委员会审核重大基金投资组合方案，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混合型基金，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

### （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。

## 九、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=沪深 300 指数×80%+银行同业存款利率×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混合型基金，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）关于以沪深 300 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：沪深 300 指数编制方法明确，能为市场普遍接受。

（ii）透明性：沪深 300 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：沪深 300 指数具有良好的市场代表性。

（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、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。

# 十一、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。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 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	2,618,542,512.61	92.11
	其中：股票	2,618,542,512.61	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	221,708,177.11	7.80
8	其他资产	2,610,409.41	0.09
9	合计	2,842,861,099.13	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	394,050,000.00	13.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,224,442,366.81	78.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-



H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,618,542,512.61	92.34

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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	002311	海大集团	11,830,000	274,101,100.00	9.67
2	603899	晨光文具	8,884,604	268,759,271.00	9.48
3	300498	温氏股份	10,000,000	261,800,000.00	9.23
4	600519	贵州茅台	410,414	242,148,364.14	8.54
5	000651	格力电器	6,273,300	223,894,077.00	7.90
6	000568	泸州老窖	5,342,000	217,205,720.00	7.66
7	600566	济川药业	6,399,983	214,591,429.99	7.57
8	002304	洋河股份	1,900,000	179,968,000.00	6.35
9	000418	小天鹅A	3,789,800	163,908,850.00	5.78
10	000596	古井贡酒	2,900,000	156,484,000.00	5.52



#### **4. 报告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。

#### **5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **6. 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资产支持证券投资 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序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### **8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

#### **9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

##### **9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### **9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

#### **10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

## 10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11. 投资组合报告附注

### 11.1

1. 湖北济川药业股份有限公司（以下简称“济川药业”，股票代码：600566）全资子公司济川药业集团有限公司（以下简称“济川有限”）收到泰州市环境保护局出具的《泰州市环境保护局行政处罚决定书》（泰环罚字【2018】2-335号）。因济川有限开发区分厂污水处理设施尾气非甲烷总烃排放浓度均值超标0.08倍；中药车间两套乙醇回收装置的不凝性尾气（主要成份乙醇）经收集后未使用污染防治设施直接高空排放；两个车间出渣室含挥发性有机物废气（主要成份乙醇）也未收集处理等问题，济川有限上述行为违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条和第四十五条的规定，构成未采取有效措施防治含挥发性有机物废气、废气超标排放的违法行为。鉴于济川有限积极改正环境违法行为，且情节轻微，根据相关规定中关于从轻行政处罚的情形，泰州环保局作出对济川有限未采取有效措施防治含挥发性有机物废气的行为罚款8万元，对废气超标排放的行为罚款10万元的处罚决定。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对济川药业进行了投资。

2. 其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

## 11.2

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。

## 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	270,587.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,676.92
5	应收申购款	2,296,144.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,610,409.41

## 11.4 报告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。

## 11.5 报告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的情况。

## 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。



## 十二、基金的业绩

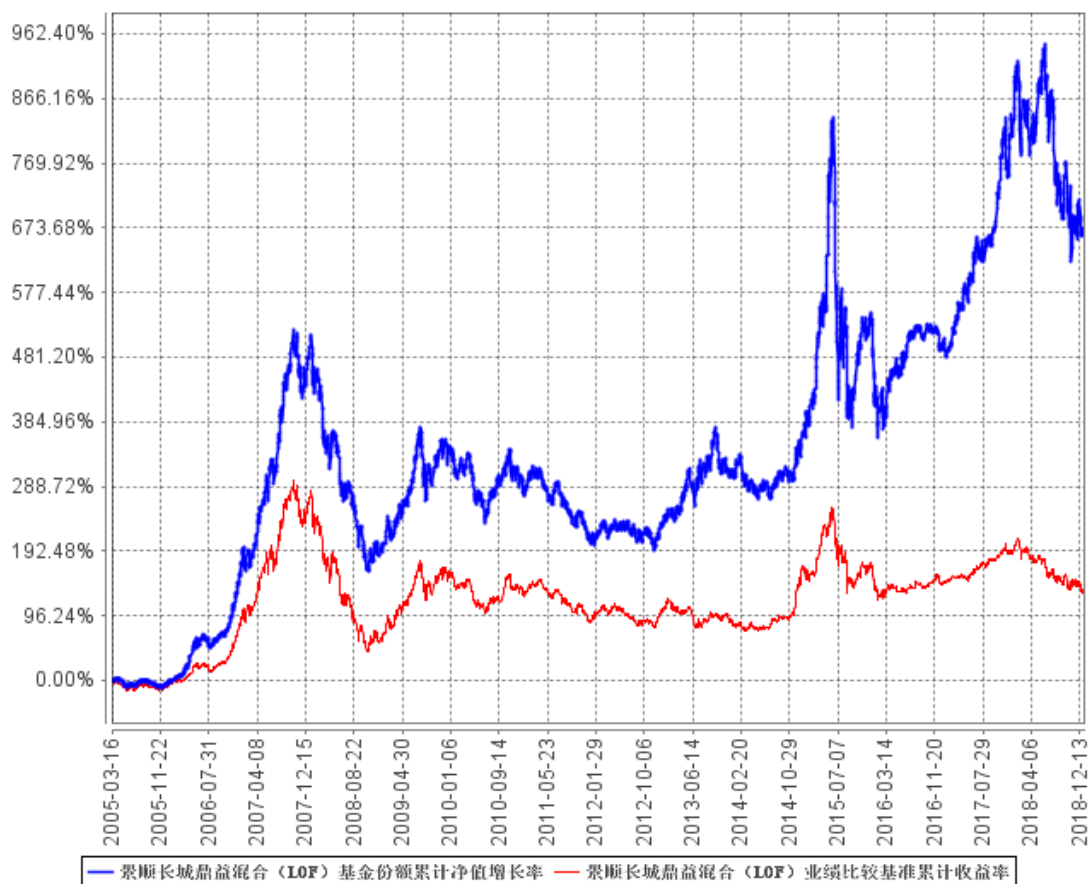
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 12 月 31 日。

### 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%
2009 年	57.50%	1.68%	68.32%	1.63%	-10.82%	0.05%
2010 年	-10.85%	1.42%	-10.21%	1.24%	-0.64%	0.18%
2011 年	-21.66%	1.07%	-19.47%	1.03%	-2.19%	0.04%
2012 年	6.69%	1.08%	7.82%	1.00%	-1.13%	0.08%
2013 年	23.31%	1.59%	-6.91%	1.12%	30.22%	0.47%
2014 年	10.46%	1.18%	38.10%	0.99%	-27.64%	0.19%
2015 年	37.97%	2.82%	2.21%	1.98%	35.76%	0.84%
2016 年	-5.06%	1.63%	-9.18%	1.06%	4.12%	0.57%
2017 年	55.52%	1.05%	19.43%	0.51%	36.09%	0.54%
2018 年	-16.77%	1.68%	-20.42%	1.07%	3.65%	0.61%
2005 年 3 月 16 日 -2018 年 12 月 31 日	673.17%	1.61%	131.93%	1.38%	541.24%	0.23%

### 2. 本基金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。自 2017 年 9 月 6 日起，本基金业绩比较基准由“富时中国 A200 指数×80%+同业存款利率×20%”调整为“沪深 300 指数×80%+银行同业存款利率×20%”。

## 十三、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 $\leq$ M<1000 万	1.0%
M $\geq$ 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
7 日以内	1.5%
7 日以上（含）—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。

（2）本基金的场内赎回费率为：

持有期	赎回费率
7 日以内	1.5%
7 日以上（含）	0.5%

对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对持续持有期不少于 7 日的投资者所收取的赎回费中不低于 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 1.5%，随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
7 日以内	1.5%
7 日以上（含）—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“定期定额投资计划”终止后，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。若投资者重新开始“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。本基金后端收费方式定期定额投资计划的终止和期数的计算由本公司根据投资者每期定期定额投资计划的确认日期而确定。

③对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。对持续持有期不少于 7 日的投资者所收取的赎回费中不低于 25%的部分归入基金财产。

(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：**

$$\text{申购份额} = 600 / 1.012 = 592.89 \text{ 份}$$

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%

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

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

$$\text{赎回净金额} = 1168 - 2.92 = 1165.08 \text{ 元}$$

**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（ $407.11 \times 1.021$ ）。

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

$$1 \text{ 期后端申购费用} = 600 - 594.06 = 5.94 \text{ 元}$$

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

$$2 \text{ 期后端申购费用} = 415.66 - 411.54 = 4.12 \text{ 元}$$

(ii) 赎回金额：

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

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

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

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

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

## 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。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

1、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人法定代表人、董事会成员、高级管理人员、投资决策委员会委员、基金经理的相关信息；

2、在“四、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构的相关信息；

4、在“七、基金份额的申购和赎回”部分，更新了基金赎回费的信息及基金定期定额投资计划相关的信息；

5、在“十、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告，数据截至 2018 年 12 月 31



日；

6、更新了“十二、基金的业绩”部分，数据截至 2018 年 12 月 31 日；

7、在“二十四、其它应披露事项”部分，更新了近期发布的与本基金有关的公告目录，目录更新至 2019 年 3 月 16 日。

景顺长城基金管理有限公司

二〇一九年四月三十日