

景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

2010 年年度报告

2010 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十八日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 24 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司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 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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.....	10
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.....	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、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	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任	15
6.3	审计意见	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	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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	43
8.7	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	43
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	43

8.9	投资组合报告附注	44
§9	基金份额持有人信息	44
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
9.2	期末上市基金前十名持有人.....	44
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.....	45
§10	开放式基金份额变动	45
§11	重大事件揭示	45
11.1	基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	46
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
11.4	基金投资策略的改变	46
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
11.8	其他重大事件	49
§12	备查文件目录	53
12.1	备查文件目录	53
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	景顺长城资源垄断股票（LOF）
基金主代码	162607
交易代码	162607
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 1 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,859,558,235.60 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	2006 年 4 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，重点投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。从业务价值、估值、管理能力、自由现金流量与分红政策四个方面结合必要的合理性分析对上市公司的品质和估值水平进行鉴别，选择目标股票构建组合。债券投资部分着重本金安全性和流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=富时中国 A200 指数×80%+中国债券总指数×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度较高的投资品种

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“景顺资源”；

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%+中国债券总指数×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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	李芳菲
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-63201816
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	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		赵如冰	项俊波

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	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	428,654,560.07	189,579,576.23	-3,117,534,446.86
本期利润	-124,507,698.04	4,562,724,183.16	-8,299,973,940.75
加权平均基金份额本期利润	-0.012	0.386	-0.644
本期加权平均净值利润率	-1.45%	51.26%	-83.59%
本期基金份额净值增长率	-0.96%	73.17%	-55.38%

3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	2,036,640,581.63	1,961,389,532.39	1,043,290,102.45
期末可供分配基金份额利润	0.207	0.178	0.084
期末基金资产净值	8,607,046,173.34	9,860,185,347.78	6,452,657,214.72
期末基金份额净值	0.873	0.897	0.518
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	233.31%	236.53%	94.34%

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

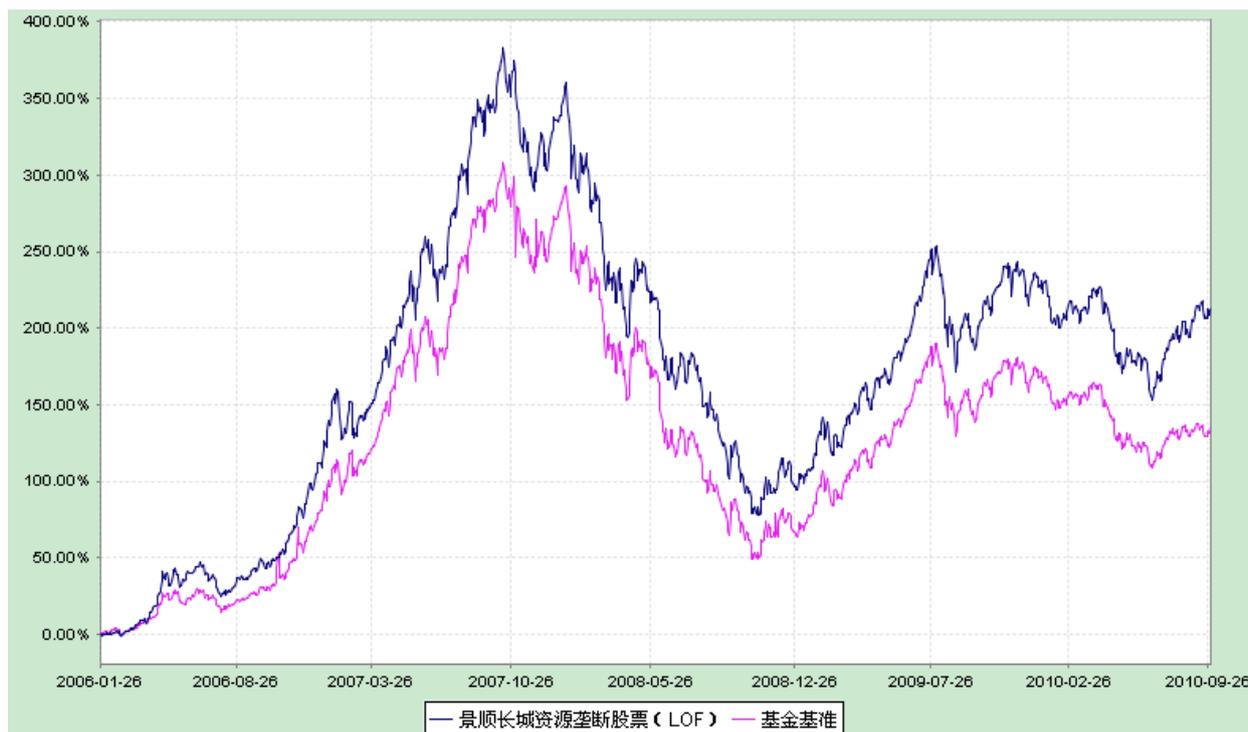
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.46%	1.52%	5.22%	1.39%	1.24%	0.13%
过去六个月	27.82%	1.39%	16.53%	1.20%	11.29%	0.19%
过去一年	-0.96%	1.40%	-10.00%	1.24%	9.04%	0.16%
过去三年	-23.48%	1.85%	-33.37%	1.84%	9.89%	0.01%
自基金合同生效起至今	233.31%	1.80%	147.44%	1.73%	85.87%	0.07%

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

景顺长城资源垄断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

（2006年1月26日至2010年12月31日）

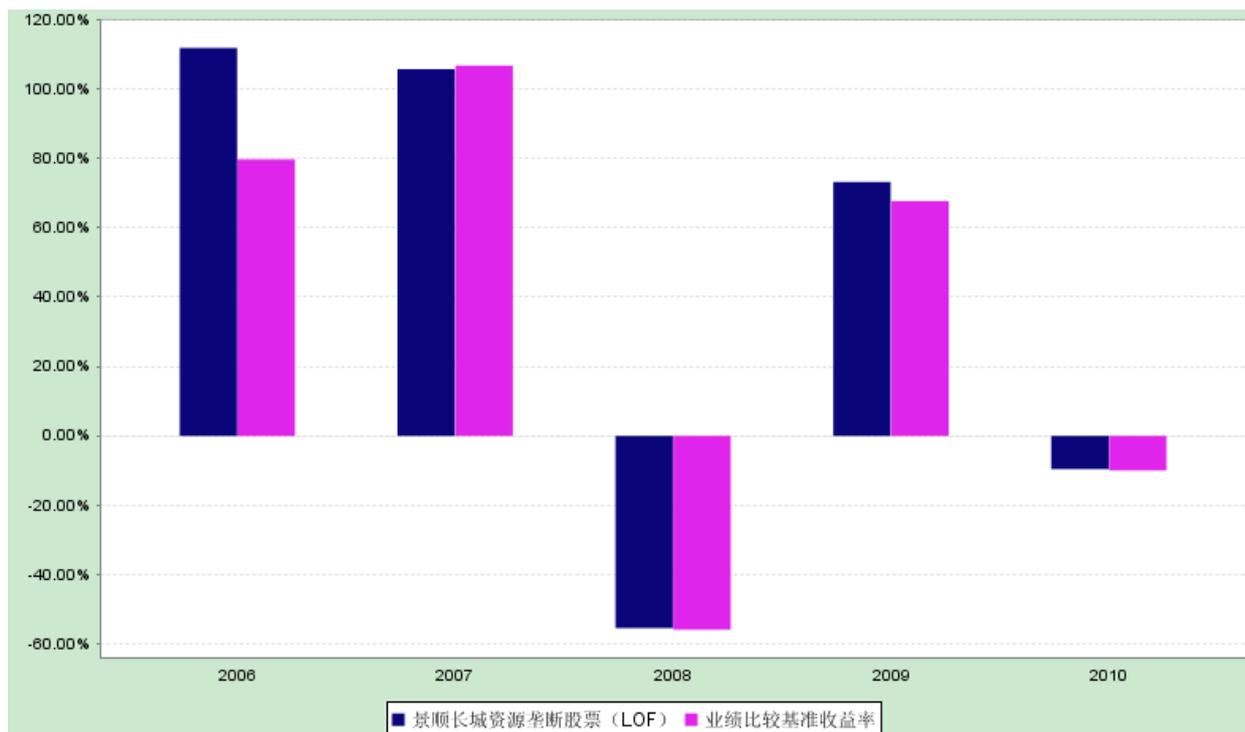


注：本基金的资产配置比例为：对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于具有自然资源优势以及垄断优势的优秀上市公司的股票比例至少高于股票投资的 80%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2006 年 1 月 26 日合同生效日起至 2006 年 4 月 25 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.2.3 合同生效日以来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

景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：2006年基金净值增长率和业绩基准收益率的实际计算期间是从2006年1月26日（基金合同生效日）至2006年12月31日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.150	96,448,626.73	64,228,821.96	160,677,448.69	一次分红
2009年	-	-	-	-	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	0.150	96,448,626.73	64,228,821.96	160,677,448.69	-

§ 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 2010 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。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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晖	本基金基金经理，投资副总监	2006-12-14	-	8	中国人民大学经济学学士、英国爱丁堡大学工商管理硕士。曾任职于国信证券，担任理财部行业研究员、投资经理；2005 年 1 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、陈晖任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金代理基金经理的起始时间为：2009 年 9 月 30 日至 2010 年 1 月 20 日。

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、《景顺长城资源垄断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，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

经过 2009 年指数大幅上涨后，在 2010 年宏观经济全年相对平稳的背景下，市场走出了全年震荡的行情，市场主要指数全年小幅下跌。2010 年市场主要表现为突出的结构性行情，新兴产业、大消费行业表现远超以金融地产为代表的传统行业。本基金管理人在 1 季度对传统产业的估值下修估计不够充分，维持了相对较高的仓位，没有较好规避市场下跌的风险；2 季度本基金抓住市场调整的机会，加大了新兴产业的配置比例，在随后的市场上涨中取得较好收益；3、4 季度本基金结合估值情况，减持了组合中部分达到目标价格的小市值企业，年底逐步加仓买入调整充分、价值低估的金融地产等周期类行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.873 元，本报告期份额净值增长率为-0.96%，同期业绩比较基准收益率为-10.00%，高于业绩基准 9.04%。

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，在经济相对平稳后，经济结构转型和科学发展仍将被摆到很重要的位置，对中国经济增长方式将产生深远的影响；同时，针对前两年过度宽松的货币政策而采取的适度收缩，也成为市场担心的一个问题。通胀将成为 2011 年内最大的不确定因素之一。

由于 2010 年市场对中国经济结构转型预期的激烈反应，市场对新兴产业以及部分消费产业给予了

很高的估值；相反，对一些传统产业的估值压得过低，造成了市场上阶段性出现了较突出的估值结构的矛盾。事实上，这种矛盾也为下一阶段的行情指示了风险和机会。

落实到投资上，2011 年的重点投资机会仍将出现在国家支持的新兴产业、区域经济振兴、出口继续复苏、消费的稳定增长、以及一些稳定增长但价值被低估的传统行业上。操作上，本基金将继续坚持“自下而上”的投资原则，加强个股研究和公司调研，主要投资于具有资源垄断优势的企业；同时，努力把握不同的机会，在波动的市场环境中，增加操作的前瞻性和灵活性，争取更好的收益。

珍惜基金份额持有人的每一份信任，本基金将继续奉行景顺长城基金管理有限公司“宁取细水长流，不要惊涛裂岸”的投资理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期稳定的增值。

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，本基金管理人继续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，进一步加强了对员工的合规教育，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、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

1、根据基金合同约定，本基金本报告期应分配金额为不少于 214,327,280.04 元。

2、基金本报告期实施了一次利润分配。权益登记日为 2010 年 4 月 12 日，每 10 份基金份额派发现金红利 0.15 元，本年度利润分配金额为 160,677,448.69 元。

3、本基金本期已实现收益为 428,654,560.07 元；截止本报告期末，本基金可供分配利润为 2,036,640,581.63 元，本基金的基金管理人已于 2011 年 1 月 12 日完成权益登记，每 10 份基金份额派发现金红利 0.25 元，详细信息请查阅相关分红公告。

§ 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

在托管景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）基金合同》、《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）托管协议》的约定，对景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)管理人—景顺长城基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010

年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20200 号

景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“景顺长城资源垄断基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是景顺长城资源垄断基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2)选择和运用恰当的会计政策；

(3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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。

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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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管理层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。

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。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了景顺长城资源垄断基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 陈宇 陈清

上海市湖滨路 202 号普华永道中心

11 楼

2011-03-24

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2010年12月31日	2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	957,875,930.98	1,293,379,226.87
结算备付金		18,202,778.56	13,098,979.34
存出保证金		9,691,238.50	11,039,521.28
交易性金融资产	7.4.7.2	7,829,679,855.30	8,588,391,808.38
其中：股票投资		7,810,230,467.10	8,588,391,808.38
基金投资		-	-
债券投资		19,449,388.20	-
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	-	-
应收证券清算款		21,347,435.95	1,508,965.31
应收利息	7.4.7.5	228,464.51	248,357.83
应收股利		-	-
应收申购款		292,713.47	191,388.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,837,318,417.27	9,907,858,247.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		199,499,517.85	13,695,322.21
应付赎回款		6,149,691.18	11,097,748.79
应付管理人报酬		11,093,278.51	12,482,262.64
应付托管费		1,848,879.75	2,080,377.11
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,996,120.49	6,874,539.63
应交税费		19,054.30	19,054.30
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,665,701.85	1,423,594.90
负债合计		230,272,243.93	47,672,899.58
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,283,716,774.95	4,777,158,129.32
未分配利润	7.4.7.10	4,323,329,398.39	5,083,027,218.46
所有者权益合计		8,607,046,173.34	9,860,185,347.78
负债和所有者权益总计		8,837,318,417.27	9,907,858,247.36

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.873 元，基金份额总额 9,859,558,235.60 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
一、收入		103,849,657.77	4,784,084,169.84
1.利息收入		8,605,824.30	22,257,211.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	8,573,953.26	8,049,784.63
债券利息收入		31,871.04	14,207,426.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		648,210,323.96	387,727,752.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	597,775,530.38	303,876,525.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	935,721.30	21,492,614.68
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	49,499,072.28	62,358,612.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-553,162,258.11	4,373,144,606.93
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	195,767.62	954,599.10
减：二、费用		228,357,355.81	221,359,986.68
1. 管理人报酬		128,868,588.26	132,462,078.94
2. 托管费		21,478,098.04	22,077,013.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	77,448,125.62	66,260,484.03
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	562,543.89	560,410.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-124,507,698.04	4,562,724,183.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填		-124,507,698.04	4,562,724,183.16

列)			
----	--	--	--

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	4,777,158,129.32	5,083,027,218.46	9,860,185,347.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-124,507,698.04	-124,507,698.04
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）	-493,441,354.37	-474,512,673.34	-967,954,027.71
其中：1.基金申购款	81,573,749.53	73,588,398.66	155,162,148.19
2.基金赎回款	-575,015,103.90	-548,101,072.00	-1,123,116,175.90
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）	-	-160,677,448.69	-160,677,448.69
五、期末所有者权益（基金净值）	4,283,716,774.95	4,323,329,398.39	8,607,046,173.34
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	5,409,367,112.27	1,043,290,102.45	6,452,657,214.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,562,724,183.16	4,562,724,183.16
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）	-632,208,982.95	-522,987,067.15	-1,155,196,050.10
其中：1.基金申购款	159,751,075.80	135,530,978.11	295,282,053.91
2.基金赎回款	-791,960,058.75	-658,518,045.26	-1,450,478,104.01
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）	4,777,158,129.32	5,083,027,218.46	9,860,185,347.78

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)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]第 179 号《关于同意景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,154,861,946.80 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 8 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2006 年 1 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,155,234,378.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 372,432.12 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2006]第 24 号文审核同意,本基金 18,634,653.00 份基金份额于 2006 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)招募说明书》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于 2007 年 7 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.301455159,并于 2007 年 7 月 27 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金主要投资于股票类资产,股票投资的比例不少于基金资产净值的 65%,持有现金或者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%。本基金业绩比较基准为:富时中国 A200 指数(原名为新华富时 200 指数) \times 80%+中国债券总指数 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2011 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布

的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已

转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现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实现损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变

动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

(1)重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a)对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

(b)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	957,875,930.98	1,293,379,226.87
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	957,875,930.98	1,293,379,226.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,593,396,802.89	7,810,230,467.10	216,833,664.21
债券	交易所市场	16,463,000.00	19,449,388.20	2,986,388.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,463,000.00	19,449,388.20	2,986,388.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		7,609,859,802.89	7,829,679,855.30	219,820,052.41
项目		上年度末 2009年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,815,409,497.86	8,588,391,808.38	772,982,310.52
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		7,815,409,497.86	8,588,391,808.38	772,982,310.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末和上年度末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

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

本基金本期末和上年度末的买入返售金融资产项目余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末和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 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	199,840.05	243,602.91
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	6,371.00	4,608.01
应收债券利息	22,191.22	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	62.24	146.91
其他	-	-

合计	228,464.51	248,357.83
----	------------	------------

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末和上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,996,120.49	6,874,539.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	9,996,120.49	6,874,539.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,250,000.00
应付赎回费	1,201.85	9,094.90
预提费用	164,500.00	164,500.00
合计	1,665,701.85	1,423,594.90

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,995,207,933.27	4,777,158,129.32
本期申购	187,792,442.62	81,573,749.53
本期赎回(以“-”号填列)	-1,323,442,140.29	-575,015,103.90
本期末	9,859,558,235.60	4,283,716,774.95

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 截至2010年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为274,996,987.00份(2009年12月31日：347,868,308.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为9,584,561,248.60份(2009年12月31日：10,647,339,625.27份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	1,961,389,532.39	3,121,637,686.07	5,083,027,218.46
本期利润	428,654,560.07	-553,162,258.11	-124,507,698.04
本期基金份额交易产生的变动数	-192,726,062.14	-281,786,611.20	-474,512,673.34
其中：基金申购款	31,367,725.17	42,220,673.49	73,588,398.66
基金赎回款	-224,093,787.31	-324,007,284.69	-548,101,072.00
本期已分配利润	-160,677,448.69	-	-160,677,448.69
本期末	2,036,640,581.63	2,286,688,816.76	4,323,329,398.39

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	8,311,883.47	7,831,959.77
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	259,439.57	208,697.67
其他	2,630.22	9,127.19
合计	8,573,953.26	8,049,784.63

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	25,841,563,771.33	22,103,815,015.77
减：卖出股票成本总额	25,243,788,240.95	21,799,938,490.09
买卖股票差价收入	597,775,530.38	303,876,525.68

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,109,401.12	640,442,629.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,164,000.00	606,528,135.75
减：应收利息总额	9,679.82	12,421,879.29
债券投资收益	935,721.30	21,492,614.68

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 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
股票投资产生的股利收益	49,499,072.28	62,358,612.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	49,499,072.28	62,358,612.02

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
1.交易性金融资产	-553,162,258.11	4,373,144,606.93
——股票投资	-556,148,646.31	4,407,862,195.04
——债券投资	2,986,388.20	-34,717,588.11
——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	-553,162,258.11	4,373,144,606.93

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	194,673.51	895,993.21
印花税手续费返还	1,094.11	51,127.90
其他	-	7,477.99
合计	195,767.62	954,599.10

注：本基金场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	77,448,125.62	66,258,084.03
银行间市场交易费用	-	2,400.00

合计	77,448,125.62	66,260,484.03
----	---------------	---------------

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	160,000.00	160,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	100.00	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	24,443.89	22,410.59
上市月费	60,000.00	60,000.00
合计	562,543.89	560,410.59

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

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 10 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 12 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.250 元。

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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”）	基金管理人的股东、基金代销机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东

注：下述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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	3,021,302,086.76	5.95%	4,673,596,442.20	10.80%

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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长城证券	3,625,032.92	7.09%	-	-

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	2,489,433.42	5.89%	91,367.99	0.91%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	3,797,315.57	10.51%	799,046.76	11.62%

注：1.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的证管费和经手费后的净额列示。

2.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等。

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理	128,868,588.26	132,462,078.94

费		
其中：支付销售机构的客户维护费	21,151,264.45	21,661,400.78

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

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
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,478,098.04	22,077,013.12

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	9,975,163.15	-	-	-	-

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

本基金基金管理人于本期和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
中国农业银行	957,875,930.98	8,311,883.47	1,293,379,226.87	7,831,959.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2010-04-12	2010-04-13	2010-04-12	0.150	96,448,626.73	64,228,821.96	160,677,448.69	-
合计	-	-	-	0.150	96,448,626.73	64,228,821.96	160,677,448.69	-

注：2010年4月13日为场内除息日，2010年4月12日为场外除息日。

本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2010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

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。

7.4.12.2 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	备注
600315	上海家化	2010-12-06	公告 重大 事项	37.13	-	-	1,047,802	37,017,933.50	38,904,888.26	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股	19.71	2011-01-06	17.29	4,000,000	53,920,203.78	78,840,000.00	-

注：本基金截至2010年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌

的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、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风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的

交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.23%(2009 年 12 月 31 日：无%)。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理岗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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付

息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债均不计息，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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	957,875,930.98	-	-	-	-	-	957,875,930.98
结算备付金	18,202,778.56	-	-	-	-	-	18,202,778.56
存出保证金	-	-	-	-	-	9,691,238.50	9,691,238.50
交易性金融资产	-	-	-	-	19,449,388.20	7,810,230,467.10	7,829,679,855.30
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,347,435.95	21,347,435.95
应收利息	-	-	-	-	-	228,464.51	228,464.51
应收申购款	165,997.23	-	-	-	-	126,716.24	292,713.47
资产总计	976,244,706.77	-	-	-	19,449,388.20	7,841,624,322.30	8,837,318,417.27
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	199,499,517.85	199,499,517.85
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,149,691.18	6,149,691.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,093,278.51	11,093,278.51
应付托管费	-	-	-	-	-	1,848,879.75	1,848,879.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,996,120.49	9,996,120.49
应交税费	-	-	-	-	-	19,054.30	19,054.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,665,701.85	1,665,701.85
负债总计	-	-	-	-	-	230,272,243.93	230,272,243.93
利率敏感度缺口	976,244,706.77	-	-	-	19,449,388.20	-	-
上年度末2009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
银行存款	1,293,379,226.87	-	-	-	-	-	1,293,379,226.87
结算备付金	13,098,979.34	-	-	-	-	-	13,098,979.34
存出保证金	-	-	-	-	-	11,039,521.28	11,039,521.28

交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,588,391,808.38	8,588,391,808.38
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,508,965.31	1,508,965.31
应收利息	-	-	-	-	-	248,357.83	248,357.83
应收申购款	149,597.70	-	-	-	-	41,790.65	191,388.35
资产总计	1,306,627,803.91	-	-	-	-	8,601,230,443.45	9,907,858,247.36
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,695,322.21	13,695,322.21
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,097,748.79	11,097,748.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,482,262.64	12,482,262.64
应付托管费	-	-	-	-	-	2,080,377.11	2,080,377.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,874,539.63	6,874,539.63
应交税费	-	-	-	-	-	19,054.30	19,054.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,423,594.90	1,423,594.90
负债总计	-	-	-	-	-	47,672,899.58	47,672,899.58
利率敏感度缺口	1,306,627,803.91	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2010年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.23%(2009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(2009年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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市场利率和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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结

合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2010年12月31日		上年度末 2009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	7,810,230,467.10	90.74	8,588,391,808.38	87.10
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,810,230,467.10	90.74	8,588,391,808.38	87.10

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数×80%”以外的其他市场变量保持不变		
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 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	沪深 300 指数×80%上升 5%	464,780,493.36	527,519,916.11
	沪深 300 指数×80%下降 5%	-464,780,493.36	-527,519,916.11

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 7,711,934,967.04 元，属于第二层级的余额为 117,744,888.26 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 8,537,223,309.20 元，第二层级 51,168,499.18 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	7,810,230,467.10	88.38
	其中：股票	7,810,230,467.10	88.38
2	固定收益投资	19,449,388.20	0.22
	其中：债券	19,449,388.20	0.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	976,078,709.54	11.04
6	其他各项资产	31,559,852.43	0.36
7	合计	8,837,318,417.27	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	-	-

B	采掘业	571,297,535.79	6.64
C	制造业	3,895,180,989.43	45.26
C0	食品、饮料	788,806,776.71	9.16
C1	纺织、服装、皮毛	94,629,651.02	1.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	180,686,996.18	2.10
C5	电子	92,465,644.83	1.07
C6	金属、非金属	533,294,601.82	6.20
C7	机械、设备、仪表	1,314,301,226.67	15.27
C8	医药、生物制品	890,996,092.20	10.35
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	55,299,747.20	0.64
E	建筑业	66,164,000.00	0.77
F	交通运输、仓储业	50,205,757.44	0.58
G	信息技术业	425,887,188.04	4.95
H	批发和零售贸易	942,443,338.86	10.95
I	金融、保险业	1,249,374,321.25	14.52
J	房地产业	332,715,051.89	3.87
K	社会服务业	96,432,906.60	1.12
L	传播与文化产业	125,229,630.60	1.45
M	综合类	-	-
	合计	7,810,230,467.10	90.74

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	601166	兴业银行	14,993,469	360,592,929.45	4.19
2	000999	华润三九	11,170,916	285,416,903.80	3.32
3	002024	苏宁电器	21,776,549	285,272,791.90	3.31
4	600036	招商银行	21,906,401	280,620,996.81	3.26
5	000568	泸州老窖	5,954,235	243,528,211.50	2.83
6	000987	广州友谊	8,849,826	232,130,935.98	2.70
7	000651	格力电器	11,824,702	214,381,847.26	2.49
8	000527	美的电器	12,312,052	214,229,704.80	2.49
9	000983	西山煤电	7,679,908	204,976,744.52	2.38
10	600000	浦发银行	15,909,069	197,113,364.91	2.29
11	600887	伊利股份	5,099,867	195,120,911.42	2.27

12	601318	中国平安	3,383,138	189,997,030.08	2.21
13	000063	中兴通讯	6,379,333	174,155,790.90	2.02
14	600690	青岛海尔	5,724,584	161,490,514.64	1.88
15	600048	保利地产	12,304,467	156,266,730.90	1.82
16	000024	招商地产	9,223,585	147,116,180.75	1.71
17	600694	大商股份	2,810,934	133,210,162.26	1.55
18	000933	神火股份	5,219,927	130,759,171.35	1.52
19	600588	用友软件	5,072,079	117,976,557.54	1.37
20	000800	一汽轿车	7,203,271	115,612,499.55	1.34
21	000425	徐工机械	1,970,982	112,740,170.40	1.31
22	300142	沃森生物	836,652	111,442,046.40	1.29
23	600519	贵州茅台	600,000	110,352,000.00	1.28
24	601699	潞安环能	1,800,000	107,352,000.00	1.25
25	600309	烟台万华	5,423,768	104,082,107.92	1.21
26	000729	燕京啤酒	5,449,946	103,494,474.54	1.20
27	600585	海螺水泥	3,393,980	100,733,326.40	1.17
28	600660	福耀玻璃	9,451,529	96,972,687.54	1.13
29	600111	包钢稀土	1,337,127	95,524,352.88	1.11
30	002291	星期六	4,926,062	94,629,651.02	1.10
31	600546	山煤国际	2,660,292	92,046,103.20	1.07
32	000895	双汇发展	1,042,346	90,684,102.00	1.05
33	600030	中信证券	7,000,000	88,130,000.00	1.02
34	000878	云南铜业	3,050,000	83,875,000.00	0.97
35	000060	中金岭南	3,699,966	83,249,235.00	0.97
36	600518	康美药业	4,000,000	78,840,000.00	0.92
37	002422	科伦药业	500,000	78,760,000.00	0.92
38	600511	国药股份	3,037,600	75,332,480.00	0.88
39	000423	东阿阿胶	1,449,430	74,065,873.00	0.86
40	601601	中国太保	3,200,000	73,280,000.00	0.85
41	600535	天士力	1,741,131	70,968,499.56	0.82
42	600104	上海汽车	4,737,045	69,539,820.60	0.81
43	002273	水晶光电	1,370,531	69,198,110.19	0.80
44	600037	歌华有线	5,154,393	64,429,912.50	0.75
45	600880	博瑞传播	3,105,195	60,799,718.10	0.71
46	601628	中国人寿	2,800,000	59,640,000.00	0.69
47	600178	东安动力	4,950,000	57,816,000.00	0.67
48	000061	农产品	3,186,261	56,110,056.21	0.65
49	601179	中国西电	6,999,968	55,299,747.20	0.64
50	000069	华侨城A	4,396,124	53,412,906.60	0.62
51	000951	中国重汽	1,895,778	52,437,219.48	0.61
52	600386	北巴传媒	4,902,906	50,205,757.44	0.58

53	601607	上海医药	2,288,160	49,973,414.40	0.58
54	600068	葛洲坝	4,300,000	49,880,000.00	0.58
55	600062	双鹤药业	1,690,332	48,157,558.68	0.56
56	000401	冀东水泥	2,000,000	47,260,000.00	0.55
57	000538	云南白药	779,883	47,104,933.20	0.55
58	000829	天音控股	4,000,000	47,040,000.00	0.55
59	600276	恒瑞医药	776,811	46,266,863.16	0.54
60	600195	中牧股份	1,913,085	45,627,077.25	0.53
61	002073	软控股份	1,700,000	45,373,000.00	0.53
62	002419	天虹商场	948,651	45,250,652.70	0.53
63	600138	中青旅	3,000,000	43,020,000.00	0.50
64	600875	东方电气	1,210,000	42,229,000.00	0.49
65	002383	合众思壮	804,468	42,194,346.60	0.49
66	002242	九阳股份	2,632,278	39,668,429.46	0.46
67	600315	上海家化	1,047,802	38,904,888.26	0.45
68	300003	乐普医疗	1,377,262	37,723,206.18	0.44
69	000422	湖北宜化	2,000,000	37,700,000.00	0.44
70	002115	三维通信	2,000,000	36,960,000.00	0.43
71	600361	华联综超	3,357,069	35,215,653.81	0.41
72	000028	一致药业	996,382	32,880,606.00	0.38
73	000550	江铃汽车	1,152,100	31,728,834.00	0.37
74	600741	华域汽车	2,999,882	30,628,795.22	0.36
75	600410	华胜天成	1,700,000	30,311,000.00	0.35
76	600325	华发股份	2,892,716	29,332,140.24	0.34
77	600475	华光股份	1,184,728	28,303,151.92	0.33
78	600489	中金黄金	700,000	28,238,000.00	0.33
79	600005	武钢股份	6,000,000	25,680,000.00	0.30
80	600584	长电科技	2,099,958	23,267,534.64	0.27
81	600517	置信电气	1,390,652	23,057,010.16	0.27
82	600804	鹏博士	2,000,000	17,340,000.00	0.20
83	600970	中材国际	400,000	16,284,000.00	0.19
84	600055	万东医疗	1,000,000	15,990,000.00	0.19
85	002074	东源电器	793,300	13,732,023.00	0.16
86	002128	露天煤业	310,561	7,925,516.72	0.09
87	300056	三维丝	200,000	7,620,000.00	0.09
88	000021	长城开发	591,950	6,949,493.00	0.08

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% 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	000568	泸州老窖	739,277,443.41	7.50
2	000063	中兴通讯	693,784,970.07	7.04
3	000651	格力电器	684,844,918.14	6.95
4	600048	保利地产	607,502,861.31	6.16
5	600511	国药股份	509,702,323.66	5.17
6	601166	兴业银行	463,415,282.19	4.70
7	600037	歌华有线	431,110,589.04	4.37
8	000024	招商地产	401,889,757.15	4.08
9	600309	烟台万华	396,479,076.30	4.02
10	000400	许继电气	381,657,288.14	3.87
11	000527	美的电器	360,060,625.67	3.65
12	000987	广州友谊	338,664,333.88	3.43
13	000983	西山煤电	336,588,092.95	3.41
14	000829	天音控股	320,510,579.67	3.25
15	000513	丽珠集团	308,526,494.17	3.13
16	600694	大商股份	300,775,693.29	3.05
17	002024	苏宁电器	293,572,801.78	2.98
18	000759	武汉中百	291,256,809.19	2.95
19	002022	科华生物	291,064,277.64	2.95
20	600858	银座股份	282,457,434.82	2.86
21	000999	华润三九	280,941,448.20	2.85
22	600887	伊利股份	274,120,517.58	2.78
23	002038	双鹭药业	271,895,683.93	2.76
24	600195	中牧股份	251,408,082.23	2.55
25	000800	一汽轿车	249,579,212.41	2.53
26	600570	恒生电子	248,282,038.04	2.52
27	000401	冀东水泥	239,560,659.40	2.43
28	600000	浦发银行	234,908,416.73	2.38
29	600690	青岛海尔	234,178,992.47	2.37
30	000581	威孚高科	218,055,151.47	2.21
31	600660	福耀玻璃	209,964,987.92	2.13
32	600161	天坛生物	205,186,130.75	2.08
33	600348	国阳新能	202,337,176.25	2.05

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	000568	泸州老窖	829,501,198.50	8.41
2	000651	格力电器	610,385,948.74	6.19
3	600511	国药股份	574,000,006.17	5.82
4	000063	中兴通讯	539,177,109.32	5.47
5	600048	保利地产	531,953,487.72	5.39
6	600309	烟台万华	397,052,185.44	4.03
7	000400	许继电气	378,857,604.72	3.84
8	002038	双鹭药业	376,722,642.86	3.82
9	600383	金地集团	373,580,061.75	3.79
10	600037	歌华有线	363,205,077.09	3.68
11	000759	武汉中百	344,698,301.22	3.50
12	000527	美的电器	339,266,333.56	3.44
13	600000	浦发银行	331,452,950.37	3.36
14	000513	丽珠集团	328,349,602.53	3.33
15	000024	招商地产	327,930,350.13	3.33
16	600875	东方电气	324,953,172.95	3.30
17	600858	银座股份	312,011,912.89	3.16
18	002022	科华生物	309,708,601.56	3.14
19	000983	西山煤电	303,006,881.76	3.07
20	601318	中国平安	285,829,801.97	2.90
21	600348	国阳新能	284,750,034.33	2.89
22	600195	中牧股份	272,845,478.71	2.77
23	600585	海螺水泥	264,887,277.22	2.69
24	600570	恒生电子	262,907,993.55	2.67
25	600887	伊利股份	257,050,010.25	2.61
26	000829	天音控股	253,994,405.33	2.58
27	000581	威孚高科	252,740,432.68	2.56
28	600694	大商股份	246,452,742.98	2.50
29	000951	中国重汽	243,058,465.04	2.47
30	002024	苏宁电器	241,493,725.99	2.45
31	000800	一汽轿车	239,093,263.16	2.42
32	601088	中国神华	215,713,445.34	2.19
33	000401	冀东水泥	213,873,320.19	2.17
34	600161	天坛生物	213,452,930.42	2.16
35	601888	中国国旅	203,841,950.84	2.07
36	601166	兴业银行	201,721,686.97	2.05

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	25,021,775,545.98
卖出股票的收入（成交）总额	25,841,563,771.33

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均按买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	19,449,388.20	0.23
7	其他	-	-
8	合计	19,449,388.20	0.23

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113002	工行转债	164,630	19,449,388.20	0.23

8.7 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。

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	9,691,238.50
2	应收证券清算款	21,347,435.95
3	应收股利	-
4	应收利息	228,464.51
5	应收申购款	292,713.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,559,852.43

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不存在流通受限的情况。

§ 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
427,673	23,053.96	13,794,782.92	0.14%	9,845,763,452.68	99.86%

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	董名财	1,801,600.00	0.66%
2	林雯	1,692,023.00	0.62%
3	冯世杰	1,501,050.00	0.55%
4	梁要梅	959,033.00	0.35%
5	宋继仲	940,000.00	0.34%
6	何秀芳	900,000.00	0.33%
7	栾贵超	852,581.00	0.31%
8	衣国霞	846,012.00	0.31%
9	路海英	795,000.00	0.29%
10	黄贝	632,073.00	0.23%

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	-	-

注：截至本期末，本基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年1月26日)基金份额总额	1,155,234,378.92
本报告期期初基金份额总额	10,995,207,933.27
本报告期基金总申购份额	187,792,442.62
减：本报告期基金总赎回份额	1,323,442,140.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,859,558,235.60

注：总申购份额包含红利再投份额。

§ 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 2010 年 3 月 12 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，同意宋宜农先生辞去本公司副总经理一职。

2、基金管理人于 2010 年 3 月 30 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，并经中国证券监督管理委员会证监许可〔2010〕301 号文核准，聘任刘颂先生担任本公司副总经理。

3、基金管理人于 2010 年 5 月 7 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会选举通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可〔2010〕544 号文核准，聘任赵如冰先生担任本公司董事长。

4、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。

5、本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所有限公司已经连续 5 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 160,000.00 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

1、本报告期，中国证监会对本公司原景顺长城景系列开放式证券投资基金基金经理、原景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理涂强个人涉嫌违法违规买卖证券的行为进行了立案调查，并于 2010 年 7 月对涂强发布行政处罚及市场禁入决定书，取消其基金从业资格，没收违法所得 379,464.40 元，并处以 200 万元罚款，并认定涂强为市场禁入者；自中国证监会宣布决定之日起，终身不得从事证券业务或担任上市公司董事、监事、高级管理人员职务。

2、本公司已于 2009 年 8 月 7 日发布公告更换了景顺长城景系列开放式证券投资基金基金经理，

于2009年9月19日发布公告更换了景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）基金经理，涂强已于2010年4月自本公司离职。

3、2009年8月、2010年1月深圳证监局对本公司进行现场检查，对本公司内部控制、投资管理等方面的问题提出整改意见，并采取了责令整改措施。本公司股东、董事会及管理层对此高度重视，并针对反馈意见制定了一系列整改方案并予以全面落实，进一步采取了一系列措施完善内控制度，强化内控制度的执行力度，加强投资管理，防范员工道德风险。经努力，本公司于2010年9月通过了深圳证监局的检查验收。

4、本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长城证券有限责任公司	2	3,021,302,086.76	5.95%	2,489,433.42	5.89%	新增两个交易单元（因共用新增一个），退租一个交易单元
中国银河证券股份有限公司	2	196,701,184.05	0.39%	159,820.24	0.38%	因共用交易单元新增一个
广发证券股份有限公司	1	6,811,951,002.63	13.41%	5,790,147.18	13.69%	未变
平安证券有限责任公司	1	8,159,349,431.04	16.06%	6,935,439.57	16.40%	未变
招商证券股份有限公司	1	1,653,547,754.84	3.26%	1,343,511.31	3.18%	未变

中信证券股份有限公司	1	7,230,762,960.52	14.24%	6,146,140.76	14.53%	未变
中信建投证券有限责任公司	1	1,145,192,005.53	2.25%	973,409.68	2.30%	未变
中国国际金融有限公司	1	670,182,085.03	1.32%	544,525.80	1.29%	未变
瑞银证券有限责任公司	1	3,013,607,389.92	5.93%	2,561,564.48	6.06%	未变
国泰君安证券股份有限公司	1	4,628,782,159.98	9.11%	3,760,906.76	8.89%	未变
国信证券股份有限公司	1	5,307,056,622.24	10.45%	4,312,004.03	10.20%	未变
申银万国证券股份有限公司	1	2,710,730,179.66	5.34%	2,202,481.18	5.21%	因共用交易单元新增
光大证券股份有限公司	1	1,016,598,748.77	2.00%	825,989.69	1.95%	因共用交易单元新增
中国建银投资证券有限责任公司	1	1,127,245,417.30	2.22%	915,891.32	2.17%	因共用交易单元新增
东方证券股份有限公司	1	4,102,057,301.02	8.08%	3,332,937.47	7.88%	新增

注：本公司在中国农业银行托管的基金自 2010 年 2 月 5 日起共用深圳交易单元。

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		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
长城证券有限 责任公司	3,625,032.92	7.09%	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	47,484,368.20	92.91%	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报，上海证	2010-12-30

	基金参加中国工商银行“2011 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	券报，证券时报，基金管理人网站	
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网银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	2010-12-29
3	景顺长城基金管理有限公司关于继续参加交通银行网上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	2010-12-29
4	景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下基金在交通银行定期定额投资申购金额下限的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2010-12-28
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰联合证券网上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	2010-12-08
6	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	2010-12-03
7	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在兴业证券开通基金“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	2010-11-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于新增兴业证券为旗下部分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	2010-11-25
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券网上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	2010-11-05
10	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在华龙证券开通基金“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	2010-11-05
11	景顺长城基金管理有限公司关于新增华龙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	2010-11-05
12	景顺长城基金管理有限公司关于新增国金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	2010-11-05
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加华泰证券网上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	2010-09-28
14	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	2010-09-28
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加海通证券基金定期定额投资业务申购	中国证券报，上海证券报，证券时报，基	2010-09-09

	费率优惠活动的公告	金管理人网站	
16	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在华泰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	2010-09-02
17	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增华泰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	2010-09-02
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加光大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	2010-08-31
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加海通证券网上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	2010-08-31
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在海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	2010-08-31
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金半年度报告的更正公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-08-31
22	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在宏源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	2010-08-27
23	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增宏源证券为代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-08-27
24	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在光大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	2010-08-27
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加信达证券非现场委托方式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	2010-08-12
26	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在信达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	2010-08-12
27	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在广发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	2010-08-12
28	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增平安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	2010-07-29
29	于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在平安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	2010-07-29

30	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在国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	2010-07-19
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2010 年上半年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	2010-07-01
32	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	2010-07-01
33	景顺长城基金管理有限公司关于参加交通银行网上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	2010-06-30
34	景顺长城基金管理有限公司关于参加浦发银行电子渠道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	2010-06-30
35	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	2010-06-22
36	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在安信证券开通基金“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	2010-06-18
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加安信证券网上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	2010-06-18
38	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在申银万国证券开通基金“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	2010-06-05
39	景顺长城基金管理有限公司关于新增华泰联合证券为旗下部分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	2010-05-20
40	景顺长城基金管理有限公司关于对网上交易系统“银联通”电子支付平台基金单笔交易金额进行限制的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2010-05-05
41	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	2010-04-28
42	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	2010-04-28
43	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在国泰君安证券开通基金“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	2010-04-19
44	景顺长城资源垄断股票型证券投资基金	中国证券报，上海证	2010-04-13

	(LOF) 分红公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
45	景顺长城资源垄断股票型证券投资基金 (LOF) 分红预告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-04-08
46	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-04-07
47	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增方正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	2010-04-06
48	关于景顺长城基金管理有限公司开通网上直销“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	2010-03-10
49	关于通过银河证券开办景顺长城旗下基金“定期定额投资业务”并参加网上申购和定期定额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	2010-03-04
50	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金参加长城证券有限责任公司网上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	2010-02-04
51	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增国信证券为代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-01-14
52	景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金参加深圳发展银行“基金定投及申购费率优惠推广活动”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2010-01-14
53	景顺长城基金管理有限公司旗下基金新增天相投顾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	2010-01-08
54	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2009 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	2010-01-04
55	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在爱建证券开通基金“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	2010-01-04

§ 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资源垄断股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
2. 《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3. 《景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
4. 《景顺长城资源垄断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

二〇一一年三月二十八日