

# 景顺长城中小盘股票型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

### 2011 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 3 月 22 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
5 托管人报告.....	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投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	40

7.9 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	41
9 开放式基金份额变动.....	41
10 重大事件揭示.....	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
11 备查文件目录.....	45
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城中小盘股票
基金主代码	260115
交易代码	260115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月22日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,761,872,630.43份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力的中小型优势企业，充分把握其高成长特性和市值高速扩张所带来的投资机会，追求基金资产的长期资本增值，以超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>资产配置：基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>股票投资策略：本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，制定相应的投资策略，本基金在对投资标的进行研究筛选时，将从定性及定量两个方面加以考察分析。</p> <p>债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：中证700指数×80%+中证全债指数×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险收益水平高于债券型基金与混合型基金。本基金主要投资

	于中小盘股票，在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
--	--------------------------------

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	赵会军
	联系电话	0755-82370388	010-66105799
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	010-66105798
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55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55号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		赵如冰	姜建清

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6
---------------	--------------------------------

	月 30 日)
本期已实现收益	-24,036,531.22
本期利润	-115,080,838.94
加权平均基金份额本期利润	-0.058
本期加权平均净值利润率	-6.06%
本期基金份额净值增长率	-5.30%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2011 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	-92,627,855.58
期末可供分配基金份额利润	-0.053
期末基金资产净值	1,669,244,774.85
期末基金份额净值	0.947
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2011 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	-5.30%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

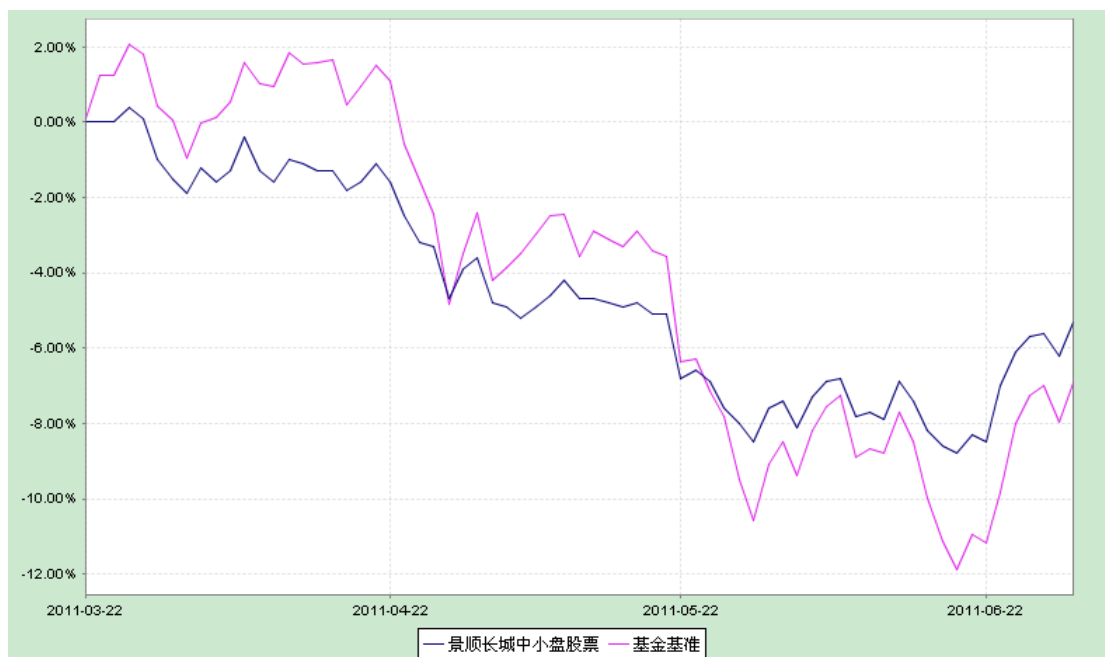
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.49%	0.72%	2.37%	1.11%	0.12%	-0.39%
过去三个月	-3.47%	0.66%	-6.01%	1.06%	2.54%	-0.40%
自基金合同生效起至今	-5.30%	0.64%	-6.91%	1.03%	1.61%	-0.39%

### 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

景顺长城中小盘股票型证券投资基金

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

(2011 年 3 月 22 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：本基金的资产配置比例为：基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%）。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。本基金的建仓期为自 2011 年 3 月 22 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

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



长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏辉	本基金基金经理，景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理，景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理，投资总监	2011-03-22	-	10	华中理工大学工学学士、经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员；2007年3月加入本公司。
杨鹏	本基金基金经理，景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理，景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理	2011-03-22	-	7	北京大学经济学学士、上海财经大学经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部，担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务；2008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。

#### 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、《景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金

合同的规定。

### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

#### **4.3.1 公平交易制度的执行情况**

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

#### **4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较**

本报告期内，本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金 3 月下旬成立以来，在市场下跌中逐步建仓，重点配置了机械、煤炭、汽车等行业。本基金虽超越业绩基准但未能规避中小盘股票的整体下跌，也遭遇了较大损失。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

自基金合同生效日（2011 年 3 月 22 日）至本期末，本基金份额净值增长率为-5.30%，高于业绩比较基准收益率 1.61%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

宏观环境：

上半年，通胀持续走高，是国内宏观经济的首要事件和压迫市场不断走低的主要因素。

从供需角度看，推升价格的因素既包括市场化因素，总需求随着国内外经济逐步复苏而回升，需求拉动价格；也包括非市场化的因素，部分行业的供给过去一两年受到计划之手的调控被人为抑制，供给不足推高了价格。

从通胀的根源看，推升价格的因素既包括周期性、货币性因素，如过去两年货币连续超发的滞后效应；也包括非周期、非货币的因素，如劳动力供给跨过刘易斯拐点，工资出现结构性上涨的压力。

经济的二元结构问题交织在一起，加深了通胀治理的复杂性，单纯的货币紧缩政策必须超过常规强度才可能实现满意的调控效果，因此，我们估计目前正在执行的严厉紧缩还会延续，而且确实会把中国的通胀水平压下来，但考虑到非货币因素、非市场化因素，如工资继续上涨、水电提价等，未来的通胀中枢会停留在比较高的水平。

证券市场：

宏观环境决定了证券市场的表现，受紧缩政策压制，市场估值水平整体下移，资金从去年下半年广受追捧的高估值的医药、电子等行业撤出，转向建材、地产、煤炭、化工等低估值的周期性行业。

这些周期性行业又受益于上述推升通胀的因素，如计划之手的产能控制、如周期性的需求回升等，业绩普遍表现向好。

因此上半年无论从估值还是业绩方面看，周期股都优于非周期股。上半年的投资机会也主要在于周期性行业的轮动。

展望下半年，投资机会更加多样。虽然证券市场目前还难以预期紧缩政策退出所带来的大级别反转行情，但低估值的周期股如果业绩还能继续超越预期，或者非周期股估值水平回落到合理水平，仍然会吸引投资者提高配置，甚至吸引场外其他大类资产投资者转换切入。

行业趋势：

跨过刘易斯拐点的中国经济将迎来不可逆转的产业升级和消费升级趋势。我们认为转型发生在经济活动的每一个角落，每一个市场主体都将在转型的过程中主动或者被动地调整自身的定位和战略。我们将围绕更广泛意义上的经济转型构建组合。我们重点关注新兴产业和消费行业的投资机会，也密切关注传统行业在转型过程中的投资机会。展望未来，在中国经济增长方式转型的过程中将涌现出一批又一批优秀企业，这将为我们的提供良好的投资机会。本基金将重点配置具有长期增长潜力的优秀中小市值公司。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

##### **1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历**

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

估值小组成员包括公司投资部、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险控

制岗等相关人员。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性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。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

本报告期末本基金可供分配利润为-92,627,855.58 元, 根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况, 报告期内本基金未满足收益分配条件, 不进行利润分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年, 本基金托管人在对景顺长城中小盘股票型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

2011 年上半年, 景顺长城中小盘股票型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城中小盘股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内, 景顺长城中小盘股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体: 景顺长城中小盘股票型证券投资基金

报告截止日: 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	314,026,956.89
结算备付金		349,609.81
存出保证金		1,331,397.07
交易性金融资产	6.4.7.2	1,291,380,956.35
其中: 股票投资		1,044,758,956.35
基金投资		-
债券投资		246,622,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,469,796.27
应收股利		71,104.32
应收申购款		127,026.49
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,709,756,847.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		33,565,806.39
应付赎回款		3,564,364.64
应付管理人报酬		2,081,749.53
应付托管费		346,958.27
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	577,204.85
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	375,988.67
负债合计		40,512,072.35
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,761,872,630.43
未分配利润	6.4.7.10	-92,627,855.58

所有者权益合计		1,669,244,774.85
负债和所有者权益总计		1,709,756,847.20

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.947 元，基金份额总额 1,761,872,630.43 份。本期财务报表的实际编制期间自 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-104,032,327.88</b>
1.利息收入		3,185,135.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,796,274.01
债券利息收入		1,066,361.97
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		322,499.54
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,525,239.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,525,723.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收 益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	6,000,483.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-91,044,307.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	352,083.82
<b>减：二、费用</b>		<b>11,048,511.06</b>
1. 管理人报酬		7,808,709.32
2. 托管费		1,301,451.60
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,819,684.08

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6,471.9	118,666.06
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-115,080,838.94</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-115,080,838.94</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：景顺长城中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,062,589,600.71	-	2,062,589,600.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-115,080,838.94	-115,080,838.94
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）	-300,716,970.28	22,452,983.36	-278,263,986.92
其中：1.基金申购款	3,661,790.17	-262,326.38	3,399,463.79
2.基金赎回款	-304,378,760.45	22,715,309.74	-281,663,450.71
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）	1,761,872,630.43	-92,627,855.58	1,669,244,774.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

媛



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中小盘股票型证券投资基金(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”)证监许可[2011]41 号文《关于核准景顺长城中小盘股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2011 年 3 月 22 日正式生效,首次设立募集规模为 2,062,589,600.71 份基金份额。本基金为契约型开放式,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,注册登记人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

本基金主要投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括在中小板、创业板上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:中证 700 指数×80%+中证全债指数×20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本基金财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 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、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

#### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本基金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。

#### **6.4.4.3 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。

#### **6.4.4.4 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。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

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的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

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，其中包括同时结转的公允价值变动收益。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。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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；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，出售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，出售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)中相关方法进行计算。

#### (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）在回购期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 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) 上市证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；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) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有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的或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，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) 交易所上市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；估值日没有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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的

或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，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；

4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，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，按成本估值。

#### (2) 未上市证券的估值

1) 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，即依照上述(1)中的 1)和 4)相关方法进行估值；

2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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，按成本估值；

3) 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，即依照上述(1)中的 1)和 4)的相关方法进行估值；

4) 在银行间同业市场交易的债券，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，按成本估值；

#### (3) 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均按上述(1)中的相关原则进行估值；

#### (4) 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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) 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；

(4) 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；

(5) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 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公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9) 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

- (1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- (5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (6) 投资者可在不同销售机构选择不同的分红方式，基金注册登记机构将以投资者在该销售机构最后一次选择的分红方式为准；
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未发生会计差错更正。

## 6.4.6 税项

### 1. 印花税

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

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

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

### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

### 3. 个人所得税

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

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

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



**6.4.7 重要财务报表项目的说明****6.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	活期存款	314,026,956.89
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	314,026,956.89	

注：本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未投资于定期存款和其他存款。

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,135,040,374.07	1,044,758,956.35	-90,281,417.72
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	247,384,890.00	246,622,000.00
	合计	247,384,890.00	246,622,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,382,425,264.07	1,291,380,956.35	-91,044,307.72

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	69,061.36
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	141.57
应收债券利息	2,344,842.48
应收买入返售证券利息	55,750.86
应收申购款利息	-
其他	-
合计	2,469,796.27

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末的其他资产余额为零。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	575,051.55
银行间市场应付交易费用	2,153.30
合计	577,204.85

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	13,433.30
预提费用	112,555.37
合计	375,988.67

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,062,589,600.71	2,062,589,600.71
本期申购	3,661,790.17	3,661,790.17
本期赎回（以“-”号填列）	-304,378,760.45	-304,378,760.45
本期末	1,761,872,630.43	1,761,872,630.43

注：本期申购份额含转换入份额；本期赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-24,036,531.22	-91,044,307.72	-115,080,838.94
本期基金份额交易产生的变动数	1,764,437.63	20,688,545.73	22,452,983.36
其中：基金申购款	-29,646.69	-232,679.69	-262,326.38
基金赎回款	1,794,084.32	20,921,225.42	22,715,309.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,272,093.59	-70,355,761.99	-92,627,855.58

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
活期存款利息收入	1,782,487.78
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	13,745.11
其他	41.12
合计	1,796,274.01

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
卖出股票成交总额	216,300,583.67
减：卖出股票成本总额	238,826,306.69
买卖股票差价收入	-22,525,723.02

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金于2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日期间的债券投资收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日期间的衍生工具收益项目发生额为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,000,483.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,000,483.52

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
1.交易性金融资产	-91,044,307.72
——股票投资	-90,281,417.72
——债券投资	-762,890.00
——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	-91,044,307.72

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
基金赎回费收入	351,811.07
基金转换费收入	272.75
合计	352,083.82

注：1. 本基金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。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,818,309.08
银行间市场交易费用	1,375.00
合计	1,819,684.08

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
----	--------------------------------------

审计费用	28,350.70
信息披露费	79,737.48
银行费用	5,210.69
债券托管账户维护费	4,467.19
其他	900.00
合计	118,666.06

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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、注册登记人、基金销售机构
中国工商银行	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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	274,908,694.88	17.29%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未通过关联方

交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 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3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付 佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	223,364.42	17.07%	-	-

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,877,034.75

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年3月22日（基金合同生效日）至2011年6月30日
	当期发生的基金应支付的托 管费

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日期间未与关联方进

行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日期间未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本期末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年3月22日(基金合同生效日)至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	314,026,956.89	1,782,487.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 6 月 30 日期间未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600216	浙江医药	2011-06-27	筹划非公开发行股票融资事宜	31.39	2011-07-04	32.60	834,948	30,833,994.69	26,209,017.72	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事交易所市场债券正回购交易，无质押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2011 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	314,026,956.89	-	-	-	-	-	314,026,956.89
结算备付金	349,609.81	-	-	-	-	-	349,609.81
存出保证金	-	-	-	-	-	1,331,397.07	1,331,397.07
交易性金融 资产	99,245,000.00	-	-	147,377,000.00	-	1,044,758,956.35	1,291,380,956.35
买入返售金 融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	2,469,796.27	2,469,796.27
应收股利	-	-	-	-	-	71,104.32	71,104.32
应收申购款	82,826.98	-	-	-	-	44,199.51	127,026.49
资产总计	513,704,393.68	-	-	147,377,000.00	-	1,048,675,453.52	1,709,756,847.20
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	33,565,806.39	33,565,806.39
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,564,364.64	3,564,364.64
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,081,749.53	2,081,749.53
应付托管费	-	-	-	-	-	346,958.27	346,958.27
应付交易费 用	-	-	-	-	-	577,204.85	577,204.85
其他负债	-	-	-	-	-	375,988.67	375,988.67
负债总计	-	-	-	-	-	40,512,072.35	40,512,072.35
利率敏感度 缺口	513,704,393.68	-	-	147,377,000.00	-	-	-

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
		本期末

		2011 年 6 月 30 日
	市场利率上升25个基点	-801,151.13
	市场利率下降25个基点	807,534.21

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的资产配置比例为：基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%）。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。于 2011 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,044,758,956.35	62.59
交易性金融资产-债券投资	246,622,000.00	14.77
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,291,380,956.35	77.36

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为其它价格风险的敏感性分析，反映了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6月30日	
	中证700指数×80%增加 5%		65,935,168.61
	中证700指数×80%减少 5%		-65,935,168.61

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

本财务报表已于 2011 年 8 月 22 日经本基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,044,758,956.35	61.11
	其中：股票	1,044,758,956.35	61.11
2	固定收益投资	246,622,000.00	14.42
	其中：债券	246,622,000.00	14.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	5.85
	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	314,376,566.70	18.39
6	其他各项资产	3,999,324.15	0.23
7	合计	1,709,756,847.20	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采掘业	136,689,969.56	8.19
C	制造业	761,309,689.77	45.61
C0	食品、饮料	24,767,897.32	1.48
C1	纺织、服装、皮毛	5,115,746.00	0.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	15,628,848.00	0.94
C4	石油、化学、塑胶、塑料	183,363,242.51	10.98
C5	电子	44,243,766.26	2.65
C6	金属、非金属	144,080,643.16	8.63
C7	机械、设备、仪表	317,900,528.80	19.04
C8	医药、生物制品	26,209,017.72	1.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,776,965.09	2.14
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	9,278,286.70	0.56
I	金融、保险业	34,133,210.40	2.04
J	房地产业	48,811,739.33	2.92
K	社会服务业	18,759,095.50	1.12
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,044,758,956.35	62.59

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300124	汇川技术	1,216,900	83,844,410.00	5.02
2	000937	冀中能源	2,676,482	67,848,818.70	4.06
3	002001	新和成	1,633,580	48,108,931.00	2.88
4	000887	中鼎股份	3,189,596	41,369,060.12	2.48
5	600970	中材国际	1,309,073	35,776,965.09	2.14
6	002353	杰瑞股份	550,172	35,706,162.80	2.14
7	300193	佳士科技	1,936,699	35,092,985.88	2.10
8	601299	中国北车	5,135,789	34,409,786.30	2.06
9	002011	盾安环境	2,449,459	34,022,985.51	2.04
10	000629	攀钢钒钛	2,896,699	32,066,457.93	1.92
11	000635	英力特	1,549,689	29,769,525.69	1.78

12	300132	青松股份	1,813,813	28,295,482.80	1.70
13	600375	星马汽车	1,289,958	27,256,812.54	1.63
14	000400	许继电气	861,373	26,538,902.13	1.59
15	600216	浙江医药	834,948	26,209,017.72	1.57
16	000562	宏源证券	1,550,640	25,911,194.40	1.55
17	600104	上海汽车	1,152,717	21,601,916.58	1.29
18	600048	保利地产	1,937,647	21,294,740.53	1.28
19	002541	鸿路钢构	480,125	19,349,037.50	1.16
20	600188	兖州煤业	544,231	19,211,354.30	1.15
21	600309	烟台万华	1,023,490	19,149,497.90	1.15
22	300035	中科电气	1,342,838	18,960,872.56	1.14
23	000157	中联重科	1,222,214	18,797,651.32	1.13
24	000401	冀东水泥	716,535	17,906,209.65	1.07
25	000550	江铃汽车	679,914	17,861,340.78	1.07
26	000926	福星股份	1,481,500	17,733,555.00	1.06
27	000630	铜陵有色	719,700	17,344,770.00	1.04
28	600362	江西铜业	489,100	17,333,704.00	1.04
29	002367	康力电梯	1,008,182	17,320,566.76	1.04
30	300105	龙源技术	365,594	17,285,284.32	1.04
31	000698	沈阳化工	1,764,100	16,670,745.00	1.00
32	000568	泸州老窖	348,900	15,742,368.00	0.94
33	000012	南玻A	952,100	15,709,650.00	0.94
34	600963	岳阳林纸	1,825,800	15,628,848.00	0.94
35	002547	春兴精工	732,112	12,292,160.48	0.74
36	600585	海螺水泥	435,110	12,078,653.60	0.72
37	000002	万科A	1,157,804	9,783,443.80	0.59
38	000988	华工科技	491,449	9,150,780.38	0.55
39	002365	永安药业	596,138	9,025,529.32	0.54
40	002159	三特索道	647,532	8,799,959.88	0.53
41	000968	煤气化	330,400	8,369,032.00	0.50
42	002142	宁波银行	755,700	8,222,016.00	0.49
43	600754	锦江股份	386,113	6,722,227.33	0.40
44	002251	步步高	244,650	5,658,754.50	0.34
45	601699	潞安环能	169,296	5,554,601.76	0.33
46	002029	七匹狼	161,380	5,115,746.00	0.31
47	600739	辽宁成大	130,199	3,619,532.20	0.22
48	601888	中国国旅	136,983	3,236,908.29	0.19

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300124	汇川技术	83,016,120.47	4.97
2	000400	许继电气	61,963,514.62	3.71
3	000937	冀中能源	61,722,138.26	3.70
4	000887	中鼎股份	51,622,748.89	3.09
5	002001	新 和 成	51,415,125.39	3.08
6	300193	佳士科技	46,732,243.51	2.80
7	600970	中材国际	46,103,641.51	2.76
8	002011	盾安环境	41,127,297.59	2.46
9	600048	保利地产	40,926,677.04	2.45
10	000629	攀钢钒钛	37,608,741.23	2.25
11	601299	中国北车	37,327,004.58	2.24
12	002353	杰瑞股份	35,968,367.44	2.15
13	300132	青松股份	35,367,836.82	2.12
14	600375	星马汽车	31,621,228.48	1.89
15	600216	浙江医药	30,833,994.69	1.85
16	000635	英 力 特	29,111,268.34	1.74
17	300140	启源装备	28,883,112.56	1.73
18	000562	宏源证券	27,307,049.03	1.64
19	000002	万 科A	27,114,655.45	1.62
20	600585	海螺水泥	26,320,433.90	1.58

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。

**7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000400	许继电气	23,394,457.94	1.40
2	600048	保利地产	21,915,668.38	1.31
3	600352	浙江龙盛	20,456,032.66	1.23
4	300140	启源装备	19,528,428.85	1.17
5	300083	劲胜股份	18,421,345.40	1.10
6	002106	莱宝高科	18,314,955.14	1.10
7	000002	万 科A	17,635,462.07	1.06
8	600585	海螺水泥	16,204,737.66	0.97
9	000968	煤 气 化	11,798,308.06	0.71
10	002165	红 宝 丽	10,499,791.68	0.63
11	600535	天士力	10,423,568.90	0.62

12	000933	神火股份	9,190,694.28	0.55
13	002334	英威腾	9,164,930.78	0.55
14	300136	信维通信	3,653,013.42	0.22
15	300193	佳士科技	2,173,959.75	0.13
16	002011	盾安环境	2,005,286.15	0.12
17	300132	青松股份	1,519,942.55	0.09

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,373,866,680.76
卖出股票的收入（成交）总额	216,300,583.67

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

#### 7.5 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	246,622,000.00	14.77
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	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	246,622,000.00	14.77

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	1001060	10 央行票据 60	600,000	58,518,000.00	3.51
2	1101039	11 央行票据 39	500,000	49,735,000.00	2.98
3	1101023	11 央行票据 23	500,000	49,625,000.00	2.97
4	1101027	11 央行票据 27	500,000	49,620,000.00	2.97
5	1001042	10 央行票据 42	400,000	39,124,000.00	2.34

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

7.9.1 本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**7.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,331,397.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	71,104.32
4	应收利息	2,469,796.27
5	应收申购款	127,026.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,999,324.15

**7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比	持有份额	占总份额



			例		比例
32,630	53,995.48	244,905,019.94	13.90%	1,516,967,610.49	86.10%

## 8.2 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	148,234.34	0.0084%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月22日）基金份额总额	2,062,589,600.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,661,790.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	304,378,760.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,761,872,630.43

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**10.5 报告期内改聘会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况**

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

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券有限责任公司	1	274,908,694.88	17.29%	223,364.42	17.07%	新增
中信建投证券有限责任公司	1	98,962,924.41	6.22%	84,117.94	6.43%	新增
国泰君安证券股份有限公司	1	94,723,705.72	5.96%	80,514.46	6.15%	新增
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国银河证券股份有限公司	1	220,758,557.29	13.88%	187,644.12	14.34%	新增
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	新增
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
安信证券股份有限公司	1	84,623,406.98	5.32%	68,757.10	5.26%	新增
兴业证券股份有限公司	1	799,374,821.61	50.27%	649,495.95	49.65%	新增
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增

方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
民生证券有限责任公司	1	16,815,153.54	1.06%	14,292.85	1.09%	新增
第一创业证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	349,700,000.00	100.00%	-	-

第一创业证券有限责任公司	-	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-29
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行开办基金“定期定额投资业务”并参与基金“定期定额投资业务”申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-29
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费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-28
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增华夏银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-28
5	关于景顺长城能源基建股票型证券投资基金和景顺长城中小盘股票型证券投资基金在中国工商银行开办基金定期定额投资业务并参加中国工商银行“2011倾心回馈”基金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	2011-06-17
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券和爱建证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-16
7	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金和景顺长城稳定收益债券型证券投资基金在银河证券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	2011-06-16
8	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金参加华泰联合证券申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-16
9	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金和景顺长城稳定收益债券型证券投资基金参加部分代销机构申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-10
10	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金开通定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-06-09
11	景顺长城中小盘股票型证券投资基金关于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	2011-06-09
12	景顺长城中小盘股票型证券投资基金关于	中国证券报, 上海	2011-05-23

	开放日常申购、赎回业务的公告	证券报, 证券时报, 基金管理人网站	
13	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金新增浙商银行作为代销机构的公告	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-05-04
14	景顺长城基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-04-07
15	景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-23
16	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金新增长江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	2011-03-23
17	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金新增广东发展银行为代销机构的公告	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-03-23
18	关于景顺长城中小盘股票型证券投资基金新增华泰联合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	2011-02-19
19	景顺长城中小盘股票型证券投资基金份额发售公告	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-15
20	景顺长城中小盘股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-15
21	景顺长城中小盘股票型证券投资基金托管协议	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-15
22	景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金合同及摘要	中国证券报, 上海 证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011-02-15

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

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

### **11.2 存放地点**

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### **11.3 查阅方式**

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十四日