

# 景顺长城优选股票证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期： 2012 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
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 .....	17
7.4 报表附注 .....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
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 .....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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 .....	44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	44
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 .....	44
8.9 投资组合报告附注 .....	45
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	45
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	47
11.4 基金投资策略的改变.....	47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
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
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
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	景顺长城优选股票证券投资基金
基金简称	景顺长城优选股票
基金主代码	260101
交易代码	260101
系列基金名称	景顺长城景系列开放式证券投资基金
系列其他子基金名称	景顺长城货币(260102)、景顺长城动力平衡混合(260103)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 10 月 24 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,429,442,129.17 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用“景顺长城股票数据库”对股票进行精密和系统的分析，构建具有投资价值的股票组合，力求为投资者提供长期的资本增值。
投资策略	本基金采取“自下而上”结合“自上而下”的投资策略，以成长、价值及收益为基础，在合适的价位买入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益的收益型股票。
业绩比较基准	上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数×80%+中国债券总指数×20%。
风险收益特征	本基金是一种具有较高波动性和较高风险的投资工具，适合风险承受能力强、追求高投资回报的投资群体。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

	建设广场第一座 21 层	
邮政编码	518048	100818
法定代表人	赵如冰	肖 钢

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号 星展银行大厦 6 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-155,582,994.81	202,351,464.76	-237,025,773.79
本期利润	-322,216,456.07	-18,395,871.57	1,164,222,499.22
加权平均基金份额本期利润	-0.2147	-0.0101	0.4234
本期加权平均净值利润率	-20.07%	-0.90%	42.81%
本期基金份额净值增长率	-19.82%	-1.09%	53.25%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	622,750,992.59	1,080,882,985.02	1,332,874,252.62
期末可供分配基金份额利润	0.4357	0.6694	0.6733
期末基金资产净值	1,293,624,569.44	1,838,719,254.36	2,299,987,818.36
期末基金份额净值	0.9050	1.1387	1.1619
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	213.77%	291.31%	295.61%

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

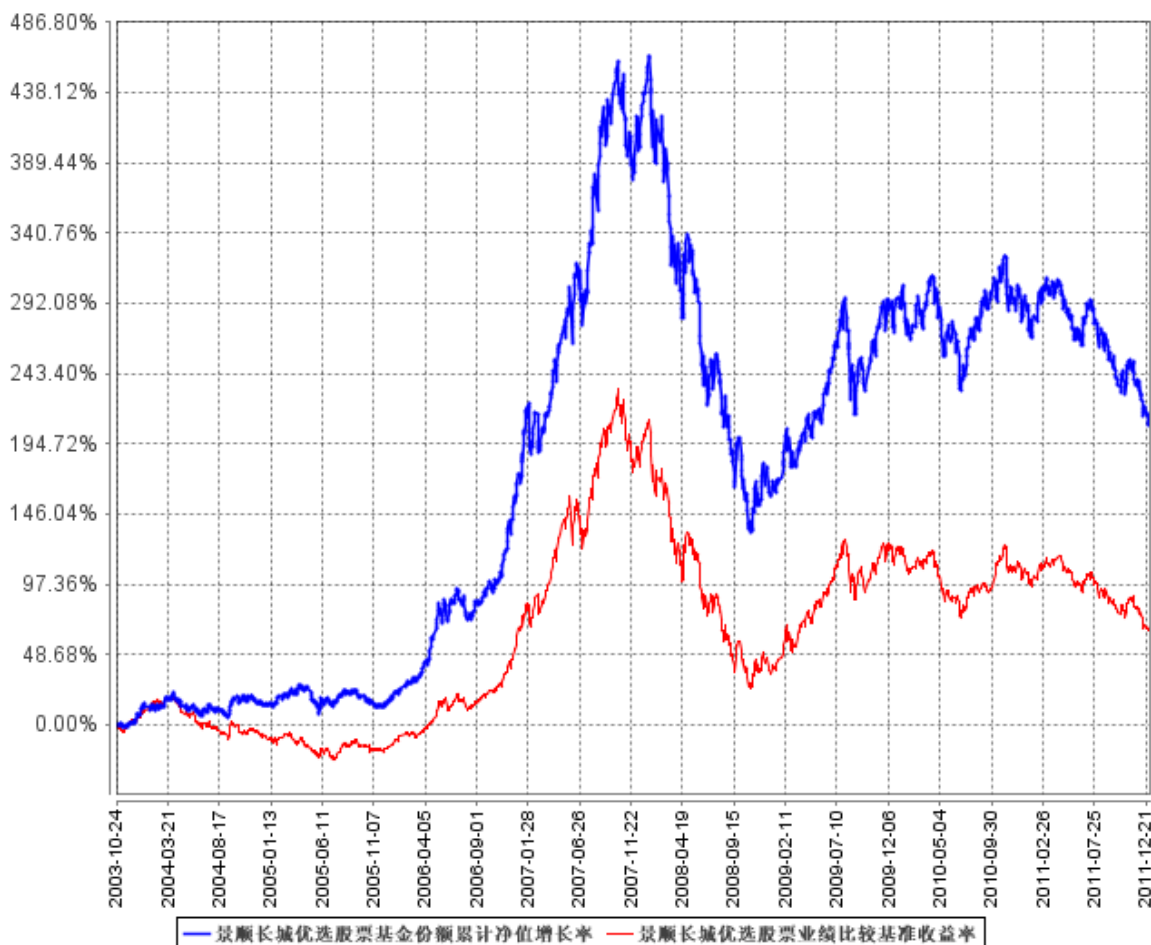
数字。

### 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

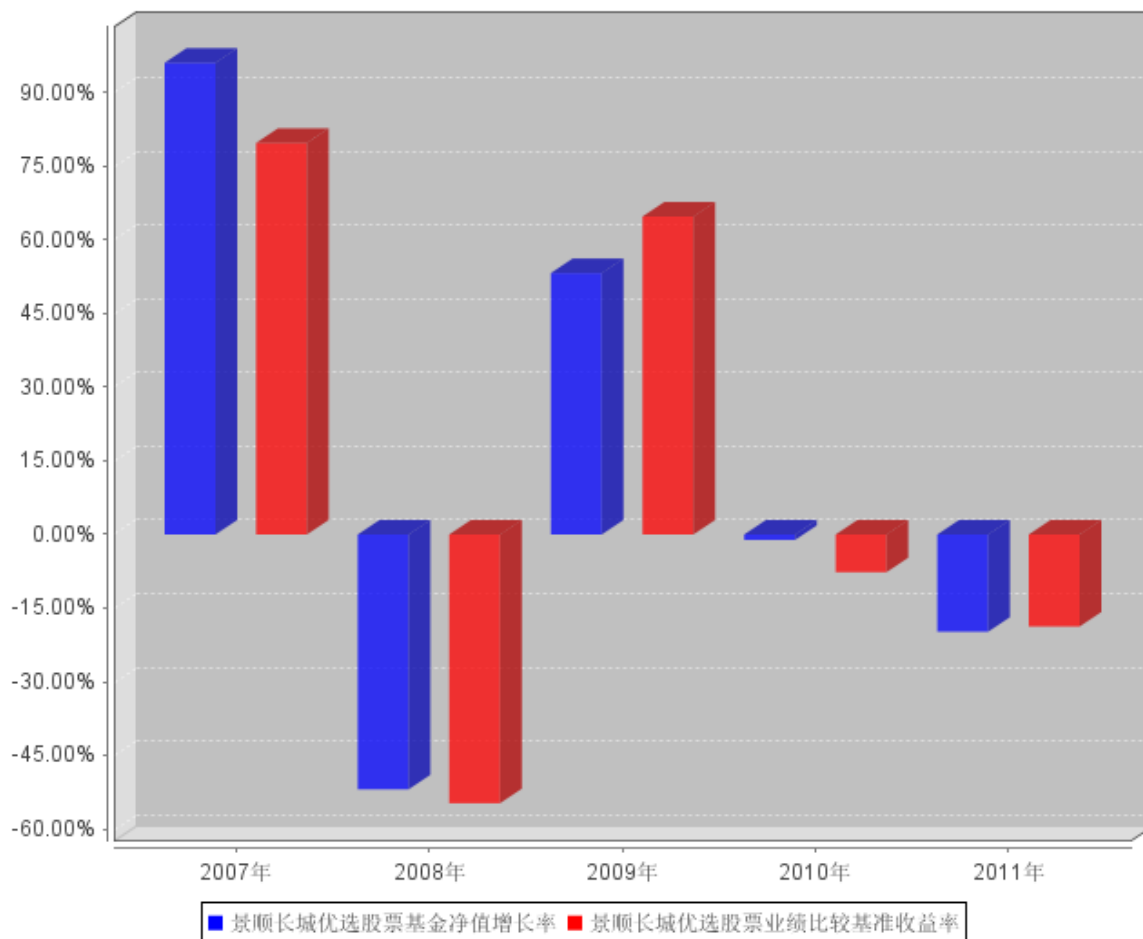
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.55%	1.03%	-5.86%	1.05%	-0.69%	-0.02%
过去六个月	-17.91%	0.98%	-16.61%	1.02%	-1.30%	-0.04%
过去一年	-19.82%	1.01%	-18.76%	0.96%	-1.06%	0.05%
过去三年	21.55%	1.29%	23.57%	1.24%	-2.02%	0.05%
过去五年	14.63%	1.62%	0.55%	1.62%	14.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	213.77%	1.42%	67.17%	1.43%	146.60%	-0.01%

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



注：本基金的资产配置比例为：股票投资的比例为基金资产净值的 70%至 80%；债券投资的比例为基金资产净值的 20%至 30%。按照本系列基金基金合同的规定，本基金自 2003 年 10 月 24 日合同生效日起至 2004 年 1 月 23 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2011	0.1000	7,424,895.78	8,670,678.59	16,095,574.37	一次分红
2010	0.1000	8,531,617.73	9,859,131.25	18,390,748.98	一次分红
2009	0.2000	18,083,723.87	21,339,772.84	39,423,496.71	一次分红
合计	0.4000	34,040,237.38	39,869,582.68	73,909,820.06	



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2011年12月31日，景顺长城基金管理有限公司管理景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
毛从容	景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺长城货币市场证券投资基金和景顺长城动力平衡证券投资基金），投资副总监	2005年6月1日	-	11	武汉大学经济学学士、华中理工大学经济学硕士。曾任职于交通银行、长城证券金融研究所，着重于宏观和债券市场的研究，并担任金融研究所债券业务小组组长；2003年3月加入本公司。
张继荣	景系列基金基金经理（分管景系列基金下设之景顺	2009年8月7日	-	11	东北大学工学学士、硕士，清华大学工学博士。曾担任大鹏证券行业分

	长城优选股票证券投资基金), 投资副总监, 景顺长城鼎益股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理			析师, 融通基金研究员、研究策划部总监助理、基金经理, 银华基金投资部首席策略分析师、基金经理等职务; 2009 年 3 月加入本公司。
--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、张继荣先生已于 2012 年 1 月 16 日离任景系列基金基金经理; 陈嘉平先生于 2012 年 1 月 17 日任职景系列基金基金经理, 分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金; 2012 年 3 月 20 日增聘丛林先生为景系列基金基金经理, 分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金, 与陈嘉平先生共同管理该基金。

## 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、《景顺长城景系列开放式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, 由于本基金管理人对外披露的 2010 年基金年度报告未对公司相关高级管理人员 2010 年度被深圳证监局采取监管谈话等行政监管措施的原因及结论进行披露, 深圳证监局于 2011 年 7 月 1 日向本基金管理人出具了《监管提示函》, 本基金管理人已及时向深圳证监局提交了书面整改报告。除此之外, 基金运作整体合法合规, 未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内, 本基金管理人管理的其他基金的投资风格与本基金的投资风格不相似。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年整体股市在第 1 季后即开始面临国外欧美经济下滑疑虑的困境，美国经济方面虽处在缓慢复苏的轨道上，但因欧债的疑虑在第 3 季加深，也束缚了企业一定的生产动力，而欧债危机除了使欧洲经济紧缩外，金融环境呈现不稳的状态，也使得全球的相关产业均呈现了一定的低迷状态，新兴市场经济体方面除了经济同步受压外，通膨也在去年给予股市一定的压力；国内经济出口方面受上述因素影响也面临下滑，加上政府对于房地产的调控效应显现，第 2 季开始了逐步下滑的过程。本基金在全年的操作思路，基本上处于相对偏低的仓位，另外在行业配置与选股上也是以低估值的蓝筹股为主，增持了一些稳定性较高的消费类股票，下半年则尽量规避强周期股票和估值高的中小股票。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年度，本基金份额净值增长率为-19.82%，低于业绩比较基准收益率 1.06%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响目前股市的重要三大关键因素：1、美国经济方面：由去年底及年初以来的经济数据看，仍处在复苏的的轨道上，虽然缓慢但可能因为欧洲债务危机因素而再度向下的状况没有发生；2、欧洲债务危机方面：2012 年 2-5 月陆续到期的债务，已经让欧元相关国家及 IMF 相关国家组织开始了一系列的措施，包含财政联盟体制及相关常态纾困基金 ESM 规模等等，短期各国仍在角力，短期看来欧洲经济似乎仍难摆脱财政紧缩造成的伤害，但不管如何 3 月开始的债务到期必须被陆续解决，欧美相关金融体系的稳定性才能确立，压抑全球股市表现的因素也将解除；3、国内经济方面：目前仍延续之前回落的态势，消费相对稳定，出口则受到上述欧美经济的影响，整体看来，硬着陆的风险偏低，房地产市场成为目前的主要关键因素，量价回落的趋势已经出现，若回落到一定程度后能配合政府的政策宽松，市场将受到明显的刺激。

操作策略部分，就股市空间来讲，经历过去年的大幅下滑，目前包含大盘蓝筹与中小盘成长估值处于相对偏低位置，但压抑因素尚未去化；就时间的角度来讲，2012 年 2-5 月上述三大因素将逐渐明朗化，因此在原本相对防御的策略，将逐步转向中性，并逐步增加弹性大的优质增长股配置。核心持股将以增长高的大盘蓝筹配合增长确定性高的中小盘股票为主，另若周期底部确认将辅以部分弹性高的周期性品种。

#### 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，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

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

益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及应用性的情况时，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

截止 2010 年 12 月 31 日，本基金可供分配利润为 1,080,882,985.02 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 0.10 元，详细信息请查阅相关分红公告。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期内本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的景顺长城优选股票证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的景顺长城景系列开放式证券投资基金下设的景顺长城

	优选股票证券投资基金(以下简称“景顺长城优选股票基金”)的财务报表,包括2011年12月31日的资产负债表、2011年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是景顺长城优选股票基金的基金管理人 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)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价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。
审计意见段	我们认为,上述景顺长城优选股票基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了景顺长城优选股票基金 2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 徐振晨
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2012年3月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 景顺长城优选股票证券投资基金

报告截止日: 2011年12月31日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	45,834,552.98	42,644,460.10
结算备付金		3,235,146.01	5,819,582.33

存出保证金		1,750,102.59	3,309,827.72
交易性金融资产	7.4.7.2	1,241,566,090.04	1,781,737,636.31
其中：股票投资		960,821,090.04	1,402,062,636.31
基金投资		-	-
债券投资		280,745,000.00	379,675,000.00
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		1,351,315.64	-
应收利息	7.4.7.5	4,208,310.99	12,236,950.29
应收股利		-	-
应收申购款		13,258.08	365,223.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,297,958,776.33	1,846,113,680.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		416,355.06	455,839.43
应付管理人报酬		1,693,059.66	2,372,650.06
应付托管费		282,176.59	395,441.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,050,128.16	3,560,992.28
应交税费		4,948.10	4,948.10
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	887,539.32	604,554.71
负债合计		4,334,206.89	7,394,426.29
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	670,873,576.85	757,836,269.34
未分配利润	7.4.7.10	622,750,992.59	1,080,882,985.02
所有者权益合计		1,293,624,569.44	1,838,719,254.36
负债和所有者权益总计		1,297,958,776.33	1,846,113,680.65

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9050 元，基金份额总额 1,429,442,129.17 份。



## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城优选股票证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-280,657,547.21	45,184,880.60
1. 利息收入		11,814,193.23	11,742,754.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	766,426.22	716,507.15
债券利息收入		11,047,767.01	11,026,247.11
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）		-125,868,419.27	254,134,297.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-134,550,326.65	247,638,325.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,750,889.40	-3,597,836.70
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	12,432,796.78	10,093,808.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-166,633,461.26	-220,747,336.33
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	30,140.09	55,165.22
<b>减：二、费用</b>		41,558,908.86	63,580,752.17
1. 管理人报酬		24,132,705.49	30,839,246.17
2. 托管费		4,022,117.62	5,139,874.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	12,909,561.27	27,312,785.20
5. 利息支出		251,480.55	55,628.42
其中：卖出回购金融资产支出		251,480.55	55,628.42
6. 其他费用	7.4.7.19	243,043.93	233,217.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-322,216,456.07	-18,395,871.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-322,216,456.07	-18,395,871.57

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城优选股票证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	757,836,269.34	1,080,882,985.02	1,838,719,254.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-322,216,456.07	-322,216,456.07
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）	-86,962,692.49	-119,819,961.99	-206,782,654.48
其中：1. 基金申购款	23,258,073.35	31,092,624.15	54,350,697.50
2. 基金赎回款	-110,220,765.84	-150,912,586.14	-261,133,351.98
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）	-	-16,095,574.37	-16,095,574.37
五、期末所有者权益（基金净值）	670,873,576.85	622,750,992.59	1,293,624,569.44
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	929,019,671.26	1,370,968,147.10	2,299,987,818.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,395,871.57	-18,395,871.57
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）	-171,183,401.92	-253,298,541.53	-424,481,943.45
其中：1. 基金申购款	33,684,263.48	46,487,912.58	80,172,176.06
2. 基金赎回款	-204,867,665.40	-299,786,454.11	-504,654,119.51
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）	-	-18,390,748.98	-18,390,748.98
五、期末所有者权益（基金净值）	757,836,269.34	1,080,882,985.02	1,838,719,254.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

许义明

吴建军

邵媛媛

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城景系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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[2003]第 96 号《关于同意景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 10 月 24 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设三个子基金,分别为景顺长城优选股票证券投资基金(以下简称“本基金”)、景顺长城货币市场证券投资基金(2005 年 7 月 15 日前原为景顺长城恒丰债券证券投资基金)和景顺长城动力平衡证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,835,000,215.28 元,其中包括本基金人民币 820,829,988.03 元、景顺长城恒丰债券证券投资基金人民币 473,468,816.63 元和景顺长城动力平衡证券投资基金人民币 540,701,410.62 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(2003)第 144 号验资报告予以验证。本系列基金设立募集期内认购资金产生的银行利息人民币 782,418.90 元在基金募集期结束时计入投资者认购账户,折合成 782,418.90 份基金份额,其中本基金 262,508.27 份基金份额、景顺长城恒丰债券证券投资基金 258,742.20 份基金份额和景顺长城动力平衡证券投资基金 261,168.43 份基金份额,归投资者所有。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》和《景顺长城优选股票证券投资基金基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 3 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.130676355,并于 2007 年 3 月 19 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《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》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。股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的 A 股;债券投资的范围包括国债、金融债、企业债与可转债等。在正常情况下,本基金的资产配置比例为:股票投资占基金资产净值的 70%-80%,债券投资占基金资产净值的 20%-30%。本基金的业绩比较基准为:上证综合指数和深证综合指数的加权复合指数 $\times 80\% +$ 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 2012 年 3 月 23 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》、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》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 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

实收基金包含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和基金份额折算调整。基金份额折算调整的初始金额为于基金份额折算日根据基金份额折算公式折算后的基金份额与对外发行的基金份额之间的差额。由于申购和赎回引起的实收基金份额和基金份额折算变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 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或者发行价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则按直线法计算。

#### 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，但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。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

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) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)

等情况,本基金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》,根据具体情况采用《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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(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 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	45,834,552.98	42,644,460.10
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	45,834,552.98	42,644,460.10

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,129,535,565.05	960,821,090.04	-168,714,475.01	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	277,072,777.78	280,745,000.00	3,672,222.22
	合计	277,072,777.78	280,745,000.00	3,672,222.22
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,406,608,342.83	1,241,566,090.04	-165,042,252.79	
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,396,821,407.84	1,402,062,636.31	5,241,228.47	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	383,325,020.00	379,675,000.00	-3,650,020.00
	合计	383,325,020.00	379,675,000.00	-3,650,020.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,780,146,427.84	1,781,737,636.31	1,591,208.47	

### 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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	7,645.23	12,874.60
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	1,455.80	2,036.80
应收债券利息	4,199,137.57	12,221,950.69
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	10.09	39.80
其他	62.30	48.40
合计	4,208,310.99	12,236,950.29

#### 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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,047,252.26	3,559,808.93
银行间市场应付交易费用	2,875.90	1,183.35
合计	1,050,128.16	3,560,992.28

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	500,000.00
应付赎回费	39.32	54.71
预提费用	137,500.00	104,500.00

合计	887,539.32	604,554.71
----	------------	------------

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,614,734,176.52	757,836,269.34
本期申购	49,556,861.69	23,258,073.35
本期赎回（以“-”号填列）	-234,848,909.04	-110,220,765.84
_年_月_日基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,429,442,129.17	670,873,576.85

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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	1,253,908,637.71	-173,025,652.69	1,080,882,985.02
本期利润	-155,582,994.81	-166,633,461.26	-322,216,456.07
本期基金份额交易产生的变动数	-138,823,010.99	19,003,049.00	-119,819,961.99
其中：基金申购款	37,610,601.51	-6,517,977.36	31,092,624.15
基金赎回款	-176,433,612.50	25,521,026.36	-150,912,586.14
本期已分配利润	-16,095,574.37	-	-16,095,574.37
本期末	943,407,057.54	-320,656,064.95	622,750,992.59

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31 日
	活期存款利息收入	706,312.07
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	56,826.30	92,971.53
其他	3,287.85	3,194.47

合计	766,426.22	716,507.15
----	------------	------------

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	4,318,648,296.78	9,165,357,926.30
减：卖出股票成本总额	4,453,198,623.43	8,917,719,600.93
买卖股票差价收入	-134,550,326.65	247,638,325.37

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,197,117,187.71	1,160,861,599.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,175,029,892.22	1,149,416,956.70
减：应收利息总额	25,838,184.89	15,042,479.12
债券投资收益	-3,750,889.40	-3,597,836.70

#### 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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,432,796.78	10,093,808.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,432,796.78	10,093,808.78

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日

1. 交易性金融资产	-166,633,461.26	-220,747,336.33
——股票投资	-173,955,703.48	-219,442,663.03
——债券投资	7,322,242.22	-1,304,673.30
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-166,633,461.26	-220,747,336.33

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
基金赎回费收入	28,009.94	51,249.04
基金转换费收入	2,130.15	3,916.18
合计	30,140.09	55,165.22

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。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
交易所市场交易费用	12,902,586.27	27,304,985.20
银行间市场交易费用	6,975.00	7,800.00
合计	12,909,561.27	27,312,785.20

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行划款手续费	25,043.93	15,217.99
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	243,043.93	233,217.99

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	224,530,496.71	2.66%	223,993,864.11	1.25%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期和上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	182,432.40	2.59%	620.79	0.06%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	181,996.52	1.22%	103,363.11	2.90%

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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,132,705.49	30,839,246.17
其中：支付销售机构的客户维护费	5,693,929.39	7,364,220.58

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 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
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,022,117.62	5,139,874.39

注：支付基金托管人中国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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 2011年1月1日至2011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
中国银行	97,367,516.94	-	-	-	410,020,000.00	242,829.54
上年度可比期间 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
中国银行	152,665,532.20	-	-	-	108,900,000.00	55,628.42

**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自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自有资金投资本基金。

**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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	45,834,552.98	706,312.07	42,644,460.10

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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**

金额单位：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	2011 年 1 月 12 日	2011 年 1 月 12 日	0.1000	7,424,895.78	8,670,678.59	16,095,574.37	
合计	-	-	0.1000	7,424,895.78	8,670,678.59	16,095,574.37	

## 7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
601555	东吴 证券	2011 年 12 月 6 日	2012 年 3 月 12 日	新股网下 申购	6.50	6.57	1,266,214	8,230,391.00	8,319,025.98	-
601336	新华 保险	2011 年 12 月 9 日	2012 年 3 月 16 日	新股网下 申购	23.25	27.87	113,673	2,642,897.25	3,168,066.51	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未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及债券投资等。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 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日：同)。

#### **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约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。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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	45,834,552.98	-	-	-	-	-	45,834,552.98

结算备付金	3,235,146.01	-	-	-	-	-	3,235,146.01
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	1,611,553.47	1,750,102.59
交易性金融资产	58,992,000.00	-	67,711,000.00	71,288,000.00	82,754,000.00	960,821,090.04	1,241,566,090.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,351,315.64	1,351,315.64
应收利息	-	-	-	-	-	4,208,310.99	4,208,310.99
应收申购款	-	-	-	-	-	13,258.08	13,258.08
资产总计	108,200,248.11	-	67,711,000.00	71,288,000.00	82,754,000.00	968,005,528.22	1,297,958,776.33
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	416,355.06	416,355.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,693,059.66	1,693,059.66
应付托管费	-	-	-	-	-	282,176.59	282,176.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,050,128.16	1,050,128.16
应交税费	-	-	-	-	-	4,948.10	4,948.10
其他负债	-	-	-	-	-	887,539.32	887,539.32
负债总计	-	-	-	-	-	4,334,206.89	4,334,206.89
利率敏感度缺口	108,200,248.11	-	67,711,000.00	71,288,000.00	82,754,000.00	-	-
上年度末 2010年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	42,644,460.10	-	-	-	-	-	42,644,460.10
结算备付金	5,819,582.33	-	-	-	-	-	5,819,582.33
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	3,171,278.60	3,309,827.72
交易性金融资产	-	160,285,000.00	219,390,000.00	-	-	1,402,062,636.31	1,781,737,636.31
应收利息	-	-	-	-	-	12,236,950.29	12,236,950.29
应收申购款	306,376.17	-	-	-	-	58,847.73	365,223.90
资产总计	48,908,967.72	160,285,000.00	219,390,000.00	-	-	1,417,529,712.93	1,846,113,680.65
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	455,839.43	455,839.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,372,650.06	2,372,650.06
应付托管费	-	-	-	-	-	395,441.71	395,441.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,560,992.28	3,560,992.28
应交税费	-	-	-	-	-	4,948.10	4,948.10
其他负债	-	-	-	-	-	604,554.71	604,554.71
负债总计	-	-	-	-	-	7,394,426.29	7,394,426.29

利率敏感度缺口	48,908,967.72	160,285,000.00	219,390,000.00	-	-	-	-
---------	---------------	----------------	----------------	---	---	---	---

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末（2011年12月31日）	上年度末（2010年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-2,122,391.03	-230,073.79
	市场利率下降25个基点	2,162,553.74	230,788.04

#### 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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的70%-80%，债券投资比例为基金资产净值的20%-30%。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 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	960,821,090.04	74.27	1,402,062,636.31	76.25
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	960,821,090.04	74.27	1,402,062,636.31	76.25

## 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（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	1. “沪深 300 指数×80%”下降 5%	-55,625,856.49	-86,419,804.95
2. “沪深 300 指数×80%”上升 5%	55,625,856.49	86,419,804.95	

## 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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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）。

## (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 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 960,821,090.04 元，属于第二层级的余额为 280,745,000.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 1,402,062,636.31 元，第二层级 379,675,000.00 元，无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

## (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	960,821,090.04	74.03
	其中：股票	960,821,090.04	74.03
2	固定收益投资	280,745,000.00	21.63
	其中：债券	280,745,000.00	21.63
	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	49,069,698.99	3.78
6	其他各项资产	7,322,987.30	0.56
7	合计	1,297,958,776.33	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	5,810,883.39	0.45
B	采掘业	66,342,526.59	5.13

C	制造业	478,613,755.11	37.00
C0	食品、饮料	121,788,648.40	9.41
C1	纺织、服装、皮毛	26,103,977.60	2.02
C2	木材、家具	3,122,000.00	0.24
C3	造纸、印刷	6,033,977.20	0.47
C4	石油、化学、塑胶、塑料	22,866,487.05	1.77
C5	电子	48,262,196.83	3.73
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	162,415,749.47	12.56
C8	医药、生物制品	88,020,718.56	6.80
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,706,328.96	0.52
E	建筑业	6,468,660.00	0.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	43,439,532.73	3.36
H	批发和零售贸易	113,216,019.50	8.75
I	金融、保险业	194,085,388.16	15.00
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	40,733,202.80	3.15
L	传播与文化产业	5,404,792.80	0.42
M	综合类	-	-
	合计	960,821,090.04	74.27

### 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	600000	浦发银行	5,710,264	48,480,141.36	3.75
2	601166	兴业银行	3,826,180	47,903,773.60	3.70
3	600036	招商银行	3,431,945	40,737,187.15	3.15
4	000568	泸州老窖	1,033,370	38,544,701.00	2.98
5	000423	东阿阿胶	880,148	37,802,356.60	2.92
6	600188	兖州煤业	1,530,806	34,274,746.34	2.65
7	600690	青岛海尔	3,674,054	32,809,302.22	2.54
8	600519	贵州茅台	160,669	31,057,317.70	2.40
9	000651	格力电器	1,675,447	28,968,478.63	2.24
10	000876	新希望	1,523,118	25,512,226.50	1.97
11	600741	华域汽车	2,647,728	24,517,961.28	1.90
12	601601	中国太保	1,208,300	23,211,443.00	1.79
13	002024	苏宁电器	2,532,605	21,375,186.20	1.65

14	600518	康美药业	1,817,458	20,391,878.76	1.58
15	300171	东富龙	513,531	19,652,831.37	1.52
16	000858	五粮液	573,540	18,812,112.00	1.45
17	002410	广联达	560,735	18,521,077.05	1.43
18	600723	首商股份	1,752,037	17,099,881.12	1.32
19	000417	合肥百货	1,195,665	16,894,746.45	1.31
20	600015	华夏银行	1,493,872	16,776,182.56	1.30
21	300216	千山药机	456,401	16,425,871.99	1.27
22	000987	广州友谊	1,026,661	16,200,710.58	1.25
23	600031	三一重工	1,265,721	15,872,141.34	1.23
24	600655	豫园商城	1,822,578	15,273,203.64	1.18
25	601898	中煤能源	1,617,600	14,574,576.00	1.13
26	601888	中国国旅	554,000	14,531,420.00	1.12
27	002037	久联发展	749,827	14,359,187.05	1.11
28	002293	罗莱家纺	174,077	13,055,775.00	1.01
29	002397	梦洁家纺	498,023	13,048,202.60	1.01
30	600827	友谊股份	1,140,116	12,963,118.92	1.00
31	002415	海康威视	300,000	12,900,000.00	1.00
32	600557	康缘药业	826,232	12,153,872.72	0.94
33	002475	立讯精密	345,950	12,073,655.00	0.93
34	300115	长盈精密	282,170	10,313,313.50	0.80
35	002430	杭氧股份	449,200	10,066,572.00	0.78
36	600337	美克股份	1,165,693	10,059,930.59	0.78
37	002273	水晶光电	302,943	9,788,088.33	0.76
38	000826	桑德环境	385,288	9,709,257.60	0.75
39	002474	榕基软件	237,720	9,271,080.00	0.72
40	002001	新和成	451,878	8,883,921.48	0.69
41	002038	双鹭药业	267,540	8,788,689.00	0.68
42	600406	国电南瑞	275,850	8,606,520.00	0.67
43	000422	湖北宜化	482,000	8,507,300.00	0.66
44	601555	东吴证券	1,266,214	8,319,025.98	0.64
45	601088	中国神华	317,875	8,051,773.75	0.62
46	300146	汤臣倍健	100,928	7,862,291.20	0.61
47	601117	中国化学	1,233,231	7,029,416.70	0.54
48	600054	黄山旅游	446,170	6,625,624.50	0.51
49	002325	洪涛股份	326,700	6,468,660.00	0.50
50	002511	中顺洁柔	255,677	6,033,977.20	0.47
51	002299	圣农发展	391,833	5,810,883.39	0.45
52	601628	中国人寿	311,200	5,489,568.00	0.42



53	300058	蓝色光标	178,376	5,404,792.80	0.42
54	600886	国投电力	905,726	5,398,126.96	0.42
55	002340	格林美	273,099	5,325,430.50	0.41
56	002350	北京科锐	259,652	4,886,650.64	0.38
57	300105	龙源技术	81,400	4,175,006.00	0.32
58	002353	杰瑞股份	58,800	4,116,000.00	0.32
59	600588	用友软件	223,200	4,017,600.00	0.31
60	002441	众业达	220,200	3,349,242.00	0.26
61	300136	信维通信	175,600	3,187,140.00	0.25
62	601336	新华保险	113,673	3,168,066.51	0.24
63	601996	丰林集团	350,000	3,122,000.00	0.24
64	002063	远光软件	178,258	3,023,255.68	0.23
65	000888	峨眉山A	154,800	2,837,484.00	0.22
66	300203	聚光科技	152,000	2,629,600.00	0.20
67	601369	陕鼓动力	201,900	2,313,774.00	0.18
68	600168	武汉控股	190,700	1,308,202.00	0.10
69	300124	汇川技术	1,800	97,560.00	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁电器	102,392,350.01	5.57
2	600585	海螺水泥	98,955,842.16	5.38
3	600636	三爱富	97,604,623.12	5.31
4	000002	万科A	89,831,132.19	4.89
5	600160	巨化股份	84,622,232.79	4.60
6	000157	中联重科	82,227,048.17	4.47
7	600031	三一重工	81,466,647.20	4.43
8	000568	泸州老窖	79,081,298.58	4.30
9	601166	兴业银行	78,434,744.66	4.27
10	600015	华夏银行	73,721,641.75	4.01
11	000876	新希望	65,821,009.47	3.58
12	002078	太阳纸业	65,162,377.63	3.54
13	601766	中国南车	64,521,309.38	3.51
14	600690	青岛海尔	62,168,456.09	3.38

15	000338	潍柴动力	62,005,964.97	3.37
16	000937	冀中能源	60,909,416.10	3.31
17	000527	美的电器	58,452,637.95	3.18
18	601117	中国化学	55,672,247.84	3.03
19	000651	格力电器	53,418,204.52	2.91
20	600963	岳阳林纸	51,818,156.12	2.82
21	002001	新和成	51,694,915.29	2.81
22	600188	兖州煤业	51,304,428.23	2.79
23	600104	上汽集团	47,599,610.84	2.59
24	000401	冀东水泥	47,012,240.85	2.56
25	000858	五粮液	46,864,104.86	2.55
26	601088	中国神华	46,063,214.09	2.51
27	600216	浙江医药	45,330,873.78	2.47
28	000987	广州友谊	44,135,936.27	2.40
29	000983	西山煤电	43,684,080.48	2.38
30	601808	中海油服	42,738,604.23	2.32
31	600997	开滦股份	42,658,937.62	2.32
32	601899	紫金矿业	42,343,662.45	2.30
33	000423	东阿阿胶	39,966,084.92	2.17
34	601699	潞安环能	38,639,643.06	2.10
35	000630	铜陵有色	38,333,299.39	2.08
36	002122	天马股份	37,252,289.29	2.03
37	600970	中材国际	36,982,191.38	2.01
38	600030	中信证券	36,971,497.06	2.01

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%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600636	三爱富	125,133,147.12	6.81
2	600585	海螺水泥	116,828,377.02	6.35
3	600104	上汽集团	103,032,004.87	5.60
4	600690	青岛海尔	97,808,795.43	5.32
5	600970	中材国际	93,544,601.57	5.09
6	601318	中国平安	93,127,982.14	5.06

7	600160	巨化股份	89,394,655.93	4.86
8	000002	万科A	81,850,241.28	4.45
9	600031	三一重工	80,541,726.78	4.38
10	000157	中联重科	77,993,622.77	4.24
11	002024	苏宁电器	76,117,318.86	4.14
12	601699	潞安环能	75,199,399.26	4.09
13	000983	西山煤电	73,114,738.02	3.98
14	601601	中国太保	70,627,566.28	3.84
15	600252	中恒集团	69,863,814.13	3.80
16	600741	华域汽车	68,993,041.93	3.75
17	000937	冀中能源	66,430,297.32	3.61
18	000338	潍柴动力	63,066,065.73	3.43
19	000024	招商地产	60,602,548.34	3.30
20	601766	中国南车	59,919,626.94	3.26
21	000425	徐工机械	58,247,301.84	3.17
22	002008	大族激光	56,393,270.78	3.07
23	002078	太阳纸业	53,966,032.94	2.93
24	601111	中国国航	52,342,393.87	2.85
25	000858	五粮液	48,332,583.16	2.63
26	600963	岳阳林纸	47,644,680.19	2.59
27	600015	华夏银行	47,302,202.33	2.57
28	600048	保利地产	46,622,535.53	2.54
29	000527	美的电器	46,293,851.01	2.52
30	000401	冀东水泥	45,904,835.97	2.50
31	601117	中国化学	44,762,490.69	2.43
32	002122	天马股份	42,071,697.67	2.29
33	601166	兴业银行	40,675,070.71	2.21
34	601899	紫金矿业	40,625,397.75	2.21
35	601898	中煤能源	40,591,070.70	2.21
36	000069	华侨城A	39,843,172.30	2.17
37	000568	泸州老窖	39,740,290.95	2.16
38	600535	天士力	39,560,697.39	2.15
39	000417	合肥百货	38,655,222.30	2.10
40	000501	鄂武商A	38,150,431.90	2.07
41	600030	中信证券	38,012,550.25	2.07
42	000550	江铃汽车	37,653,431.55	2.05
43	600997	开滦股份	37,507,075.36	2.04

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

买入股票成本（成交）总额	4,185,912,780.64
卖出股票收入（成交）总额	4,318,648,296.78

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。

### 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	87,489,000.00	6.76
3	金融债券	193,256,000.00	14.94
	其中：政策性金融债	193,256,000.00	14.94
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	280,745,000.00	21.70

### 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	1101030	11 央行票据 30	700,000	67,711,000.00	5.23
2	110245	11 国开 45	600,000	58,992,000.00	4.56
3	110417	11 农发 17	500,000	51,510,000.00	3.98
4	110258	11 国开 58	500,000	51,260,000.00	3.96
5	110411	11 农发 11	300,000	31,494,000.00	2.43

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

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

**8.9.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,750,102.59
2	应收证券清算款	1,351,315.64
3	应收股利	-
4	应收利息	4,208,310.99
5	应收申购款	13,258.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,322,987.30

### 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

本基金报告期末前十名股票中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
73,790	19,371.76	35,741,064.04	2.50%	1,393,701,065.13	97.50%

### 9.2 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	1,099.23	0.0001%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年10月24日）基金份额总额	821,092,496.30
本报告期期初基金份额总额	1,614,734,176.52
本报告期基金总申购份额	49,556,861.69
减：本报告期基金总赎回份额	234,848,909.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,429,442,129.17

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

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

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

3、基金管理人于2012年1月17日发布公告，张继荣先生已于2012年1月16日离任景系列基金基金经理；陈嘉平先生于2012年1月17日任职景系列基金基金经理，分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金；于2012年3月20日发布公告，2012年3月20日增聘丛林先生为景系列基金基金经理，分管景系列基金下设之景顺长城优选股票证券投资基金，与陈嘉平先生共同管理该基金。

4、本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者

服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所有限公司已经连续 9 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 100,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中银国际证券有限责任公司	1	2,171,178,373.20	25.69%	1,845,497.86	26.21%	未变更
中国国际金融有限公司	2	1,510,006,477.61	17.87%	1,283,506.06	18.23%	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	1,065,299,630.56	12.61%	865,563.24	12.29%	未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	966,353,031.15	11.43%	821,397.94	11.67%	未变更
长江证券股份有限公司	1	859,795,155.02	10.17%	698,590.32	9.92%	本期新增一个
浙商证券有限责任公司	1	728,757,529.64	8.62%	592,119.24	8.41%	未变更
广发证券股份有限公司	1	432,865,485.27	5.12%	351,705.70	5.00%	未变更
招商证券股份有	1	228,485,849.13	2.70%	185,645.61	2.64%	未变更

限公司						
长城证券有限责 任公司	1	224,530,496.71	2.66%	182,432.40	2.59%	未变更
海通证券股份有 限公司	1	162,152,335.05	1.92%	131,749.43	1.87%	未变更
中国银河证券股 份有限公司	1	101,862,818.23	1.21%	82,763.93	1.18%	未变更

注：1. 在中国银行托管的基金共用深圳交易单元。

2. 用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中银国际证券 有限责任公司	1,051,456.90	100.00%	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-



浙商证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 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基金参加中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定期定额投资优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 30 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 29 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 29 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 29 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于继续参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 29 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 29 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于变更分红方式业务规则的公告	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 16 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增中信万通证券为代销机构并开通基金转换业务及基	中国证券报，上海证券报，证券时报，基金管理人网站	2011 年 12 月 15 日

	金“定期定额投资业务”的公告		
9	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2011 年第 2 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 12 月 8 日
10	景顺长城基金管理有限公司开展直销网上交易基金转换费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 12 月 7 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 12 月 1 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在国海证券开通基金“定期定额投资业务”并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 12 月 1 日
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 11 月 30 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于开通汇付天下直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 11 月 3 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 11 月 3 日
16	景顺长城优选股票证券投资基金 2011 年第三季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 10 月 24 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华宝证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 8 月 31 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在华宝证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 8 月 31 日
19	景顺长城优选股票证券投资基金 2011 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 8 月 24 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信金通证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 8 月 4 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增国盛证券为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 7 月 29 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于	中国证券报, 上海证券报, 证	2011 年 7 月 29 日

	旗下部分基金参加国盛证券网上交易申购费率优惠活动的公告	券时报, 基金管理人网站	
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金在长城证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 7 月 29 日
24	景顺长城优选股票证券投资基金 2011 年第二季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 7 月 20 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加兴业证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 7 月 13 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2011 年上半年度最后一个交易日基金资产净值和份额净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 7 月 1 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 29 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增华夏银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 28 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 28 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券和爱建证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 16 日
31	景顺长城景系列开放式证券投资基金 2011 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 8 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行开通转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 8 日
33	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金在齐鲁证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 2 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加齐鲁证券开放式基金网上交易申购费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 2 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于新增齐鲁证券为旗下基金代销机	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 6 月 2 日

	构并开通基金转换业务的公告		
36	景顺长城基金管理有限公司关于开通直销网上交易“精明i定投”业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年5月28日
37	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰联合证券开放式基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年5月19日
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券开通基金“定期定额投资业务”并参加非现场交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年5月6日
39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增长江证券为代销机构并参加非现场交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年5月6日
40	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券网上交易基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月28日
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在华泰联合证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月28日
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月28日
43	景顺长城优选股票证券投资基金2011年第一季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月22日
44	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易优惠费率的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月11日
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增东方证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月11日
46	景顺长城基金管理有限公司关于新增东莞证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月9日
47	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年4月7日
48	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金参加工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011年3月30日

	告		
49	景顺长城优选股票证券投资基金 2010 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 3 月 28 日
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中信银行开通转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 3 月 24 日
51	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在天相投顾开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 3 月 9 日
52	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金参加光大证券网上交易定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 3 月 8 日
53	景顺长城基金管理有限公司关于新增中投证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 2 月 24 日
54	景顺长城基金管理有限公司关于新增中信证券为旗下基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 2 月 18 日
55	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在中信证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 2 月 18 日
56	景顺长城基金管理有限公司关于新增中航证券为旗下基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 2 月 11 日
57	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加温州银行个人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	2011 年 1 月 31 日
58	景顺长城基金管理有限公司关于新增浙商证券为旗下基金代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 28 日
59	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金在浙商证券开通基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 28 日
60	景顺长城基金管理有限公司关于开通工商银行借记卡基金网上直销业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 27 日
61	景顺长城优选股票证券投资基金 2010 年第四季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 21 日
62	景顺长城基金管理有限公司关于开展直销网上交易农业银行支付渠道申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 8 日
63	景顺长城优选股票证券投资基金	中国证券报, 上海证券报, 证	2011 年 1 月 7 日

	分红公告	券时报, 基金管理人网站	
64	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2010 年度最后一个交易日基金资产净值和份额净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2011 年 1 月 4 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城景系列开放式证券投资基金设立的文件;
- 2、《景顺长城景系列开放式证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城景系列开放式证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城景系列开放式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。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司  
2012 年 3 月 30 日