

信息披露 Disclosure

景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金

[2011] 第二季度报告

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中的真实性、准确性、完整性、及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 景顺长城内需增长贰号股票

基金主代码 260109

交易代码 260109

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2006年10月11日

报告期末基金份额总额 4,404,581,778.90份

基金资产净值 4,404,581,778.90元

基金份额净值 1.004

注: ①本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 -150,750,770.34

2.本期利润 -256,419,984.30

3.加权平均基金份额本期利润 -0.058

4.期末基金资产净值 4,421,118,553.69

5.期末基金份额净值 1.004

注: ①本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价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 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 -5.46% 1.06% -4.81% 0.83% -0.65% 0.23%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2006年10月11日至2011年6月30日

注: ①本基金的资产配置比例为:投资于股票的最大比例和最小比例分别是95%和70%。投资于债券的最大比例是30%。本基金优先投资于和经济增长密切相关的内需拉动型行业中的优势企业,对这些行业投资占基金投资的比例不低于80%。按照本基金合同的规定,本基金的投资建仓期为自2006年10月11日合同生效日起6个月。②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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.1 管理人报告

4.1.1 基金经理(基金经理组合)简介

姓名 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

王鹏辉 2007-9-15 - 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、融通基金管理有限公司行业研究员;2007年3月加入本公司。

杨鹏 2010-8-21 - 7 北京大学经济学学士、上海财经大学经济硕士,曾任于融通基金管理有限公司行业研究员、债券研究员,融通基金管理助理职务;2008年3月加入本公司。

注: ①本基金的基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的日期(公告前一日)对此前的非任职基金经理,“任职日期”按指根据公司决定聘任后的公告日期。

2.对基金业绩影响最大的前五名证券投资基金的名称及其报告期内的报酬率

3.2.3 管理人报告期内本基金是否遵循行业法规的情况

本基金报告期内严格遵守《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》等有关法律法规及各项实施细则,履行了内需增长贰号股票型证券投资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,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金运作整体符合法律法规,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 本基金报告期内与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注: ①本基金的基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的日期(公告前一日)对此前的非任职基金经理,“任职日期”按指根据公司决定聘任后的公告日期。

2.对基金业绩影响最大的前五名证券投资基金的名称及其报告期内的报酬率

3.2.4 管理人报告期内本基金是否遵循行业法规的情况

本基金报告期内严格遵守《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》等有关法律法规及各项实施细则,履行了内需增长贰号股票型证券投资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,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金运作整体符合法律法规,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。

4.4 公平交易制度的执行情况

4.4.1 本基金报告期内与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注: ①本基金的基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写,“离任日期”为根据公司决定的日期(公告前一日)对此前的非任职基金经理,“任职日期”按指根据公司决定聘任后的公告日期。

2.对基金业绩影响最大的前五名证券投资基金的名称及其报告期内的报酬率

3.2.5 管理人报告期内本基金是否遵循行业法规的情况

本基金报告期内严格遵守《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》等有关法律法规及各项实施细则,履行了内需增长贰号股票型证券投资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,为基金持有人谋取最大利益。本报告期内,基金运作整体符合法律法规,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。

4.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称 景顺长城精选蓝筹股票

基金主代码 260110

交易代码 260110

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2007年6月18日

报告期末基金份额总额 12,192,862,631.45份

注: ①本基金的资产配置比例为:股票投资70%-95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不超过5%-30%。本基金自2007年6月18日合同生效日起至2007年12月17日为建仓期。建仓结束后,本基金的投资组合比例达到上述要求。

5.2 报告期内基金业绩指标

5.2.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 -5.11% 0.91% -0.85% 0.88% -0.76% 0.03%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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: ①本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)

1.本期已实现收益 162,824,434.73

2.本期利润 -520,270,266.22

3.加权平均基金份额本期利润 -0.043

4.期末基金资产净值 9,966,533,968.47

5.期末基金份额净值 0.817

注: ①本期已实现收益指基金本期利润收入、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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

5.4 基金净值表现

5.4.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率标准差④

过去三个月 -5.11% 0.91% -0.85% 0.88% -0.76% 0.03%

3.4.2 本基金合同生效以来基金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: 本基金在2季度回避了业绩不达预期的中小盘股票和周期性公司,持有行业景气度增长确定的个股

5.5 报告期末基金资产净值

5.6 报告期内基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 3,995,449,149.13 89.87

其中:股票 3,995,449,149.13 89.87

2 固定收益投资 198,495,000.00 4.46

其中:债券 198,495,000.00 4.46

货币支持证券 - -

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 147,914,877.54 3.33

6 其他各项资产 103,835,811.06 2.34

7 合计 4,445,694,837.73 100.00

5.7 报告期内按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农、林、牧、渔业 - -

B 采掘业 606,733,668.35 13.72

C 制造业 2,255,044,248.47 51.01

C0 食品、饮料 716,222,738.53 16.20

C1 纺织、服装、皮革、毛皮、鞋业 - -

C2 木材、家具 - -

C3 造纸、印刷 - -

C4 石油、化学、塑胶、塑料 226,844,333.60 5.13

C5 电子 164,571,026.62 3.72

C6 金属、非金属 588,170,028.54 13.30

C7 机械设备、仪表 503,583,874.77 11.39

C8 医药、生物制品 55,651,646.41 1.26

C99 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 交通运输、仓储业 85,839,177.06 1.94

G 信息技术业 - -

H 批发、零售业 849,292,719.70 19.21

I 房地产业 - -

J 社会服务业 - -

K 传播与文化产业 - -

L 综合类 198,599,335.55 4.49

M 合计 3,995,449,149.13 100.00

5.8 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 权益投资 1,995,787,813.64 90.24

其中:股票 1,995,787,813.64 90.24

2 固定收益投资 99,245,000.00 4.49

其中:债券 99,245,000.00 4.49

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 64,440,696.86 2.91

6 其他各项资产 52,131,801.56 2.36

7 合计 2,211,605,312.06 100.00

5.9 报告组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 1,995,787,813.64 90.24

其中:股票 1,995,787,813.64 90.24

2 固