

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准鹏城长城基金系列开放式证券投资基金设立的文件；

2、鹏城长城基金系列开放式证券投资基金基金合同；

3、鹏城长城基金系列开放式证券投资基金招募说明书；

4、鹏城长城基金系列开放式证券投资基金托管协议；

5、鹏城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。

7.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

鹏城长城基金管理有限公司

2012年4月23日

5.4 报告期末按投资品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	67,718,000.00	5.92
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转债	-	-
9	其他	-	-
10	合计	67,718,000.00	5.92

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1110194	11央行票据94	700,000	67,718,000.00	5.92

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期末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。

5.8.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的各选股股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,033,262.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	763,333.34
5	应收申购款	39,004.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,835,600.78

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.9 开放式基金份额变动

本报告期初基金份额总额	1,567,965,375.28
本报告期基金总申购份额	6,538,714.73
减：本报告期基金总赎回份额	108,830,388.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,465,673,701.43

注：总申购份额含转入份额，总赎回份额含转出份额。

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准鹏城长城中小盘股票型证券投资基金设立的文件；

2、鹏城长城中小盘股票型证券投资基金基金合同；

3、鹏城长城中小盘股票型证券投资基金招募说明书；

4、鹏城长城中小盘股票型证券投资基金托管协议；

5、鹏城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。

7.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

鹏城长城基金管理有限公司

2012年4月23日