

A38

(上接A37版)

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
联系人:樊晓红
电话:010-60838995
传真:010-60833739
客服电话:95548
网址:www.cs.citic.com
(51)中国中投证券有限责任公司
注册(办公)地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
法定代表人:吕耀来
联系人:刘毅
联系电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
客服电话:400 600 8008
网址:www.china-invs.cn
(52)长江证券承销保荐有限公司
注册(办公)地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽洋
联系人:吴博宇
电话:027-65799999
传真:027-65481900
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com
(53)国盛证券有限责任公司
注册(办公)地址:南昌市北京西路88号(信国际金融大厦)
法定代表人:曾小晋
联系人:陈明
电话:0791-86281305
传真:0791-86285337
客户服务电话:400 8222 111
网址:www.gsstock.com
(54)国海证券股份有限公司
注册地址:广西桂林市辅星路13号
办公地址:深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼
法定代表人:张雅维
联系人:牛孟宇
联系电话:0755-83709350
传真:0755-83700265
客户服务电话:95563
公司网址:www.ghzq.com.cn
(55)中信证券(山东)有限责任公司
注册(办公)地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心1号楼第20层(260601)
法定代表人:杨宝林
联系人:孙秋月
联系电话:0532-85022606
客户服务电话:95548
公司网址:www.citicssd.com
(56)西南证券股份有限公司
注册(办公)地址:重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人:余维佳
联系人:张煜
电话:023-63786141
传真:023-63786212
客服电话:400 800 6006
公司网站:www.swsc.com.cn
(57)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(58)第一创业证券股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
联系人:毛叶莉
电话:0755-2383750
传真:0755-2383750
客服电话:400-888-1888
网址:www.fscs.com.cn
(59)川财证券有限责任公司
注册(办公)地址:成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17层
法定代表人:孟建军
联系人:匡晖
电话:028-86853053
传真:028-86853063
客户服务电话:028-95105118
公司网址:http://www.cczi.com.cn
(60)天风证券股份有限公司
注册(办公)地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
法定代表人:余磊
联系人:崔成
电话:027-87610052
传真:027-87618863
客户服务电话:4008005000
网址:www.tfzq.com
(61)中信期货有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:洪城
电话:0755-23953913
传真:0755-83217421
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicfc.com
(62)深圳众禄金融控股股份有限公司
注册(办公)地址:深圳市罗湖区梨园物流仓储置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
联系人:董彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客户服务电话:4006-788-887
网址:众禄基金网 www.zlfund.com
基金买卖网 www.jmmw.com.cn
(63)杭州数米基金销售有限公司
注册(办公)地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
联系人:陈柏青
联系人:宋晓琦
电话:021-60897940
传真:0571-26697013
客户服务电话:4000-166-123
网址:www.fund123.cn
(64)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
注册(办公)地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号东码头园区C栋
法定代表人:汪静波
联系人:方成
电话:021-38602377
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com
(65)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦大道555号景园国际B座16层
法定代表人:张秋伟
联系人:单丙辉
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客服电话:400-820-2899
公司网站:www.erichund.com.cn
(66)上海好易基金销售有限公司
注册(办公)地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449号
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人:杨文斌
联系人:张茹
电话:021-58760701
传真:021-68969316
客户服务电话:400 700 9665
网址:www.ehowbuy.com
(67)北京展恒基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振秋
联系人:宋丽冉
电话:010-62020088
传真:010-62020355
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com
(68)和讯信息科技有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区东大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:习翊
联系电话:010-85650920
传真号码:010-85657357
全国统一客服热线:400-920-0022/ 021-20835588
公司网址:licaike.hexun.com
(69)上海天天基金销售有限公司
注册(办公)地址:上海市徐汇区龙田路190号东方财富大厦2楼
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号302室
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509988
传真:021-64388308
客服电话:400-1818-188
网站:http://www.1234567.com.cn
(70)浙江同顺基金销售有限公司
注册(办公)地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人:凌顺平
联系人:杨翼
联系电话:0571-88911818-8565
传真:0571-86800423
客服电话:4008-773-772 0571-88920897
网址:www.5ifund.com
(71)万银财富(北京)基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人:李招弟
联系人:高晓芳
电话:010-59393923
传真:010-59393074
客户服务电话:400-059-8888
网址:www.wy-fund.com
(72)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区建国路89号15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809室
法定代表人:沈伟祚
联系人:程刚
电话:010-52855713
传真:010-85894285
客户服务电话:400-609-9200
网址:www.yixinfund.com
(73)北京增财基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人:罗细安
联系人:孙晋峰
电话:010-67000988
电话:010-67000988-6000
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zwcc.com.cn
(74)厦门广鑫鼎盛控股有限公司
注册(办公)地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场15楼
法定代表人:林松
联系人:袁艳艳
电话:0592-3122703
传真:0592-8060771
客户服务电话:400-6980-777
网址:www.dkhs.com.cn
(75)北京展恒天汇投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街甲6号万通中心D座28层
法定代表人:蒋煜
联系人:徐长征、林凌
电话:010-58170943、010-58170918
传真:010-58170800
客户服务电话:400-818-8866
网址:www.shengshiview.com
(76)嘉实财富管理有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期4606-10单元
法定代表人:赵学军
联系人:景洪
电话:021-20268890
传真:021-85087308
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(77)深圳市新华通证券投资咨询有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
办公地址:北京市西城区宣武门外大街10号胜华广场中央办公楼东翼1/2层
法定代表人:杨懿
电话:0755-88394666
传真:0755-88394677
客户服务电话:400-166-1188
网址:http://8.rjrc.com.cn/
(78)一路财富(北京)信息科技有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门内大街27号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪涛
联系人:段鑫璐
电话:010-88312877
传真:010-88312885
客户服务电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
(79)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁毅
联系人:陈娜
电话:010-57756019
传真:010-57756199
客户服务电话:400-786-8868-5
网址:www.chtfund.com
(80)北京钱景财富投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵春蓉
联系人:魏哲
电话:010-57418829
传真:010-57569671
客户服务电话:400-678-5095
网址:www.niuinjie.com
(81)深圳腾元基金销售有限公司
注册(办公)地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
办公地址:深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806单元
法定代表人:曾革
联系人:廖晴莎
电话:0755-33376853
传真:0755-33065516
客户服务电话:4006-877-899
网址:www.tenyuanfund.com
(82)北京创金启信投资管理有限公司
注册(办公)地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人:梁睿
联系人:张晶晶
电话:010-66154828
传真:010-88067526
客户服务电话:010-88067526
网址:www.5irich.com
(83)北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册(办公)地址:北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A303
办公地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
法定代表人:王岩
联系人:胡岩
电话:010-59200855
传真:010-59200800
客户服务电话:400-819-9968
网址:www.tytfund.com
(84)上海汇付金融服务有限公司
注册(办公)地址:上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:张磊
联系人:周丹
电话:021-33323999
传真:021-33323993
客户服务电话:400-820-2819
手机/客户端:天天盈基金
(85)上海利得基金销售有限公司
注册(办公)地址:上海市金山区漕泾路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人:沈伟祚
联系人:赵沛然
电话:021-50583533
传真:021-50583633
客户服务电话:4006676266
公司网址:www.leadinbank.com.cn
(86)北京新银泰石基金销售有限公司
注册(办公)地址:北京市海淀区北四环西路58号906室
法定代表人:张欢行
联系人:李阳臻
电话:010-82244185
客户服务电话:010-62675369
网址:http://www.xincail.com
(87)泰诚财富基金销售有限公司
注册(办公)地址:辽宁省大连市沙河口区星海中心龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:滕广平
电话:0411-89891212
传真:0411-84396536
客户服务电话:4006411999
网址:www.taichengcaifu.com
(88)上海陆金所资产管理有限公司
注册(办公)地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁宇博
电话:021-20666952
传真:021-22066653
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufunds.com
基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

21层

二、注册登记机构
名称:景顺长城基金管理有限公司
住 所: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
法定代表人:赵如冰
电话:0755-82370388-1668
传 真:0755-22381325
联系人:杨波
三、律师事务所及经办律师
名称:上海市通力律师事务所
住 所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:021-31358666
传真:021-31358600

经办律师:吕红、黎明
四、会计师事务所及经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册及办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人:Ng Albert Kong Ping 吴港平
电话:010-58153000
传真:010-85188298
经办注册会计师:昌华、陈立群
联系人:李妍明

第四部分、基金的名称

景顺长城中小盘混合型证券投资基金
第五部分、基金的类型
契约型开放式

第六部分、基金的投资目标

本基金通过投资于具有高成长潜力的中小型企业优势企业,充分把握其高成长特性和市值高速增长所带来的投资机会,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。

第七部分、基金的投资方向

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(包括在中小创、创业板上市股票)、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和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他品种,本基金管理人将在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

本基金将基金资产的90%-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%),将基金资产的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%)。

本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

第八部分、基金的投资策略

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、投资规定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。

二、股票投资策略

1. 中小股票主题库构建
在当前中国证券市场环境,本基金对中小股票主题库的界定方式为:基金管理人每季度末将对A股市场中的股票按市值从小到大排序并相加,累计市值达到总市值2/3的股票列入中小股票主题库;期间对于未纳入最近一次排序范围内的股票(如新股、恢复上市股票等),若其市值接近最近一次排序的标准符合中小股票标准,则可决定是否将其纳入A股主题库;本基金对于中小股票的界定方式将随中国证券市场未来的发展与变革情况作出相应的调整。中小盘股权投资将占本基金股票投资的80%以上。

2. 中小盘股票投资策略
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,在定性分析方面重点关注:

(1)成长性(growth)。重点关注企业生存和发展的外部环境,企业享有国家相关的优惠政策的变化,企业关键技术和商业模式易程度,产品定位等。

(2)业务价值(Franchise Value)
重点关注拥有高进入壁垒的上市公司,其一般具有以下一种或多种特征:产品或服务能力、创新能力、资金密集、优势品牌、健全的销售网络及销售体系、规模经济、网络效应、市场增长时它们能创造持续性的成长,经济衰退时亦能度过难关,享有高于市场平均水平的盈利能力,进而创造商业价值,达成长期资本增值。

(3)竞争优势(competitive advantage)。重点关注企业的市占率概况、技术优势、创新体制和开发能力、专利权和法规限制、渠道关系等。

(4)管理能力(Management)
重点关注公司治理、企业的质量管理,公司的销售网络、管理层的稳定性以及管理班子构成、学历、经验等,通过实地考察了解其管理层能力以及是否诚信,以及企业的战略实施等。

(5)自由现金流量与分红政策(Cash Generation Capability)
重点关注企业创造现金流量的能力以及稳定透明的分红派息政策。衡量企业绩效的最终标准在于投资者的长期现金报酬,企业除了需要拥有良好的利润增长以外,也需要创造足够现金流以供派息和再投资之用。在会计准则刚性太大,盈利容易被操纵的时候,此标准尤其重要,因为创造现金与分红能力永远是一家企业素质的最好体现。

在定量分析方面重点关注:

(1)盈利能力。主要指标有资产收益率(ROA)、净资产收益率(ROE)等。

(2)成长潜力。主要指标有销售收入增长率、净利润增长率等。

(3)偿债能力。关注目标公司的资产负债结构以及资产流动性状况,重点分析的指标有资产负债率、流动比率、货币资金/总资产、利息保障倍数等。

(4)估值。主要指标有市盈率(PE)、市盈增长率(PEG)、市净率(PB)、市现率(PCF)、市销率(PS)、企业价值比率(EV/EBITDA)等。

对成长、价值、收益三类股票设定不同的估值指标。

成长型股票(G):用来衡量成长型上市公司估值水平的一个重要指标为PEG,即市盈率除以盈利增长率。为了使投资者能够到达中长期获利目标,我们在选股时将会谨慎地买入价格与其预期增长速度相匹配的股票。

价值型股票(V):分析股票内在价值的基础是将公司的未来现金流量折现并与资本成本进行比较。我们在挑选价值型股票时,会根据公司的净资产收益率与资本成本的相对水平判断公司的合理价值,然后选出股价相对于合理价值存在折价的股票。

收益型股票(I):是依据分红取得较好收益的股票。我们挑选收益型股票,要求其保持持续派息的政策,以及较高的股息率水平。

(5)流动性分析。主要指标有市场流通量、股东分散性等。

以上个股考察中不可或缺的部分是合理性分析,因此在研究公司业务以及对公司前景做出预测时,都会对有关公司的业绩和盈利能力做出详细的合理性研究。其中包括对公司的盈利能力与国内同行业的公司作比较,追踪公司的主要竞争对手,如供应商、客户、竞争对手等的表现,参考国外同业公司的表现与赢利能力等,务求从全方位评估公司本身的业绩合理性与业务价值。

3. 买入名单确定
我们运用景顺长城“股票研究数据库(SRD)”当中的标准分析模板对上市公司品质和估值水平进行鉴别,再综合当前的市场状况等多种市场因素,择机将符合选股标准的股票纳入股票买入名单。

三、债券投资策略
债券投资策略是在资产配置的基础上,采取利率预期策略、信用策略和相对价值策略相结合的投资方法,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

1. 自上而下确定组合久期及类属资产配置
通过对宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况的研究,结合宏观经济模型(MEM)判断收益率曲线变动的趋势及幅度,确定组合久期。进而根据各类属资产的预期收益率,结合类属资产配置模型确定类别资产配置。

2. 自下而上个券选择
通过预期收益率曲线变动的幅度和形状,对比不同信用等级、在不同市场交易品种的到期收益率,综合考虑流动性、票息、税收、可否回购等因素已决定债券价值的因素,发现市场中上等的相对投资价值。

重点考察的债券品种包括:a.在类属具有明确和预期的债券中长期收益率较高的债券;b.有较好流动性的债券;c.存在信用溢价优势的债券;d.较高债性或期权价值的可转债;e.收益率水平合理的新券或者市场尚未正确定价的品种新券。

1) 利率预期策略
基金管理人密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预测市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期,并根根据收益率曲线变化情况进行相应的债券组合期限结构策略如子弹型组合、哑铃型组合或阶梯型组合等。

2) 信用策略
基金管理人密切跟踪国债、金融债、企业(公司)债等不同债券种类的利差水平,结合各类券种税收状况、流动性状况以及发行人信用质量状况的分析,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间的配置比例。

个券选择层面,基金管理人自建“企业信用资料库(CBD)”,对所有有投资的信用品种进行详细的财务分析和非财务分析。财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评价;非财务分析方面(包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要采取实地调研和电话会议的形式实施。通过打分来评价该企业是低风险、高风险还是绝对风险的企业,重点投资于低风险的企业债券;对于高风险企业,有相应的投资限制;不投资于绝对风险的企业。

(3) 时机策略
① 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而使其高位的收益率水平将逐步向投资期限初期有所下降,通过债券的收益率的下降,进而获取较高的资本利得收益。

② 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

③ 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析,从而对利差水平的未来走势做出判断,从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时,可以买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券,通过两债券利差的缩小获得价差收益;当预期利差水平扩大时,可以买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券,通过两债券利差的扩大获得投资收益。

四、股指期货投资策略
本基金参与股指期货交易,以套期保值为目的,制定相应的投资策略。

1. 时点选择:基金管理人会在交易股指期货时,重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向和技术指标等因素。

2. 套保比例:基金管理人根据对指数点位区间判断,在符合法律法规的前提下,决定套保比例,再根据基金股票投资组合的贝塔值,具体得出参与股指期货交易的买卖头寸。

3. 合约选择:基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据,选择和基金组合相关性高的股指期货合约作为交易标的。

第九部分、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:
中证700指数×80%+中证全债指数×20%

使用上述业绩比较基准的主要理由为:
一、市场代表
中证700指数是由中证指数有限公司推出的中小盘股票指数,中证700指数的成份股由中证2000指数(中证中盘指数)和中证500指数(中证大盘指数)成份股一起构成;中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,两者均具有良好的市场代表性。

二、风格的一致
中证700指数是由中证指数公司推出的表征A股市场中、小市值股票的风格指数,与本基金的投资风格定位具有一致性。

三、复合基准构建的公允性
本基金是一只混合型基金,股票投资比例范围为基金资产的60%-95%,其中市场中性时的股票仓位为80%。本基金股票和债券投资的比较基准分别使用具有充分市场认同度的中证700指数和中证全债指数,股票和债券投资的比较基准在基金整体业绩比较基准的占比按照市场中性时两类资产的投资比例确定,可以比较公允地反映基金管理人投资管理能力的。

四、易于观测性
本基金的比较基准易于观察,任何投资者都可以使用公开的数据经过简单的算术运算获得比较基准,保证了基金业绩评价的透明性。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金基金管理人可以在与托管人协商一致并报中国证监会备案后,变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分、基金的风险收益特征

本基金是混合型基金,属于风险程度较高的投资品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金与债券型基金,低于股票型基金。本基金主要投资于中小盘股票,在混合型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。

第十一部分、基金投资组合报告(未经审计)

景顺长城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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行根据基金合同约定,已经复核了本报告投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至2015年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金投资组合概况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 219,795,487.80 | 87.20 |
| | 其中:股票 | 219,795,487.80 | 87.20 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金 | 21,150,831.62 | 8.39 |
| 7 | 其他资产 | 11,099,348.44 | 4.40 |
| 8 | 合计 | 252,045,667.86 | 100.00 |

2. 报告期末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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 174,539,472.66 | 73.94 |
| D | 电力、热力、燃气及生产 | 9,720,835.00 | 4.12 |
| D | 和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 8,493,647.00 | 3.60 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息技术业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 7,561,996.00 | 3.20 |
| L | 租赁和商务服务业 | 14,847,245.46 | 6.29 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| O | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,642,291.68 | 1.97 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 219,795,487.80 | 93.11 |

3. 报告期末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组合

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 300011 | 鼎汉技术 | 594,676 | 21,063,423.92 | 8.92 |
| 2 | 002174 | 游族网络 | 210,615 | 19,536,647.40 | 8.28 |
| 3 | 300009 | 安科生物 | 590,317 | 15,604,724.13 | 6.61 |
| 4 | 300058 | 蓝色光标 | 769,238 | 12,161,652.78 | 5.15 |
| 5 | 002364 | 中国电气 | 416,978 | 11,917,231.24 | 5.06 |
| 6 | 000613 | 丽珠集团 | 173,974 | 11,800,656.42 | 5.05 |
| 7 | 002296 | 辉瑞生物 | 528,293 | 11,157,548.16 | 4.73 |
| 8 | 300115 | 康盛药业 | 331,901 | 11,055,622.31 | 4.68 |
| 9 | 300072 | 三聚环保 | 322,577 | 10,870,844.90 | 4.61 |
| 10 | 600625 | 长安集团 | 492,891 | 10,138,767.87 | 4.30 |

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资组合