（上接B41版）

（68）上海天天基金销售有限公司
注册地址：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3C座10楼
法定代表人：其实
联系人：潘世友
电话：021-54509998
传真：021-64385308
客服电话：400-1818-188
网址：http://www.1234567.com.cn
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。
二、注册登记人
名　称：景顺长城基金管理有限公司
住　所：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：北京市金诚同达律师事务所
住　所：北京建国门内大街22号华夏银行11层
负责人：田予
电　话：010-85237766
传　真：010-65185057
经办律师：贺定银、徐志浩
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）
住所：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
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
法定代表人：吴港平
电话：（010）58153000、（0755）25028288
传真：（010）85188298、（0755）25026188
经办注册会计师：昌华、陈立群
四、基金的名称
景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金
五、基金的类型
契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金重点投资于具有较高内在投资价值的大型蓝筹上市公司，在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。
七、基金的投资方向
本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。
本基金投资组合的比例范围为：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5%-30%，权证投资0-3%。持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。
八、基金的投资策略
一、投资管理的决策依据
本基金依据以宏观经济分析模型（MEM）为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，运用景顺长城“股票研究数据库（SRD）”等分析系统及FVMC等选股模型作为个股选择的依据，同时依据景顺长城风险管理系统和绩效评估系统进行投资组合的调整。
二、投资管理的方法和标准
1、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，经投资决策委员审核后形成资产配置方案。
本基金为一只高持股的股票型基金，对于股票的投资不少于基金资产的70%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。
2、股票投资策略
本基金中所谓之蓝筹股，是指那些市值较大、业绩优良、在行业内居于龙头地位并对所在证券市场指数起到相当大影响的上市公司股票。其中，按照股票风格的不同又可具体划分为稳健蓝筹股和成长蓝筹股两类。
本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，以市值规模和流动性为基础，重点投资于在行业内居于领导地位、具有较强的盈利能力和分红派现能力的稳健蓝筹公司以及在行业内具有较强竞争优势、成长性好的成长蓝筹公司。
针对上述两类公司股票价格驱动因素的不同，本基金分别以价值和GARP（Growth at Reasonable Price）原则为基础，精选出具有投资价值的股票构建股票组合。
3、债券投资策略
本基金的债券投资采取利率预期策略、流动性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为投资者获取稳定的收益。
本基金采用宏观经济分析模型(MEM)对经济数据评分，分析经济和金融运行情况，重点关注利率走势，判断收益率曲线的变动趋势。在此基础上，确定投资组合久期。本基金依市场规模、收益率、流动性等标准，评估债券的投资潜力和回报趋势。在风险控制上，利用风险评估系统适时评估投资组合，切实控制各种风险以优化投资组合。
4、权证投资策略
本公司将在有效进行风险管理的前提下，通过对权证标的证券的基本面研究，并结合期权定价模型估计权证价值，谨慎进行投资。
本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。
具体投资流程如下：
（1）研究人员对权证的标的股票运用我公司FVMC等模型进行分析，并得出标的股票合理目标价。
（2）研究人员根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算权证当前的理论价格和未来目标价格。
（3）由投资研究联席会议集体讨论研究人员对该权证的投资建议，讨论通过的列入买入名单，订立目标价格和止损价格，并设定持有时限。
（4）基金经理在授权范围内实施对该权证的投资。
（5）本基金投资权证必须遵守《景顺长城基金管理有限公司关于所管理的证券投资基金运用基金财产投资权证的公告》中的各项规定。
九、基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准为沪深300指数×80%＋中国债券总指数×20%。
使用上述业绩比较基准的主要理由为：
1、风格的一致性
沪深300指数是由中证指数有限公司推出的以上海和深圳证券市场规模最大、流动性良好的300只A股为样本编制的成分股指数，与本基金的投资风格定位具有一致性。
2、复合基准构建的公允性
本基金是一只高持股率的基金，股票投资比例范围为基金资产的70-95%，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沪深300指数和中国债券总指数，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的投资管理能力。
3、易于观测性
本基金的比较基准易于观察，任何投资人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。
如果本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布，本基金的管理人可以在与托管人协商一致并报备中国证监会后，使用其他可以合理的作为业绩比较基准的指数代替原有指数。
如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、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，本基金的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。
十、基金的风险收益特征
本基金是风险程度高的投资品种。
一、各类别风险定义
1、投资组合风险
在基金日常管理风险过程中，由投资部对投资组合风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种：
（1）系统性风险：基金在投资中因市场原因而无法规避的风险；
（2）行业配置风险：基金中某行业投资比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险；
（3）证券选择风险：基金中某只股票的持仓比例出现与基准的较大偏差而可能产生的风险；
（4）风格风险：基金在投资风格上与基准之间产生偏差，偏重于某种风格而产生的风险。
2、个股风险
在基金日常管理风险过程中，由投资部对个股风险进行监控和管理。此类风险主要包括以下几种：
（1）财务风险：基金在投资过程中，由于对上市公司基本面特别是财务状况判断出现失误，造成基金资产净值受损的风险；
（2）流动性风险：基金资产不能迅速、低成本地转变成现金，或者不能应付可能出现地投资者大额赎回的风险；
（3）价格风险：在一定时间期限内，当基金中某只证券的二级市场股票价格波动幅度超出一定比例。
3、衍生工具风险
在基金日常管理风险过程中，由投资部对个股风险进行监控和管理。目前，此类风险主要指由权证投资引发的风险。
4、作业执行风险
在基金日常管理风险过程中，由运营部及法律、监察稽核部对作业风险进行实时预警与监控。此类风险主要包括基金在日常操作中出现违反法规或公司相关管理制度，或者交易执行中的操作失误以及信息系统故障产生的风险。
二、风险管理措施
1、投资组合风险
本公司运用国际通行的风险管理系统，以跟踪误差为核心，建立一整套评估指标测量、分析跟踪误差的构成，判断风格因素、行业因素、个股因素对跟踪误差的影响。同时，运用国际通行的回报分析系统将基金的超额回报/风险分解为时机选择、风格选择、行业选择、个股选择四类回报，有效地帮助基金管理人了解超额回报来源以及相应承受的风险水平，为基金管理人资产调整提供参考性的指引，以实现在有效控制组合风险的情况下获取更高的超额收益。
2、个股风险
（1）财务风险。本公司投资以基本面为基础，个股的挑选不仅注重盈利的成长动能以及价值评估，还重视个股的财务风险。通过景顺长城“股票研究数据库（SRD）”，详尽评估公司的财务状况，包括资产负债结构、现金流状况、营运状况、盈利能力等，并通过对所投资品种的实地调研及公司业绩的合理性分析，有效规避可能的财务风险。
（2）流动性风险。流动性风险管理的具体指标是行业集中度、个股集中度和流动性比率。
（3）价格风险。建立并执行实时价格异常监控机制，任何异常变化将通知相关研究人员分析调查。
3、衍生工具风险
对权证投资风险所采取的风险管理措施主要包括：
（1）制定权证投资管理制度，并根据实际情况进行更新调整。
（2）严格执行公司的投资管理制度。
（3）对权证市场进行充分研究并定期对权证投资进行风险和绩效评估。
4、作业执行风险
作业执行风险识别与衡量的具体指标是法规限制和投资比例限制。本公司信息系统除定期进行数据备份之外，并定有灾难回复计划（Business Recovery Plan），确保公司操作系统可以在重大灾难发生后，迅速回复运作，以确保客户权益。
十一、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规定，已经复核了本投资组合报告，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2013年3月31日。
1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,163,913,323.19	87.78
	其中：股票	7,163,913,323.19	87.78
2	固定收益投资	249,865,000.00	3.06
	其中：债券	249,865,000.00	3.06
	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	740,089,051.37	9.07
6	其他资产	7,754,556.44	0.10
7	合计	8,161,621,931.00	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、渔业	11,969,859.78	0.15
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,293,839,918.33	52.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,540,000.00	0.79
E	建筑业	43,279,932.92	0.53
F	批发和零售业	445,535,670.80	5.48
G	交通运输、仓储和邮政业	361,462,023.80	4.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,124,952,801.55	13.83
J	金融业	115,657,454.24	1.42
K	房地产业	253,086,939.07	3.11
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	449,588,722.70	5.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,163,913,323.19	88.06

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明细

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	000999	华润三九	14,417,207	461,350,624.00	5.67
2	000400	许继电气	15,819,759	417,641,637.60	5.13
3	002065	东华软件	22,563,712	391,706,040.32	4.81
4	600594	益佰制药	13,000,000	384,150,000.00	4.72
5	000826	桑德环境	13,127,770	374,272,722.70	4.60
6	600196	复星医药	29,075,393	351,812,255.30	4.32
7	002241	歌尔声学	5,600,000	282,240,000.00	3.47
8	600406	国电南瑞	19,166,087	279,824,870.20	3.44
9	600104	上汽集团	18,641,855	275,899,454.00	3.39
10	600804	鹏博士	29,597,792	231,158,755.52	2.84

4. 报告期末按债券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	249,865,000.00	3.07
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	249,865,000.00	3.07

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	1001042	10央行票据42	1,500,000	149,955,000.00	1.84
2	1001069	10央行票据69	1,000,000	99,910,000.00	1.23

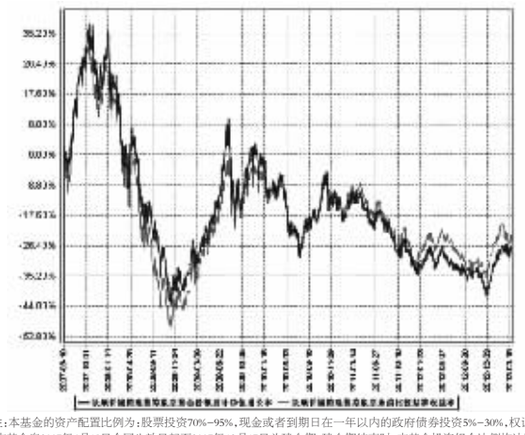
6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未投资股指期货。
本基金投资股指期货的投资政策
根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。
9. 投资组合报告附注
9.1
本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
9.2
本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,271,558.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,339,675.33
5	应收申购款	143,323.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,754,556.44

9.4 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。
9.5 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。
十二、基金业绩
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。基金业绩数据截至2013年3月31日。
1、 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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	①-③	②-④
2007年6月18日至2007年12月31日	28.00%	1.52%	24.24%	1.72%	3.76%	-0.20%
2008年	-52.66%	2.24%	-55.74%	2.44%	3.08%	-0.20%
2009年	65.02%	1.86%	72.85%	1.65%	-7.83%	0.21%
2010年	-13.80%	1.49%	-9.36%	1.27%	-4.44%	0.22%
2011年	-21.81%	1.06%	-19.41%	1.04%	-2.40%	0.02%
2012年	0.89%	1.05%	6.87%	1.02%	-5.98%	0.03%
2013年1月1日至2013年3月31日	6.18%	1.25%	-0.54%	1.24%	6.72%	0.01%
2007年6月18日至2013年3月31日	-27.80%	1.59%	-26.19%	1.58%	-1.61%	0.01%

2、累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较



注：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5%-30%，权证投资0%-3%。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。建仓期结束时，本基金投资组合比例均达到上述要求。
十三、基金费用概览
一、与基金运作有关的费用
（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×2.5‰÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
上述一、基金费用的种类中第3－7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（四）费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
（五）基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
二、与基金销售有关的费用
（一）基金认购费用
（1）本基金认购费率按照有效认购申请确认金额所对应的费率计算。费率表如下：

认购金额（M）	认购费率
M<50万	2.0%
50万≤M<500万	1.0%
500万≤M<1000万	0.5%
M≥1000万	按笔收取,1000元/笔

（2）计算公式
本基金认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算公式为：
净认购金额=认购金额/（1+认购费率）；
认购费用=认购金额-净认购金额；
认购份额=（净认购金额+认购利息）/基金份额面值。
基金认购份额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
（二）基金申购费用
（1）本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
本基金的申购费率不高于1.5%，随申购金额的增加而递减，适用以下前端收费费率标准：

申购金额（M）	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.2%
500万≤M<1000万	0.6%
M≥1000万	按笔收取,1000元/笔

（2）计算公式
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：
净申购金额=申购金额/（1+申购费率）；
申购费用=申购金额-净申购金额；
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值。
基金申购份额保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
（三）基金赎回费用
（1）本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，扣除用于市场推广、注册登记费和其他手续费后的余额归基金财产。本基金赎回费的25%归入基金财产所有。
本基金的赎回费率不高于0.5%，随持有期限的增加而递减。

持有期	赎回费率
1年以内	0.5%
1年以上（含1-2年	0.25%
2年以上（含）	0

注：就赎回费而言，1年指365天，2年指730天。
（2）计算公式
本基金采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的基金份额净值为基准进行计算，计算公式：
赎回总额 ＝ 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值；
赎回费用 ＝ 赎回总额 × 赎回费率；
赎回金额 ＝ 赎回总额 － 赎回费用。
基金赎回金额保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。
（四）基金转换费用
（1）本基金的转换费用包括了基金转出时收取的赎回费和基金转入时收入的申购补差费，其中赎回费的收取标准遵循本招募说明书的约定，申购补差费的收取标准为：申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】。
（2）计算公式
①基金转出时赎回费的计算：
由股票基金转出时：
转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值
由货币基金转出时：
转出总额＝转出份额×转出基金当日基金份额净值+待结转收益（全额转出时）
赎回费用＝转出总额×转出基金赎回费率
转出净额＝转出总额－赎回费用
②基金转入时申购补差费的计算：
净转入金额＝转出净额－申购补差费
其中，申购补差费＝ MAX【转出净额在转入基金中对应的申购费用－转出净额在转出基金中对应的申购费用，0】
转入份额＝净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值
十四、对招募说明书更新部分的说明
1、在“第三部分、基金管理人”部分，更新了基金管理人基本情况、主要人员情况和投资决策委员会委员的相关信息；
2、在“第四部分、基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；
3、在“第五部分、相关服务机构”部分，更新了代销机构的相关信息；
4、在“第六部分、基金的申购、赎回、转换及其他注册登记业务”部分，更新了基金定期定额投资计划相关的信息；
5、在“第七部分、基金的投资”部分，更新了基金的投资组合报告，数据截至2013年3月31日；
6、更新了“第九部分、基金的业绩”部分，数据截至2013年3月31日；
7、在“第二十部分、对基金份额持有人的服务”部分，更新了持有人交易资料的寄送、网上在线服务、客户服务中心电话服务、客户投诉受理服务的信息；
8、在“第二十一部分、其它应披露事项”部分，更新了近期发布的与本基金有关的公告目录，目录更新至2013年6月18日。

景顺长城基金管理有限公司
二〇一三年八月二日

（上接B42版）

（87）中金公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼27层及28层
法定代表人：李剑阁
联系人：蔡宇洲
联系电话：0755-82548240
网址：www.cicc.com.cn
（88）中山证券
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层
法定代表人：吴永良
联系人：李玲
客户服务电话：4001022011
网址：www.zszq.com.cn
（89）浙商证券
注册地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座
办公地址：浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6/7
法定代表人：吴承根
联系人：李凌芳
联系电话：021-64718888-1801
客户服务电话：0571967777
传真：021-64713759
网址：www.stocke.com.cn
（90）中投证券
注册地址：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18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
联系电话：0755-82023442
客户服务电话：400-600-8008
传真：0755-82026539
网址：www.china-invs.cn
（91）中信建投证券
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
开放式基金咨询电话：400-8888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
网址：www.csc108.com
（92）中信证券
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
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：陈忠
联系电话：010-60838888
传真：010-60833739
网址：www.citic.com
（93）中信证券（浙江）
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：王霈霈
联系电话：0571-87112507
客户服务电话：96598
传真：0571-85783771
网址：www.bigsun.com.cn
（94）中信万通证券
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客户服务电话：95548
传真：0532-85022605
网址：www.zxwt.com.cn
（95）中银国际证券
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39-40层
法定代表人：许刚
联系人：李丹
开放式基金咨询电话：400-620-8888
开放式基金业务传真：021-50372474
网址：www.bocichina.com
（96）中原证券
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：管明军
联系人：陈利民
联系电话：0371-65585287
开放式基金咨询电话：0371-967218、4008139666
开放式基金业务传真：0371--65585665
网址：www.ccnew.com
（97）泛华普益
注册地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
办公地址：四川省成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人：于海锋
联系人：邓鹏
联系电话：028-82000996-828
客户服务电话：4008878566
传真：028-82000996-805
公司网址：www.pyfund.cn
（98）好买基金
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
联系电话：021-58870011
客户服务电话：400-700-9665
传真：021-68596916
网址：www.ehowbuy.com
（二）基金注册登记机构
基金注册登记机构：易方达基金管理有限公司
注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
法定代表人：叶俊英
电话：400 881 8088
传真：020-38799249
联系人：余贤高
（三）律师事务所和经办律师
名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14层
负责人：廖海
联系电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：廖海、田卫红
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：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：吴港平
电话：010-58153000
传真：010-85188298
经办注册会计师：昌华、周刚
联系人：许建辉
四、基金的名称
本基金名称：易方达科讯股票型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型：契约型开放式
六、基金的投资目标
根据市场环境变化，综合运用多种投资策略，追求基金资产的长期稳健增值。
七、基金的投资方向
本基金的投资范围为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、债券、权证、资产支持证券、货币市场工具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其它品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
本基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券、资产支持证券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。
八、基金的投资策略
1. 资产配置策略
本基金为股票型基金，基金各类资产的投资比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券、资产支持证券、权证、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。
在以上战略性资产配置的基础上，本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，进行战术性资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，追求更高收益，回避市场风险。
在资产配置中，本基金主要考虑（1）宏观经济因素，包括GDP增长率及其构成、CPI、市场利率水平变化、货币政策等，以判断经济周期对市场的影响；（2）微观经济因素，包括各行业主要企业的盈利变化情况及其盈利预期；（3）市场因素，包括股票及债券市场的涨跌、市场整体估值水平、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。
2. 股票投资策略
本基金将综合应用多种投资策略，广泛地分析、研究、比较市场中的各种投资机会，选择收益相对较高、风险可控的投资品种进行投资，以提高本基金相对比较基准的超额收益。一般情况下，本基金以优势企业策略和成长策略为主，辅以行业周期策略、绝对价值策略、突发事件/收购兼并策略以及新兴技术策略。在特定的市场情况下，后四种策略中一种或多种的资金容量较大、不确定性较小、收益预期较高时，也可成为主策略。
（1）优势企业策略
在本策略下，本基金选择具有较强核心竞争力的企业进行投资并长期持有。企业的核心竞争力主要体现在：
□企业拥有知名品牌，客户忠诚度高；
□企业的技术领先、创新能力较强；
□企业的经营成本低于主要的竞争对手；
□企业由于对稀缺或不可替代资源的占有、拥有特许经营牌照、在规模经济明显的行业中经营规模位居前列、已拥有较广泛的销售网络等原因，在行业中占据垄断地位；
□企业拥有一只管理能力较强的管理团队，专业、尽职，能正确制定企业发展战略，并创造较好的企业绩效。
优势企业的主要财务特征是：企业营业利润率、净资产收益率在行业内位居前列，并将在未来继续保持这一趋势；即使在行业低谷期，优势企业的盈利波动也小于行业内大多数企业。
本基金将以合理价格或股价低估时、买入优势企业，并长期持有，与企业共同成长。当企业的核心竞争力发生实质不利变化时，出售股票。
（2）成长企业策略
本基金采取自下而上的方式，重点发掘具有以下特征的企业：企业产品与服务具有较大的市场空间；生产性企业的生产能力持续扩张或闲置产能不断得到利用，服务类企业营业网点、业务范围等服务能力持续增加，营业收入不断增长。本基金将对上市公司的产量、在建产能/现有产能、营业网点数量、营业额的数据进行统计，根据行业特征，选取适当的反映生产能力的指标进行分析，选取在未来一到两年收入与盈利或长速度高于行业平均水平，而且股价未明显高估的公司进行投资。
（3）行业周期策略
在本策略下，本基金重点把握两个阶段的投资机会。一个是在行业低谷期，行业景气持续低迷，产品价格、产销量和企业效益下滑，已开始有企业退出该行业。本基金预期行业情况难以继续大幅恶化，而股价已充分或过度反映了基本面的不利影响，一旦行业景气回升，企业净利润将会大幅增加。另一投资机会是在行业景气上升周期，行业景气好转已确立，企业效益、产品价格、产销量出现普遍上升，本基金预期行业景气将会持续。在本策略下，本基金将重点投资于企业效益对行业景气敏感度较高的公司。
（4）绝对价值策略
绝对价值策略指的是，根据行业和企业特点，寻找对企业的绝对价值进行评估的合理估值方法，包括账面价值法、重置成本法和分拆出售法等。当企业的绝对价值高于企业总市值，而且企业价值重估的诱发性因素有可能出现时，本基金将对此类公司进行投资。
（5）突发事件/收购兼并策略
在此策略下，本基金将关注突发事件以及收购兼并信息对公司股价的影响。如果突发事件对企业盈利能力产生短暂的不利影响，但市场过度反应造成股价大幅下跌，已低于其合理估值时，本基金可对此类公司进行投资。此外，在公司合告收购兼并信息后，本基金将分析收购兼并事件对企业盈利能力造成的实质影响。当股票价格未充分反映收购兼并给企业带来的正面效应时，本基金将对此类公司进行投资。
（6）新兴技术策略
在此策略下，本基金将重点关注有可能出现重大技术突破的领域，如生物、医药、电子通讯、环保、新材料等。这些领域的新技术开发难度大、进入壁垒高，一旦转化为生产力，将会带来巨大的市场需求和企业效益的高速增长。本基金将密切跟踪这些领域中技术水平处于前列的公司，了解其技术开发进度以及采用新技术产能的建设进度，在技术突破即将实现而股价未充分反映之前，进行投资。
本基金将综合运用以上策略进行股票选择，根据对各种策略的收益与风险的判断、投资品种资金容量的分析，进行组合的构造与调整。
3. 债券投资策略
在债券投资方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次，结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析，根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征，定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。
在券种选择上，本基金以长期利率趋势分析为基础，结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，合理运用投资管理策略，实施积极主动的债券投资管理。
在可转债方面，本基金将投资具有较高成长性或正股价格被低估公司发行的可转债；投资折价交易或底价溢价率较低的可转债，在接近强制赎回点时卖出；及时把握可转债与股票的套利机会；根据中签率预测和模型定价结果，积极参与可转债新券申购等。基金管理人将动态监控可转债发行主体的信用状况，及时抛售主体信用状况有恶化迹象的可转换债券。
随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁，更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式，本基金会密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。
4. 权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。
九、基金的业绩比较基准
沪深300指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
十、基金的风险收益特征
本基金是主动股票型基金，理论上其风险收益水平高于混合型基金和债券基金。
十一、基金投资组合报告(未经审计)
本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。
本基金的托管人交通