

(上接B118版)

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未持有股指期货。

9.2 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,本基金的投资范围不包括股指期货。

10. 报告期末本基金的国债期货交易情况说明

10.1 本基金国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金的投资范围不包括国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未持有国债期货。

10.3 本基金国债期货投资评价

本基金报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告注释

11.1

本报期内尚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。

11.2

本基金报告的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 应收利息 | 677,634.71 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,133,147.99 |
| 3 | 应收股利 | |
| 4 | 应收租金 | 7,171,504.93 |
| 5 | 应收申购款 | 36,605.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 应付费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 18,017,892.72 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末十名股东中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股东中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其文字描述部分

无。

十四、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仔细阅读本系列基金的招募说明书和更新招募说明书。

基金经理由银行理财产品根据基金合同规定,已经复核了下列财务指标、净值表现等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理复核日期为2016年3月31日。

优胜组合型基金的净值表现

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表

| 阶段 | 份额净值收益率 (%) | | 份额净值增长率标准差 (%) | | 业绩比较基准收益率 (%) | | 业绩比较基准收益率标准差 (%) | | ①-③ | ②-④ |
|-----------------------|-------------|---------|----------------|-------------|---------------|---------|------------------|-------------|---------|-------|
| | 净值增长(1) | 净值增长(2) | 业绩比较基准收益(3) | 业绩比较基准收益(4) | 净值增长(5) | 净值增长(6) | 业绩比较基准收益(7) | 业绩比较基准收益(8) | | |
| 2005年7月1日至2005年12月31日 | 0.8862% | 0.0033% | 0.8384% | 0.0000% | 0.0478% | 0.0033% | 0.75% | 0.01% | 3.14% | 0.34% |
| 2006年1月1日至2006年12月31日 | 1.8290% | 0.0029% | 1.8798% | 0.0003% | -0.0508% | 0.0026% | 0.68% | 0.01% | 2.82% | 0.67% |
| 2007年1月1日至2007年12月31日 | 3.1186% | 0.0057% | 2.7851% | 0.0019% | 0.3335% | 0.0036% | 0.31% | 0.02% | -3.98% | 0.60% |
| 2008年1月1日至2008年12月31日 | 3.4788% | 0.0055% | 3.7621% | 0.0012% | -0.2883% | 0.0043% | 1.16% | 0.01% | 116.40% | 1.15% |
| 2009年1月1日至2009年12月31日 | 1.973% | 0.0036% | 2.2500% | 0.0006% | -1.052% | 0.0062% | 5.63% | 0.02% | 88.36% | 1.68% |
| 2010年1月1日至2010年12月31日 | 1.1310% | 0.0042% | 1.6434% | 0.0012% | -0.512% | 0.0036% | 0.99% | 0.02% | -50.27% | 1.63% |
| 2011年1月1日至2011年12月31日 | 2.2634% | 0.0042% | 1.4979% | 0.0015% | 0.8037% | 0.0041% | 1.12% | 0.02% | -10.71% | 0.43% |
| 2012年1月1日至2012年12月31日 | 3.3451% | 0.0037% | 1.4718% | 0.0026% | 1.927% | 0.0038% | 5.66% | 0.02% | 7.70% | 0.43% |
| 2013年1月1日至2013年12月31日 | 3.5293% | 0.0040% | 1.3590% | 0.0000% | 2.1739% | 0.0046% | 10.53% | 0.02% | 14.28% | 0.54% |
| 2014年1月1日至2014年12月31日 | 4.1998% | 0.0051% | 2.0360% | 0.0006% | 2.8499% | 0.0151% | 2.05% | 0.02% | -21.28% | 0.39% |
| 2015年1月1日至2015年12月31日 | 3.1473% | 0.0048% | 1.3590% | 0.0006% | 1.7973% | 0.0084% | 20.27% | 0.12% | 11.78% | 1.17% |
| 2016年1月1日至2016年3月31日 | 0.5565% | 0.0034% | 0.3357% | 0.0000% | 0.2208% | 0.0034% | -12.23% | 0.23% | 1.22% | 0.59% |
| 2005年7月1日至2016年3月31日 | 32.6483% | 0.0066% | 20.4219% | 0.0022% | 12.226% | 0.0046% | 26.67% | 1.34% | 58.85% | 0.58% |

2.自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



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0%至20%;债券投资和现金的比例为基金资产净值的80%至100%。经报中国证监会批准,本基金于2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场基金。

本基金报告期末前十名股东中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其文字描述部分

无。

五、基金费用

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仔细阅读本系列基金的招募说明书和更新招募说明书。

基金经理由银行理财产品根据基金合同规定,已经复核了下列财务指标、净值表现等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

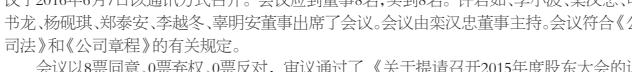
基金经理复核日期为2016年3月31日。

优胜组合型基金的净值表现

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表

| 阶段 | 份额净值收益率 (%) | | 份额净值增长率标准差 (%) | | 业绩比较基准收益率 (%) | | 业绩比较基准收益率标准差 (%) | | ①-③ | ②-④ |
|------------------------|-------------|---------|----------------|-------------|---------------|---------|------------------|-------------|-----|-----|
| | 净值增长(1) | 净值增长(2) | 业绩比较基准收益(3) | 业绩比较基准收益(4) | 净值增长(5) | 净值增长(6) | 业绩比较基准收益(7) | 业绩比较基准收益(8) | | |
| 2005年12月31日至2006年3月31日 | 6.75% | 0.62% | 4.62% | 0.97% | 2.13% | -0.35% | | | | |
| 2006年4月1日至2006年6月30日 | 7.63% | 0.95% | -12.93% | 1.07% | 20.36% | -0.12% | | | | |
| 2006年7月1日至2006年9月30日 | 3.32% | 0.93% | -5.73% | 1.12% | 8.59% | -0.10% | | | | |
| 2006年10月1日至2006年12月31日 | 13.80% | 1.19% | 92.4% | 1.07% | 37.84% | 0.12% | | | | |
| 2007年1月1日至2007年3月31日 | 96.12% | 1.78% | 79.88% | 1.76% | 16.32% | 0.02% | | | | |
| 2007年4月1日至2007年6月30日 | 51.92% | 2.19% | -54.4% | 2.28% | 2.82% | -0.09% | | | | |
| 2007年7月1日至2007年9月30日 | 53.26% | 1.49% | 64.78% | 1.53% | -11.53% | -0.04% | | | | |
| 2007年10月1日至2007年12月31日 | -1.09% | 1.06% | -7.75% | 1.15% | 6.44% | 0.15% | | | | |
| 2008年1月1日至2008年3月31日 | -19.82% | 1.01% | -18.76% | 0.96% | -1.16% | 0.05% | | | | |
| 2008年4月1日至2008年6月30日 | 14.29% | 1.11% | 3.07% | 0.92% | 11.22% | 0.19% | | | | |
| 2008年7月1日至2008年9月30日 | 39.67% | 1.35% | -1.04% | 0.94% | 40.73% | 0.41% | | | | |
| 2008年10月1日至2008年12月31日 | 9.40% | 1.17% | 39.95% | 0.84% | -30.55% | 0.35% | | | | |
| 2009年1月1日至2009年3月31日 | 61.02% | 2.67% | 20.38% | 1.95% | 40.44% | 0.72% | | | | |
| 2009年4月1日至2009年6月30日 | -17.75% | 2.91% | -12.13% | 2.16% | -5.45% | 0.75% | | | | |
| 2009年7月1日至2009年9月30日 | 625.82% | 1.53% | 152.32% | 1.40% | 473.50% | 0.15% | | | | |

2.自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动的比较



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0%至20%;债券投资的比例为基金资产净值的20%至100%。经报中国证监会批准,本基金于2005年7月14日为转变基准日转变成为景顺长城货币市场证券投资基金。本基金自2010年4月30日起实行基金份额分拆后调整基金合同有关条款的约定,本基金证券投资基金的调整期限延长至2007年10月9日止。建仓期结束后,本基金的资产配置比例达到上述投组合比例的要求。

11.7 投资组合报告附注的其文字描述部分

无。