



# 信息披露 Disclosure

## 景顺长城大中华股票型证券投资基金

### 2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一二年一月二十日

#### §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股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月18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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告自2011年10月11日起至12月31日止。

#### §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                    |
|------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 景顺长城大中华股票(QDII)                                                                                                                                    |
| 交易代码       | 262001                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日    | 2011年9月22日                                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 53,220,334.33份                                                                                                                                     |
| 投资目标       | 本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场的大中华企业,追求长期资本增值。                                                                                                    |
| 投资策略       | 本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略,在实际投资组合的构建上更强调“自下而上”的部分,重点投资于处于合理价值的成长型股票(Growth at Reasonable Price, GARP),以及受宏观经济周期增加且具合理价值的周期性股票(cyclicals)。 |
| 业绩比较基准     | 本基金业绩比较基准为摩根士丹利全球净收益指数 (MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。                                                                                |
| 风险收益特征     | 本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。                                                                                                                        |
| 基金管理人      | 景顺长城基金管理有限公司                                                                                                                                       |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司                                                                                                                                       |
| 境外投资顾问     | 英文名称: Overseas Hong Kong Limited<br>中文名称:  Overseas Hong Kong Limited                                                                              |
| 境外资产托管人    | 英文名称: Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited<br>中文名称: 渣打银行(香港)有限公司                                                                            |

#### §3 主要财务指标和基金净值表现

|                |               |
|----------------|---------------|
| 主要财务指标         | 单位:人民币元       |
| 1.本期已实现收益      | -302,459.10   |
| 2.本期利润         | -2,564,626.32 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0484       |
| 4.期末基金资产净值     | 50,783,726.12 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.954         |

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

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本报告期主要财务指标与基金净值表现

注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现  
2011年4季度,本基金份额净值增长率为-4.60%,低于业绩比较基准收益率9.62%。

#### §5 投资组合报告

|     |          |               |              |
|-----|----------|---------------|--------------|
| 序号  | 项目       | 金额(人民币元)      | 占基金总资产的比例(%) |
| 1   | 权益投资     | 48,201,990.38 | 91.17        |
| 1.1 | 其中:普通股   | 46,908,130.37 | 88.73        |
| 1.2 | 存托凭证     | 1,293,859.38  | 2.45         |
| 2   | 固定收益投资   | -             | -            |
| 3   | 金融衍生品投资  | -             | -            |
| 4   | 买入返售金融资产 | -             | -            |
| 5   | 资产支持证券   | -             | -            |
| 6   | 金融衍生品投资  | -             | -            |
| 7   | 其他资产     | 66,404.38     | 0.13         |
| 8   | 合计       | 52,868,890.94 | 100.00       |

5.2 报告期末在不同国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

|         |               |              |
|---------|---------------|--------------|
| 国家(地区)  | 公允价值(人民币元)    | 占基金资产净值比例(%) |
| 香港特别行政区 | 27,481,056.05 | 54.11        |
| 台湾地区    | 18,786,791.16 | 36.99        |
| 美国      | 1,934,143.17  | 3.81         |
| 合计      | 48,201,990.38 | 94.92        |

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资分布

|          |               |              |
|----------|---------------|--------------|
| 行业类别     | 公允价值(人民币元)    | 占基金资产净值比例(%) |
| 基础材料     | 283,745.00    | 0.56         |
| 信息技术     | 7,112,631.99  | 14.01        |
| 消费品,周期性  | 11,104,681.29 | 21.87        |
| 消费品,非周期性 | 5,566,923.03  | 10.96        |
| 综合经营     | 304,012.50    | 0.60         |
| 能源       | 2,568,135.52  | 5.06         |
| 工业       | 6,534,704.09  | 12.87        |
| 金融       | 11,421,394.16 | 22.49        |
| 公用事业     | 3,305,563.80  | 6.51         |
| 合计       | 48,201,990.38 | 94.92        |

注:以上行业分类采用彭博行业分类标准。

5.4 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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文)                      | 公司名称(中文)     | 证券代码    | 所在证券市场  | 所在国家(地区) | 数量(股)   | 公允价值(人民币元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-------------------------------|--------------|---------|---------|----------|---------|--------------|--------------|
| 1  | PRESIDENT STORC               | 统一超商股份有限公司   | 2912.TW | 台湾证券交易所 | 台湾地区     | 107,000 | 3,673,912.23 | 7.23         |
| 2  | TENCENT HOLDINGS LTD          | 腾讯控股有限公司     | 700.HK  | 香港证券交易所 | 香港地区     | 23,700  | 2,999,241.42 | 5.91         |
| 3  | HAI PRECISION INDUSTRY        | 海精股份工业股份有限公司 | 2317.TW | 台湾证券交易所 | 台湾地区     | 156,000 | 2,691,164.14 | 5.30         |
| 4  | SINOMIL ENERGY CO.-H          | 中国林华能源控股有限公司 | 1088.HK | 香港证券交易所 | 香港地区     | 94,000  | 2,568,135.52 | 5.06         |
| 5  | VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS  | 威达国际控股有限公司   | 3331.HK | 香港证券交易所 | 香港地区     | 302,000 | 2,440,969.07 | 4.81         |
| 6  | CHINA CONSTRUCTION BANK-H     | 中国建设银行股份有限公司 | 039.HK  | 香港证券交易所 | 香港地区     | 526,000 | 2,311,203.84 | 4.55         |
| 7  | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS LTD | 瀚宇科技控股有限公司   | 2018.HK | 香港证券交易所 | 香港地区     | 152,000 | 2,149,068.40 | 4.23         |
| 8  | SUN HING KAI PROPERTIES       | 新鸿基地产代理有限公司  | 161.HK  | 香港证券交易所 | 香港地区     | 26,000  | 2,051,962.80 | 4.04         |
| 9  | MINTH GROUP LTD               | 美泰集团有限公司     | 425.HK  | 香港证券交易所 | 香港地区     | 330,000 | 1,930,300.99 | 3.84         |
| 10 | HOTAI MOTOR LTD               | 和泰汽车股份有限公司   | 2207.TW | 台湾证券交易所 | 台湾地区     | 63,000  | 1,907,500.23 | 3.76         |

注:本基金对以上股票投资采用彭博行业分类标准。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

5.6 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债券投资明细

5.7 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资产支持证券投资明细

5.8 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金融衍生品投资明细

5.9 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基金投资明细

5.10 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.11 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.12 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.13 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.14 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.15 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.16 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.17 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.18 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.19 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.20 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.21 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.22 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.23 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.24 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.25 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.26 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.27 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.28 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.29 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.30 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.31 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.32 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.33 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.34 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.35 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.36 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.37 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.38 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.39 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.40 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.41 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.42 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.43 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.44 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.45 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.46 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.47 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.48 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.49 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.50 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.51 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.52 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.53 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.54 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.55 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.56 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.57 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.58 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.59 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

5.60 本报告期末买入卖出基金的投资资产公允价值变动情况

## 银华永祥保本混合型证券投资基金

### 2011 第四季度 报告

2011年12月31日

基金管理人:银华基金管理有限公司  
基金托管人:中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期:2012年1月20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股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月18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。  
本报告自2011年10月1日起至12月31日止。

#### §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                           |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 银华永祥保本混合                                                                                                                                                                                                                  |
| 交易代码       | 180028                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                    |
| 基金合同生效日    | 2011年6月28日                                                                                                                                                                                                                |
| 报告期末基金份额总额 | 1,232,671,034.30份                                                                                                                                                                                                         |
| 投资目标       | 本基金采用投资组合保险技术,在确保保本到期时本金安全的基础上,通过保本资产和收益资产的动态平衡配置管理,实现组合资产的稳定增长和本期回报收益的最大化。                                                                                                                                               |
| 投资策略       | 本基金采用固定比例投资组合保险策略,其中主要通过CPPI策略动态调整保本资产与收益资产的投资比例,以确保本到期时本金安全。保本资产投资于流动性较好的某一目标资产,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。本基金在保本资产范围内,对固定收益资产的投资比例不低于40%,其中持有国债类资产的比例不低于10%;对权益类资产的投资比例不超过50%,其中持有股票类资产的比例不超过40%,其中基金持有全部权益资产的比例不超过基金资产净值的30%。 |
| 业绩比较基准     | 每个保本周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率。                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征     | 本基金属于                                                                                                                                                                                                                     |