

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

2007 年半年度报告

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期： 2007 年 8 月 28 日

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

本报告期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止。本报告中的财务资料未经审计。

目 录

第一章 基金简介	3
第二章 主要财务指标和基金净值表现.....	6
一、主要财务指标.....	6
二、基金净值表现.....	6
三、基金收益分配情况.....	7
第三章 管理人报告	8
第一节 基金管理人及基金经理情况.....	8
第二节 遵规守信情况说明.....	8
第三节 基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	8
第四节 宏观经济、证券市场及行业走势的展望.....	9
第四章 托管人报告	11
第五章 财务会计报告	12
第一节 基金会计报表.....	12
第二节 会计报表附注.....	14
第六章 投资组合报告	22
第七章 基金份额持有人情况.....	29
第八章 开放式基金份额变动情况.....	30
第九章 重大事件揭示	30
第十章 备查文件	33

第一章 基金简介

（一）基金基本资料

- 1、基金名称：景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）
- 2、基金简称：景顺鼎益
- 3、基金代码：162605（前端收费）、162606（后端收费）
- 4、基金运作方式：上市契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2005 年 3 月 16 日
- 6、报告期末基金份额总额：11,313,211,074.73
- 7、基金合同存续期：不定期
- 8、基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 9、上市日期：2005 年 5 月 25 日

（二）基金产品说明

1、投资目标：

通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。

2、投资策略：

I、投资管理的决策依据和决策程序

（1）投资决策依据

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，并运用景顺长城股票研究数据库(SRD)及 GVI 等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时，本基金运用多因素模型等分析工具，结合基金管理人的主观判断，根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。

（2）投资决策程序

(i) 投资决策委员会是公司投资的最高决策机构，以定期或不定期会议的形式讨论和决定基金投资的重大问题，包括确立各基金的投资方针及投资方向，审定基金财产的配置方案。投资决策委员会召开前，由基金经理依据对宏观经济走势的分析，提出基金的资产配置建议，交由投资决策委员会讨论。一旦作出决议，即成为指导基金投资的正式文件，投资部据此拟订具体的投资计划。

(ii) 投资部是负责管理基金日常投资活动的具体部门，投资总监除履行投资决策委员会执行委员的职责外，还负责管理和协调投资部的日常运作。基金经理根据投资决策委员会及投资研究联席会议决议具体承担基金的日常管理工作。

(iii) 风险控制委员会作为风险管理的决策机构，由各部门总监组成，负责公司整体运作风险的评估和控制，指导业务方向，并接受、审阅监察稽核报告，基于风险与回报对业务策略提出质疑。

(iv) 本基金决策投资过程为：

①由基金经理依据宏观经济、股市政策、市场趋势判断，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议；

②投资决策委员审核基金经理提交的资产配置建议，并最终决定资产配置方案；

③投资部从景顺长城股票研究数据库（SRD）中精选个股，依据本基金的投资策略，由投资研究联席会议集体决定个股配置方案；

④投资总监审核投资组合方案，如无异议，由基金经理具体执行投资计划。

II、投资管理的方法和标准

（1）资产配置

本基金是一只较高持股的股票型基金，对于股票的投资不少于基金财产的 60%，持有现金和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）投资管理方法

本基金管理人充分发挥“自下而上”的主动选股能力，通过定量的业绩归因分析深入发掘主动性回报的相关信息，适当加大选股因素的贡献度，借助投资组合优化技术实现投资风险与收益的最佳配比。

同时，借鉴国外风险管理的成功经验，采用国际通行的风险管理方法实现风险的识别、测度和控制，通过调整风险结构，突出股票选择能力，从而保证股票投资组合相对于基准指数的年跟踪误差在预定目标之内，将投资管理的主动性风险控制在合理的水平。

本基金在投资中利用多因素模型优化投资组合，将与行业、投资风格和市场敏感暴露度密切相关的非主观的风险因素控制在最低程度，借助主动选股获利，通过精选个股和优化组合两个环节增强超额收益。

（3）选股标准

本基金遵循基本面主动选股的原则，主要通过自下而上的基本面研究制定投资决策。通过选择基本面良好的优势企业的股票或估值偏低的股票，结合自上而下的宏观经济及政策分析、产业景气及产业政策分析，制定投资备选名单。对个股的选择以成长、价值及稳定收入为基础，依据 GVI 模型，选取价位合适的具有高成长性的成长型股票，价值被市场低估的价值型股票，以及能提供稳定收入的收益型股票。

3、业绩比较基准：

基金整体业绩比较基准=新华富时 A200 指数×80%+同业存款利率×20%。

4、风险收益特征：

本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。

（三）基金管理人

- 1、名称：景顺长城基金管理有限公司
- 2、注册及办公地址：深圳市深南中路 1093 号中信城市广场中信大厦 16 层
- 3、邮政编码：518031
- 4、网址：www.invescogreatwall.com
- 5、法定代表人：徐英
- 6、总经理：梁华栋
- 7、信息披露负责人：赵鹏
- 8、电 话：（0755）82370388-879
- 9、传 真：（0755）25987352
- 10、电子邮箱：xxpl@invescogreatwall.com
- 11、客户服务热线：4008888606 0755-82370688

（四）基金托管人

- 1、名称：中国银行股份有限公司
- 2、注册及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号
- 3、邮政编码：100818
- 4、网址：www.boc.cn
- 5、法定代表人：肖 钢
- 6、信息披露负责人：宁敏
- 7、电话：010-66594977
- 8、传真：010-66594942
- 9、电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

（五）信息披露

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报

登载半年度报告的基金管理人网址：www.invescogreatwall.com

半年度报告置备地点：基金管理人的办公场所

（六）其他有关资料

注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

第二章 主要财务指标和基金净值表现

重要提示：下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。

一、主要财务指标

序号	项目	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益（元）	1,543,145,920.14
2	加权基金份额本期净收益（元）	0.702
3	期末可供分配基金收益（元）	357,423,648.63
4	期末可供分配基金份额收益（元）	0.032
5	期末基金资产净值（元）	12,881,123,649.10
6	期末基金份额净值（元）	1.139
7	基金加权平均净值收益率	0.463
8	本期基金份额净值增长率	67.66%
9	基金份额累计净值增长率	311.78%

二、基金净值表现

1、本基金份额净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

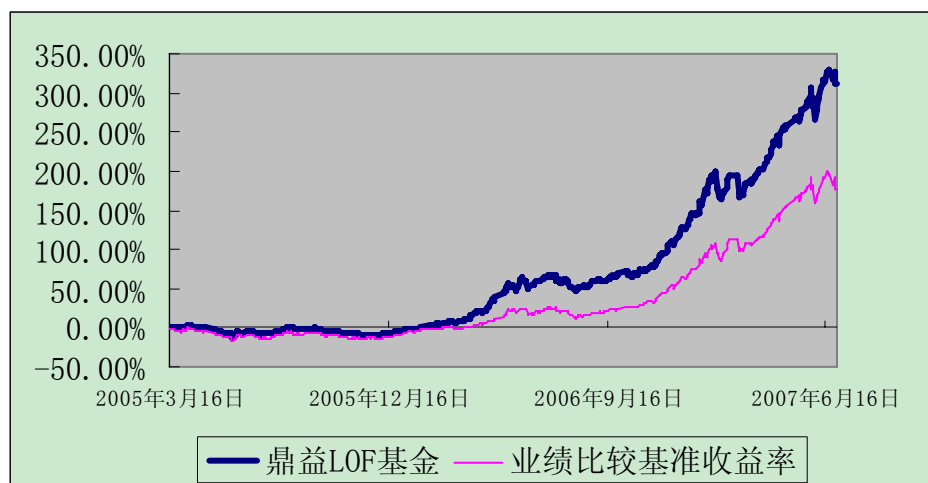
阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（2）	业绩比较基准收益率（3）	业绩比较基准收益率标准差（4）	（1）-（3）	（2）-（4）
过去 1 个月	4.30%	2.19%	-1.64%	2.42%	5.94%	-0.23%
过去 3 个月	36.63%	1.93%	27.70%	1.97%	8.93%	-0.04%
过去 6 个月	67.66%	2.10%	58.65%	1.99%	9.01%	0.11%
过去 1 年	150.08%	1.70%	122.54%	1.60%	27.54%	0.10%

自基金合同生效起至今	311.78%	1.39%	176.44%	1.32%	135.34%	0.07%
------------	---------	-------	---------	-------	---------	-------

2、本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比较

景顺鼎益基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2005 年 3 月 16 日至 2007 年 6 月 30 日）



备注：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 60%至 95%；债券投资和现金的比例为基金资产净值的 5%至 40%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2005 年 3 月 16 日合同生效日起至 2005 年 6 月 15 日为建仓期。建仓期满至今，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。

三、基金收益分配情况

年 度	每 10 份基金份额分红数	备 注
2005	无	
2006	9.200 元	共两次分红，第一次每 10 份基金份额分红 0.600 元，第二次每 10 份基金份额分红 8.600 元。
2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日	10.700 元	
合 计	19.900 元	

第三章 管理人报告

第一节 基金管理人及基金经理情况

一、基金管理人及其管理基金的经验

本基金的管理人景顺长城基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字〔2003〕76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦(集团)有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，目前各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。

截止 2007 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司管理景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金和景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金。其中景系列基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

二、基金经理简介

本基金采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。本基金聘任基金经理如下：

王新艳，中国人民银行总行研究生部硕士研究生，7 年基金业从业经验。1998 进入长盛基金管理有限公司，历任长盛基金管理公司分析师、基金经理助理，2002 年 10 月至 2004 年 5 月担任长盛成长价值开放式基金基金经理。2004 年 6 月加入本公司。

第二节 遵规守信情况说明

本报告期内，管理人对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各重大方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

第三节 基金投资策略和业绩表现的说明与解释

2007 年上半年沪深 300 指数上升 84.4%至 3764.08 点，上证综指上升 42.8%至 3820.70 点。宏观经济高速增长、牛市财富效应的全面扩散、上市公司盈利超预期增长等因素推动市场继续大幅度上升后，高估值水平的压力、针对充裕流动性的宏观调控措施以及打击市场违法违规行为等市场治理措施的影响导致市场从过热状态中逐步冷静，5 月底 6 月初市场进入调整阶段。

市场结构方面，绩差公司与小市值公司在高成长预期与重组预期的推动下，股价暴涨，市场表现远远超越大市值绩优公司，到 5 月中，超过 700 只股票涨幅在 100%以上；同样地，6 月的调整中这些股票的跌幅也远远超过大盘，大市值绩优公司则明显抗跌。

市场制度的变化值得关注，包括完善上市公司治理、打击内幕交易与市场操纵等违法违规行为、推动大市值蓝筹公司上市、基金规模超大型化趋势等。

本基金秉承价值投资理念，长期持有的优质蓝筹企业在上半年未超越基准，基金业绩增长一般。但我们认为，随着市场系统性风险增加，这些绩优蓝筹股发展前景明朗，风险防御能力也较强，有利于实现本基金追求长期稳健回报的投资目标。我们将坚持现有投资理念和风格，同时努力发掘新的投资机会，力争提升投资业绩。07 年上半年，本基金净值增长率为 67.66%，超越比较基准 9.01%。

第四节 宏观经济、证券市场及行业走势的展望

市场展望

从 05 年下半年到 07 年上半年，市场的连续上升已经持续了 24 个月，尤其是经过今年上半年的上升，整个市场的估值已经到了一定的高度，不仅绩差、小市值公司如此，绩优、大市值公司股价也多反应了未来 2 年的增长。尤其与周边市场相比，估值压力不容忽视，这是制约市场上升的最重要因素。

不过，过去两年推动市场上升的健康因素仍然存在，包括：快速稳健增长的宏观经济；人民币持续升值；宏观政策推动经济结构由“投资拉动”、“外需拉动”向“内需拉动”逐步转型；股改完成后上市公司具有更好的经济代表性；国有企业市值考核机制的逐步建立与成熟；以央企为龙头的资产注入与整合；上市公司管理层股权激励措施的逐步实施等等；这些因素对市场的推动作用仍然存在，不过，我们需要认清的是，这些因素产生影响的过程与时间会比市场预期的更长或更复杂，理性预期需要较长时间方能得以实现。

另外，针对可能过热的宏观经济及潜在的通胀压力和升值压力，宏观政策可能趋紧，不

可避免对经济结构和资本市场造成影响。而管理层对证券市场的针对性政策的主要目的仍将是保证健康发展，不会对市场产生根本的方向性的影响。

我们认为，市场将在高估值压力、趋紧的宏观政策、高盈利增速、优质资产注入与重组、股权激励等制度因素的共同驱动下，经过一定时间的结构性调整后有望继续向上。

投资策略

由于对中国经济增长的坚定信心，我们对 A 股市场的长期表现保持较为乐观的态度。同时，我们认识到目前市场估值水平偏高，整体市场风险也有较大程度的提高，但我们认为这些不利因素将通过上市公司盈利持续增长及市场自身调整双方向化解，因此短期市场震荡不会改变 A 股市场长期向好的格局，本基金将保持较高的股票资产配置比例。

由于宏观经济的持续、快速、健康的发展，目前国内各产业均体现出较好的增长趋势，因此估值水平和增长的持续性成为确定投资价值的关键因素。我们认为，金融服务、消费服务、装备制造、房地产及部分资本品类行业在这两方面体现出较强的比较优势，将成为本基金重点研究和配置的方向。此外，股权分置问题解决后，大量回归 A 股市场的优质蓝筹公司及通过外延式扩张获得新生的企业将大大丰富我们的投资选择。

第四章 托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2007 年 8 月 23 日

第五章 财务会计报告

第一节 基金会计报表

1、资产负债表（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	附注	<u>2007 年 6 月 30 日</u>	<u>2006 年 12 月 31 日</u>
银行存款	五、15	3,537,131,680.07	299,772,276.68
清算备付金		7,606,361.63	2,846,976.83
交易保证金		1,878,350.67	638,549.12
应收证券清算款		0.00	0.00
应收股利		6,084,837.13	0.00
应收利息	五、1	3,668,957.14	47,260.82
应收申购款		5,900.00	33,542,065.60
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值	五、3	8,695,593,566.89	1,758,991,367.42
其中：股票投资成本		9,024,633,519.88	1,433,372,071.12
债券投资市值	五、3	993,174,280.22	0.00
其中：债券投资成本		993,174,280.22	0.00
权证投资市值	五、3	24,381,082.54	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
待摊费用	五、2	0.00	0.00
资产总计		13,269,525,016.29	2,095,838,496.47

负债

应付证券清算款	五、16	350,832,501.20	0.00
应付赎回款		14,984,415.52	26,269,788.87
应付赎回费		56,522.10	99,017.54
应付管理人报酬		7,975,283.49	1,816,256.28
应付托管费		1,329,213.93	302,709.38
应付佣金	五、4	12,491,076.67	1,775,440.76
应付收益		0.00	0.00
其他应付款	五、5	502,300.00	500,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
预提费用	五、6	230,054.28	99,500.00
负债合计		388,401,367.19	30,862,712.83

持有人权益

实收基金	五、7	11,313,211,074.73	1,573,537,156.44
未实现利得	五、8	1,210,488,925.74	445,417,029.35
未分配收益		357,423,648.63	46,021,597.85
持有人权益合计		12,881,123,649.10	2,064,975,783.64
负债及持有人权益总计		13,269,525,016.29	2,095,838,496.47

基金份额净值	1.139	1.312
--------	-------	-------

2、经营业绩表及收益分配表（除特别注明外，金额单位为人民币元）

		2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间
收入			
股票差价收入	五、9	1,551,778,351.49	65,227,088.44
债券差价收入	五、10	0.00	-146,692.90
权证差价收入	五、11	0.00	11,674,877.94
债券利息收入		269,378.72	275,759.71
存款利息收入		3,583,241.18	184,119.98
股利收入		12,321,098.78	3,916,689.02
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	五、12	3,951,471.83	513,744.33
收入合计		1,571,903,542.00	81,645,586.52
减：费用			
基金管理人报酬		24,434,511.89	3,358,648.68
基金托管费		4,072,418.67	559,774.77
其他费用	五、13	250,691.30	261,452.39
其中：上市年费		29,752.78	29,752.78
信息披露费		148,765.71	173,560.90
审计费用		47,108.87	47,108.87
费用合计		28,757,621.86	4,179,875.84
基金净收益/(损失)		1,543,145,920.14	77,465,710.68
加：未实现估值增值/(减值)变动数		-630,278,166.75	157,106,699.00
基金经营业绩		912,867,753.39	234,572,409.68
基金净收益/(损失)		1,543,145,920.14	77,465,710.68
加：期初累计基金净收益/净损失		46,021,597.85	-15,742,387.79
本期申购基金份额的损益平准金		1,028,103,539.52	5,053,613.42
减：本期赎回基金份额的损益平准金		361,693,747.30	-5,736,677.82
可供分配基金净收益/(累计基金净损失)		2,255,577,310.21	72,513,614.13
减：本期已分配基金净收益	五、14	1,898,153,661.58	18,143,446.25

未分配基金净收益/(累计基金净损失)	357,423,648.63	54,370,167.88
--------------------	----------------	---------------

3、基金净值变动表（除特别注明外，金额单位为人民币元）

	2007 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日 至 6 月 30 日止期间
期初基金净值	2,064,975,783.64	610,341,624.63
本期经营活动		
基金净收益/(损失)	1,543,145,920.14	77,465,710.68
未实现估值增值/(减值)变动数	-630,278,166.75	157,106,699.00
经营活动产生的基金净值变动数	912,867,753.39	234,572,409.68
本期基金份额交易		
基金申购款	15,026,281,634.61	117,646,769.62
其中：分红再投资	669,680,327.97	213,007.18
减：基金赎回款	3,224,847,860.96	445,575,278.95
基金份额交易产生的基金净值变动数	11,801,433,773.65	-327,928,509.33
减：本期向基金份额持有人分配收益	1,898,153,661.58	18,143,446.25
期末基金净值	12,881,123,649.10	498,842,078.73

第二节 会计报表附注

一、本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

二、本报告期无重大会计差错和更正金额。

三、本报告期间的关联方交易

(1). 主要关联方关系

企业名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金直销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2). 通过关联方交易单元进行的交易

2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间		
	成交量	占本期成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	4,578,202,361.47	25.26%
买卖债券	18,666,047.68	100.00%
买卖权证	0.00	0.00%
回购交易	0.00	0.00%
	佣金	占本期佣金总量的比例
长城证券：		
交易佣金	3,582,463.69	24.47%
2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间		
	成交量	占本期成交量的比例
长城证券：		
买卖股票	232,179,715.55	20.96%
买卖债券	0.00	0.00%
买卖权证	1,058,308.78	9.06%
回购	0.00	0.00%
	佣金	占本期佣金总量的比例
长城证券：		
交易佣金	181,682.95	20.32%

上述佣金按市场佣金率计算，并以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 24,434,511.89 元(2006 年同期: 3,358,648.68 元)。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 4,072,418.67 元(2006 年同期：559,774.77 元)。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 3,537,131,680.07 元(2006 年 6 月 30 日：65,630,629.07 元)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 3,058,092.35 元(2006 年同期：177,817.85 元)。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本会计期间与托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间
买入债券结算金额	995,154,500.00	0.00
卖出债券结算金额	0.00	71,635,149.26
回购交易	0.00	0.00

(7) 关联方持有基金份额情况

本基金之基金管理人在2007年上半年及2006年上半年均未持有本基金份额。

本基金基金管理人主要股东及其控制的机构在2007年6月30日及2006年12月31日均未持有本基金份额。

四、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007] 84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金买卖股票自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税；自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3%的税率缴纳股票交易印花税。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

五、财务会计报表重要项目说明

1. 应收利息

	<u>2007年6月30日</u>
应收债券利息	2,241,758.24
应收银行存款利息	1,424,062.22
应收清算备付金利息	3,080.61
应收权证保证金利息	56.07
合计	<u>3,668,957.14</u>

2. 待摊费用

本基金于2007年6月30日及2006年12月31日的待摊费用无余额。

3. 投资估值增值

		<u>2007年6月30日</u>	
	<u>市值</u>	<u>成本</u>	<u>估值增值</u>
股票投资	8,695,593,566.89	9,024,633,519.88	-329,039,952.99
债券投资	993,174,280.22	993,174,280.22	0.00
权证投资	24,381,082.54	0.00	24,381,082.54
合计			<u>-304,658,870.45</u>

2007年上半年本基金所投资的股票中，因股权分置改革而获得由非流通股股东支付的现金对价为人民币2,762.75元。此等现金对价于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本。

4. 应付佣金

2007年6月30日

长城证券有限责任公司	3,096,540.16
联合证券有限责任公司	1,719,335.06
中国银河证券股份有限公司	681,076.03
招商证券股份有限公司	4,999,197.98
海通证券股份有限公司	1,994,927.44
合计	<u>12,491,076.67</u>

5. 其他应付款

2007年6月30日

应付银行间债券结算服务费	300.00
应付银行间债券交易手续费	2,000.00
应付券商垫付深圳交易单元保证金	500,000.00
合 计	<u>502,300.00</u>

6. 预提费用

2007年6月30日

上市费	29,752.78
审计费用	47,108.87
债券账户维护费	4,426.92
信息披露费	148,765.71
合计	<u>230,054.28</u>

7. 实收基金

2007年1月1日至6月30日

期初数	1,573,537,156.44
加：本期申购	11,786,569,951.49
其中：红利再投资	565,608,386.04
减：本期赎回	2,046,896,033.20
期末数	<u>11,313,211,074.73</u>

8. 未实现利得

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2007 年半年度报告

2007年6月30日

期初数	445,417,029.35
加： 未实现投资估值增值变动数	-630,278,166.75
本期申购的未实现利得平准金	2,211,608,143.60
减： 本期赎回的未实现利得平准金	816,258,080.46
期末数	<u>1,210,488,925.74</u>

9. 股票差价收入

2007年1月1日至6月30日

卖出股票成交总额	6,076,404,193.43
减： 卖出股票成本总额	4,519,513,024.17
减： 交易佣金总额	5,112,817.77
	<u>1,551,778,351.49</u>

10. 债券差价收入

2007年1月1日至6月30日

卖出及到期兑付债券结算金额	0.00
减： 应收利息总额	0.00
减： 卖出及到期兑付债券成本总额	0.00
	<u>0.00</u>

11. 权证差价收入

2007年1月1日至6月30日

卖出权证成交总额	0.00
减： 应付佣金总额	0.00
减： 卖出权证成本总额	0.00
	<u>0.00</u>

12. 其他收入

2007年1月1日至6月30日

基金赎回费收入	<u>3,951,471.83</u>
---------	---------------------

13. 其他费用

	<u>2007年1月1日至6月30日</u>
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
审计费用	47,108.87
债券账户维护费	8,926.92
银行费用	13,837.02
债券交易费	2,000.00
银行间债券结算服务费	300.00
合计	<u>250,691.30</u>

14. 已分配基金净收益

本基金自2007年1月1日至2007年6月30日止收益分配情况如下：

分红公告日	权益登记日	每10份基金份额	收益分配金额 (元)
		收益分配金额 (元)	
2007年6月19日	2007年6月18日	10.70	1,898,153,661.58

15. 银行存款

	<u>2007年6月30日</u>
活期存款	3,537,131,680.07
定期存款	--
合计	<u>3,537,131,680.07</u>

本基金自2007年1月1日至2007年6月30日并未投资于定期存款。

16. 应收证券清算款/应付证券清算款

	<u>2007年6月30日</u>
应收证券清算款	0.00
应付证券清算款	<u>350,832,501.20</u>

六、 流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2007年6月30日止无流通转让受限制的资产。

七、 其他事项

1. 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

2. 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日止，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

第六章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	金 额（元）	占基金资产总值比例
股票	8,695,593,566.89	65.53%
债券	993,174,280.22	7.49%
银行存款和清算备付金合计	3,544,738,041.70	26.71%
应收证券清算款	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
权证	24,381,082.54	0.18%
其它资产	11,638,044.94	0.09%
资产总计	13,269,525,016.29	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	数量（股）	市值（元）	市值占基金资产净值比
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00	0.00%
B 采掘业	30,447,220.00	438,997,663.34	3.41%
C 制造业	118,310,804.00	2,369,588,032.83	18.40%
C0 食品、饮料	10,602,188.00	333,544,834.48	2.59%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	4,857,272.00	119,440,318.48	0.93%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00	0.00%
C5 电子	0.00	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	86,745,314.00	1,424,112,687.45	11.06%
C7 机械、设备、仪表	6,593,684.00	365,228,300.40	2.84%
C8 医药、生物制品	9,512,346.00	127,261,892.02	0.99%
C99 其他制造业	0.00	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	21,306,287.00	268,721,598.64	2.09%
E 建筑业	0.00	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	61,055,873.00	1,219,080,543.27	9.46%
G 信息技术业	59,391,944.00	721,014,899.61	5.60%
H 批发和零售贸易	4,710,069.00	102,112,134.51	0.79%
I 金融、保险业	89,731,564.00	2,664,012,087.63	20.68%
J 房地产业	29,356,155.00	664,487,818.68	5.16%
K 社会服务业	0.00	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	9,456,791.00	247,578,788.38	1.92%
M 综合类	0.00	0.00	0.00%
合计	423,766,707	8,695,593,566.89	67.51%

三、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	市值占净值比
1	600036	招商银行	31,818,132	782,089,684.56	6.07%
2	000001	深发展 A	16,360,117	450,230,419.84	3.50%
3	600009	上海机场	11,820,664	449,303,438.64	3.49%
4	600030	中信证券	8,470,852	448,701,030.44	3.48%
5	000825	太钢不锈	22,091,255	443,150,575.30	3.44%
6	601628	中国人寿	9,887,309	406,467,272.99	3.16%
7	601318	中国平安	5,497,408	393,119,646.08	3.05%
8	600028	中国石化	28,859,517	381,522,814.74	2.96%
9	000858	五 粮 液	10,602,188	333,544,834.48	2.59%
10	600050	中国联通	47,608,843	279,463,908.41	2.17%
11	000898	鞍钢股份	15,299,399	270,646,368.31	2.10%
12	600269	赣粤高速	19,401,285	269,095,822.95	2.09%
13	600037	歌华有线	9,456,791	247,578,788.38	1.92%
14	000063	中兴通讯	4,228,188	230,013,427.20	1.79%
15	601006	大秦铁路	14,788,932	223,904,430.48	1.74%
16	000839	中信国安	7,554,913	211,537,564.00	1.64%
17	000002	万 科 A	10,388,252	198,623,378.24	1.54%
18	000951	中国重汽	3,608,114	183,653,002.60	1.43%
19	000039	中集集团	5,965,767	174,916,288.44	1.36%
20	000402	金 融 街	5,838,650	169,320,850.00	1.31%
21	600748	上实发展	8,658,210	168,488,766.60	1.31%
22	601919	中国远洋	9,000,000	164,340,000.00	1.28%
23	000970	中科三环	13,524,546	159,454,397.34	1.24%
24	600900	长江电力	9,135,567	138,129,773.04	1.07%
25	600011	华能国际	12,170,720	130,591,825.60	1.01%
26	600308	华泰股份	4,857,272	119,440,318.48	0.93%
27	600005	武钢股份	11,872,053	119,432,853.18	0.93%
28	600004	白云机场	6,044,992	112,436,851.20	0.87%
29	600019	宝钢股份	9,999,981	109,999,791.00	0.85%
30	600000	浦发银行	2,999,947	109,768,060.73	0.85%
31	600150	沪东重机	729,501	100,846,218.24	0.78%
32	600675	中华企业	3,466,214	78,717,719.94	0.61%
33	000778	新兴铸管	5,615,782	76,880,055.58	0.60%
34	601398	工商银行	14,697,799	73,635,972.99	0.57%
35	000060	中金岭南	2,376,531	69,632,358.30	0.54%
36	600631	百联股份	3,999,969	67,159,479.51	0.52%
37	000990	诚志股份	4,967,376	65,420,341.92	0.51%
38	000963	华东医药	4,414,970	58,851,550.10	0.46%

39	600583	海油工程	1,587,703	57,474,848.60	0.45%
40	600066	宇通客车	1,880,069	51,213,079.56	0.40%
41	000024	招商地产	1,004,829	49,337,103.90	0.38%
42	000338	潍柴动力	376,000	29,516,000.00	0.23%
43	002024	苏宁电器	600,000	28,176,000.00	0.22%
44	600694	大商股份	110,100	6,776,655.00	0.05%
45	600479	千金药业	130,000	2,990,000.00	0.02%
	合计		423,766,707	8,695,593,566.89	67.51%

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额 (元)	占期初净值比
1	600036	招商银行	857,535,426.39	41.53%
2	600009	上海机场	597,758,104.70	28.95%
3	600030	中信证券	597,602,570.01	28.94%
4	600028	中国石化	582,289,043.46	28.20%
5	000825	太钢不锈	572,735,615.83	27.74%
6	601628	中国人寿	457,157,919.13	22.14%
7	000001	深发展 A	434,929,425.83	21.06%
8	601318	中国平安	398,540,805.39	19.30%
9	000858	五 粮 液	371,447,703.78	17.99%
10	600037	歌华有线	368,617,639.70	17.85%
11	000002	万 科 A	298,892,802.38	14.47%
12	601398	工商银行	298,173,095.93	14.44%
13	600050	中国联通	294,861,581.26	14.28%
14	000898	鞍钢股份	285,359,622.72	13.82%
15	000063	中兴通讯	284,535,827.12	13.78%
16	601006	大秦铁路	281,105,501.04	13.61%
17	600269	赣粤高速	273,930,024.76	13.27%
18	000839	中信国安	218,008,510.79	10.56%
19	600019	宝钢股份	213,896,524.10	10.36%
20	600005	武钢股份	209,178,915.22	10.13%
21	600748	上实发展	204,866,196.96	9.92%
22	600308	华泰股份	199,423,124.09	9.66%
23	000039	中集集团	195,163,755.99	9.45%
24	000970	中科三环	190,905,342.65	9.24%
25	000402	金 融 街	185,531,034.50	8.98%
26	000951	中国重汽	173,036,661.06	8.38%
27	600675	中华企业	160,724,073.04	7.78%
28	600011	华能国际	152,528,115.83	7.39%
29	601919	中国远洋	146,351,359.92	7.09%

30	600900	长江电力	133,829,971.96	6.48%
31	600000	浦发银行	126,405,968.29	6.12%
32	600631	百联股份	123,782,491.08	5.99%
33	600004	白云机场	116,300,262.86	5.63%
34	000778	新兴铸管	95,339,054.62	4.62%
35	600150	沪东重机	87,295,588.71	4.23%
36	000060	中金岭南	85,281,779.79	4.13%
37	000822	山东海化	80,823,414.31	3.91%
38	600519	贵州茅台	73,321,708.14	3.55%
39	600583	海油工程	71,285,501.00	3.45%
40	600795	国电电力	66,994,341.05	3.24%
41	002024	苏宁电器	65,108,368.80	3.15%
42	600100	同方股份	62,856,547.63	3.04%
43	000768	西飞国际	58,414,415.32	2.83%
44	000800	一汽轿车	57,217,714.40	2.77%
45	600456	宝钛股份	56,335,750.17	2.73%
46	000963	华东医药	56,284,854.43	2.73%
47	000990	诚志股份	55,881,831.04	2.71%
48	600331	宏达股份	55,125,006.79	2.67%
49	600718	东软股份	54,464,823.61	2.64%
50	000024	招商地产	53,138,888.73	2.57%
51	000987	广州友谊	52,109,966.66	2.52%
52	600832	东方明珠	50,808,673.11	2.46%
53	601166	兴业银行	49,009,335.65	2.37%
54	600688	S 上石化	48,888,873.49	2.37%
55	600016	民生银行	48,481,771.65	2.35%
56	600066	宇通客车	48,079,213.97	2.33%
57	000933	神火股份	47,952,506.44	2.32%
58	000541	佛山照明	47,647,715.83	2.31%
59	600509	天富热电	44,399,503.79	2.15%
60	000612	焦作万方	43,807,256.56	2.12%

（二） 报告期内累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额 (元)	占期初净值比
1	600036	招商银行	302,432,567.35	14.65%
2	601398	工商银行	292,277,092.06	14.15%
3	600030	中信证券	260,260,407.46	12.60%
4	600028	中国石化	242,344,223.63	11.74%
5	000825	太钢不锈	210,253,090.44	10.18%
6	000002	万 科 A	199,354,068.65	9.65%
7	600037	歌华有线	176,642,671.77	8.55%

景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）2007 年半年度报告

8	600000	浦发银行	172,717,393.16	8.36%
9	600019	宝钢股份	165,348,043.25	8.01%
10	600016	民生银行	159,097,463.73	7.70%
11	600005	武钢股份	152,643,632.47	7.39%
12	600009	上海机场	149,037,786.79	7.22%
13	000822	山东海化	134,156,459.72	6.50%
14	600519	贵州茅台	123,596,175.49	5.99%
15	600022	济南钢铁	120,978,366.69	5.86%
16	600694	大商股份	119,006,821.37	5.76%
17	601006	大秦铁路	117,673,156.00	5.70%
18	600308	华泰股份	104,692,648.62	5.07%
19	600718	东软股份	91,184,376.19	4.42%
20	600795	国电电力	89,802,602.96	4.35%
21	600675	中华企业	87,668,334.04	4.25%
22	000987	广州友谊	85,233,419.70	4.13%
23	600583	海油工程	84,098,484.16	4.07%
24	000612	焦作万方	82,857,042.87	4.01%
25	600331	宏达股份	82,379,266.96	3.99%
26	000926	福星科技	79,473,178.03	3.85%
27	000001	深发展 A	75,748,984.64	3.67%
28	600100	同方股份	75,536,541.42	3.66%
29	600887	伊利股份	73,497,461.23	3.56%
30	600509	天富热电	73,219,088.80	3.55%
31	000541	佛山照明	72,942,406.13	3.53%
32	002024	苏宁电器	72,624,097.66	3.52%
33	600456	宝钛股份	72,189,133.40	3.50%
34	000768	西飞国际	69,581,709.26	3.37%
35	000800	一汽轿车	69,119,923.45	3.35%
36	600832	东方明珠	68,121,064.00	3.30%
37	601166	兴业银行	64,858,342.42	3.14%
38	600396	金山股份	63,188,333.80	3.06%
39	000039	中集集团	60,950,015.36	2.95%
40	600054	黄山旅游	57,493,624.86	2.78%
41	600688	S 上石化	57,068,621.32	2.76%
42	000933	神火股份	55,040,606.48	2.67%
43	600631	百联股份	50,876,183.18	2.46%
44	600316	洪都航空	48,965,145.61	2.37%
45	600861	北京城乡	48,250,234.88	2.34%
46	600717	天津港	47,604,631.60	2.31%
47	600050	中国联通	45,421,762.84	2.20%
48	000793	华闻传媒	44,864,562.56	2.17%
49	600383	金地集团	44,826,961.81	2.17%
50	600438	通威股份	42,434,596.96	2.05%

51	000063	中兴通讯	41,836,227.90	2.03%
----	--------	------	---------------	-------

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票收入总额

单位：元

买入股票总成本总额	卖出股票收入总额
12,110,777,235.68	6,076,404,193.43

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（元）	市值占基金资产净值比例
国家债券投资	0.00	0.00%
央行票据投资	993,174,280.22	7.71%
企业债券投资	0.00	0.00%
金融债券投资	0.00	0.00%
可转换债投资	0.00	0.00%
债券投资合计	993,174,280.22	7.71%

六、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券名称	数量（张）	市值（元）	市值占基金资产净值比例
07 央行票据 55	10,000,000	993,174,280.22	7.71%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的资产支持证券明细

本基金在本报告期内未投资资产支持证券。

八、报告期末本基金投资权证明细

1、本报告期末本基金持有权证明细如下：

序号	权证代码	权证种类	权证名称	权证数量（股）	市值	市值占基金净资产比例
1	031003	认购权证	深发 SFC1	1,036,016	15,788,883.84	0.12%
2	031004	认购权证	深发 SFC2	518,008	8,592,198.70	0.07%
合计					24,381,082.54	0.19%

2、报告期内获得权证的明细

本报告期内因股权分置改革被动持有的权证数量为 24,381,082.54 股，成本总额为 0.00 元，无主动投资的权证，明细如下：

序号	权证代码	权证种类	权证名称	权证数量（股）	市值	市值占基
----	------	------	------	---------	----	------

						金净资产 比例
1	031003	认购权证	深发 SFC1	1,036,016	15,788,883.84	0.12%
2	031004	认购权证	深发 SFC2	518,008	8,592,198.70	0.07%
合计					24,381,082.54	0.19%

九、投资组合报告附注

1、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。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金的其他资产构成

项目	金额
交易保证金	1,878,350.67
应收股利	6,084,837.13
应收利息	3,668,957.14
应收申购款	5,900.00
	11,638,044.94

4、报告期内没有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期内基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

第七章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	386,075
平均每户持有基金份额	29,303.14

二、报告期末基金份额持有人结构

	数量	占总份额的比例
基金份额总额	11,313,211,074.73	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	703,302,384.71	6.22%
个人投资者持有的基金份额	10,609,908,690.02	93.78%

本公司的基金从业人员现持有本基金 29336.53 份，占本基金总份额的 0.000259%。

三、报告期末基金场内前十名持有人明细

序号	持有人名称	持有份额	占场内 总份额比 例	占期末 总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司	139,187,664.00	20.55%	1.23%
2	中国平安人寿保险股份有限公司	29,442,419.00	4.35%	0.26%
3	南通市港闸区世建钢管租赁站	12,000,000.00	1.77%	0.11%
4	中国人寿保险股份有限公司-分 红账户	7,800,467.00	1.15%	0.07%
5	候健	4,400,000.00	0.65%	0.04%
6	王桂兰	3,343,967.00	0.49%	0.03%
7	沈阳双鼎制药有限公司	3,343,967.00	0.49%	0.03%
8	张涛	2,346,733.00	0.35%	0.02%
9	汪茗	2,005,390.00	0.30%	0.02%
10	候锋	1,956,082.00	0.29%	0.02%

第八章 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	445,627,301.07
期初基金份额总额	1,573,537,156.44
本期基金总申购份额	11,786,569,951.49
本期基金总赎回份额	2,046,896,033.20
期末基金份额总额	11,313,211,074.73

第九章 重大事件揭示

在本报告期内：

- 1、本基金未召开基金份额持有人大会。
- 2、本基金管理人及本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。
- 3、本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。
- 4、本基金的投资策略未发生改变。

5、本基金于 2007 年 6 月 18 日实施分红，分红方案为每 10 份基金份额派发红利 10.70 元。有关收益分配预告和收益分配公告分别刊登在 2007 年 6 月 14 日和 2007 年 6 月 19 日的中国证券报、上海证券报、证券时报。

6、本基金聘请的会计师事务所未发生改变。

7、本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

8、基金租用证券公司情况专用交易单元的情况

（1）本报告期内基金租用专用交易单元的证券公司名称、交易单元数量及交易单元变更情况

租用交易单元的证券公司名称	租用交易单元数量	交易单元变更情况
招商证券股份有限公司	1	无变更
海通证券股份有限公司	1	无变更
中国银河证券股份有限公司	1	无变更
长城证券有限责任公司	1	无变更
联合证券有限责任公司	1	无变更

（2）各交易单元券商股票交易、权证交易、债券交易及回购交易和佣金情况如下：

2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日股票、权证交易及佣金情况

券商交易单元	股票交易金额 (元)	占总成交金额 比例	权证交易金额 (元)	占总成交金额 比例	佣金（元）	占总佣金 金额比例
长城证券	4,578,202,361.47	25.26%	0.00	0.00%	3,582,463.69	24.47%
招商证券	6,707,387,069.88	37.01%	0.00	0.00%	5,500,046.59	37.56%
海通证券	3,004,072,436.56	16.57%	0.00	0.00%	2,463,323.44	16.82%
银河证券	1,240,943,628.90	6.85%	0.00	0.00%	971,046.07	6.63%
联合证券	2,593,137,493.61	14.31%	0.00	0.00%	2,126,366.27	14.52%
合计	18,123,742,990.42	100.00%	0.00	0.00%	14,643,246.06	100.00%

2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日债券及回购交易情况

券商交易单元	债券交易金额(元)	占债券总成交金额比例	回购金额(元)	占回购总成交金额比例
长城证券	18,666,047.68	100.00%	0.00	0.00%
招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
银河证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
联合证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	18,666,047.68	0.00%	0.00	0.00%

（3）基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

9、 因广大投资者的广泛关注和踊跃申购，本基金规模稳定持续增长。为保证基金资产的有效运作，根据中国证监会的有关规定以及《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）

基金合同》第八章第九条“拒绝或暂停申购的情形与处理”中第 1、（3）项“基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购可能对已有基金持有人利益产生损害”的规定，本基金自 2007 年 6 月 21 日起暂停申购业务。有关临时公告刊登在 2007 年 6 月 21 日的中国证券报、上海证券报、证券时报上。

第十章 备查文件

一、备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）设立的文件。
- 2、《景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3、《景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金（LOF）招募说明书》。
- 4、《景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）托管协议》。
- 5、《景顺长城基金管理有限公司开放式基金业务规则》。
- 6、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
- 7、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。

二、存放地点及查阅方式

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人景顺长城基金管理有限公司。

客户服务电话：4008888606 0755-82370688

网址：www.invescogreatwall.com

景顺长城基金管理有限公司

2007 年 8 月 28 日