

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2011 年年度报告摘要

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 03 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长城久泰沪深 300 指数
基金主代码	200002
前端交易代码	200002
后端交易代码	201002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 21 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,565,605,571.52 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1) 本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300

	<p>指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。(2) 股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3) 本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。</p>
业绩比较基准	<p>自基金合同生效至 2011 年 3 月 31 日的业绩比较基准为：<math>95\% \times \text{中信标普 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}</math>；自 2011 年 4 月 1 日开始业绩比较基准为：<math>95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}</math>。</p>
风险收益特征	<p>承担市场平均风险，获取市场平均收益。</p>

注：本基金为增强型指数基金，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，自 2011 年 4 月 1 日起，本基金所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	张燕
	联系电话	0755-23982338	0755-83199084
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95555
传真		0755-23982328	0755-83195201

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-22,477,091.37	-6,453,503.55	-380,871,882.48
本期利润	-450,627,805.43	-235,168,284.91	1,306,292,493.39
加权平均基金份额本期利润	-0.2889	-0.1333	0.6660
本期基金份额净值增长率	-24.12%	-11.05%	92.40%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.7284	-0.7140	-0.7083
期末基金资产净值	1,450,923,566.62	1,978,208,114.07	2,611,909,761.42
期末基金份额净值	0.9267	1.2213	1.3730

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 基金净值表现

##### 3.2.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-8.83%	1.32%	-8.66%	1.34%	-0.17%	-0.02%
过去六个月	-21.63%	1.28%	-21.87%	1.29%	0.24%	-0.01%
过去一年	-24.12%	1.23%	-24.37%	1.23%	0.25%	0.00%
过去三年	29.86%	1.59%	28.15%	1.59%	1.71%	0.00%
过去五年	16.33%	2.04%	19.91%	2.04%	-3.58%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	139.75%	1.80%	109.21%	1.80%	30.54%	0.00%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D0 到 D1 区间内每个交易日收益率的合成计算而来，计算公式如下：

从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准收益率 = (1 + D1 日业绩比较基准收益率) × (1 + D2 日业绩比较基准收益率) × …… × (1 + Dn 日业绩比较基准收益率) - 1

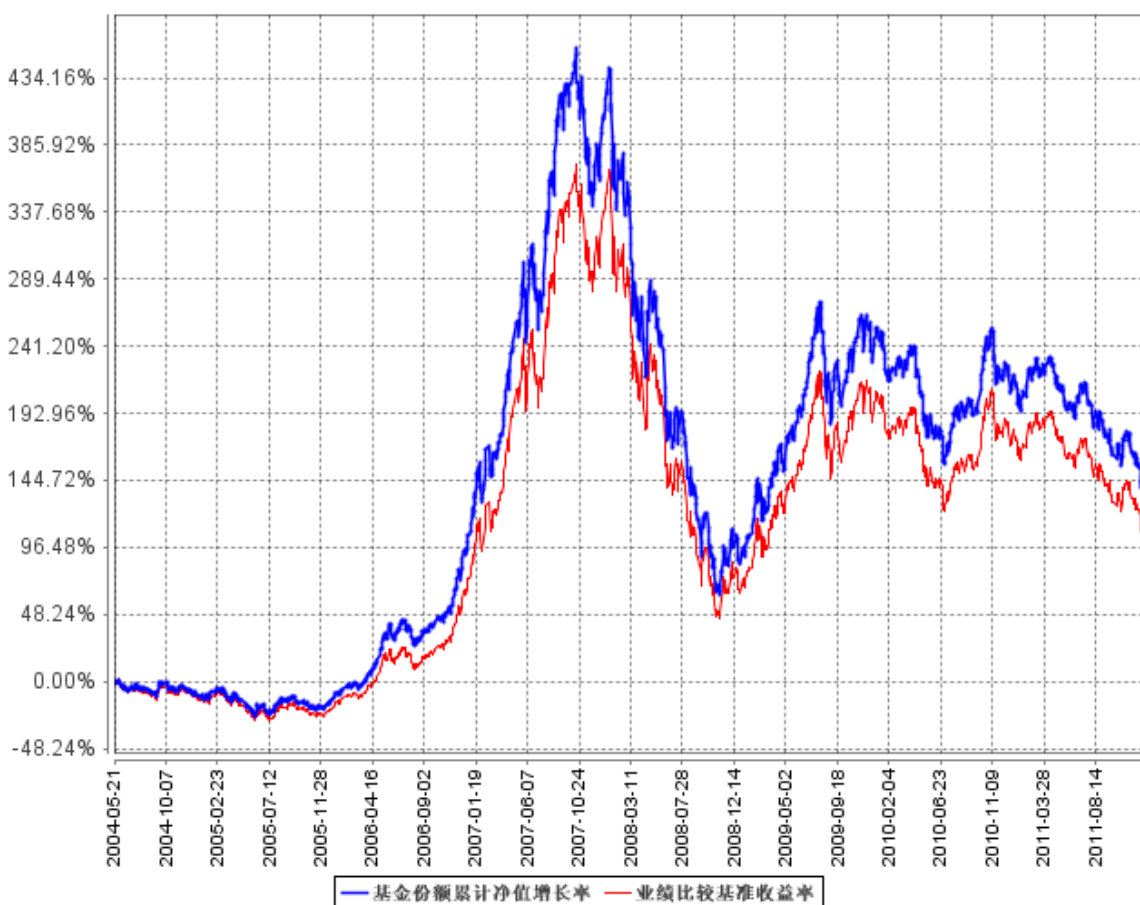
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日开始长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成；计算银行同业存款每日利率时，如果前一日或者多日为非交易日的，考虑该非交易日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

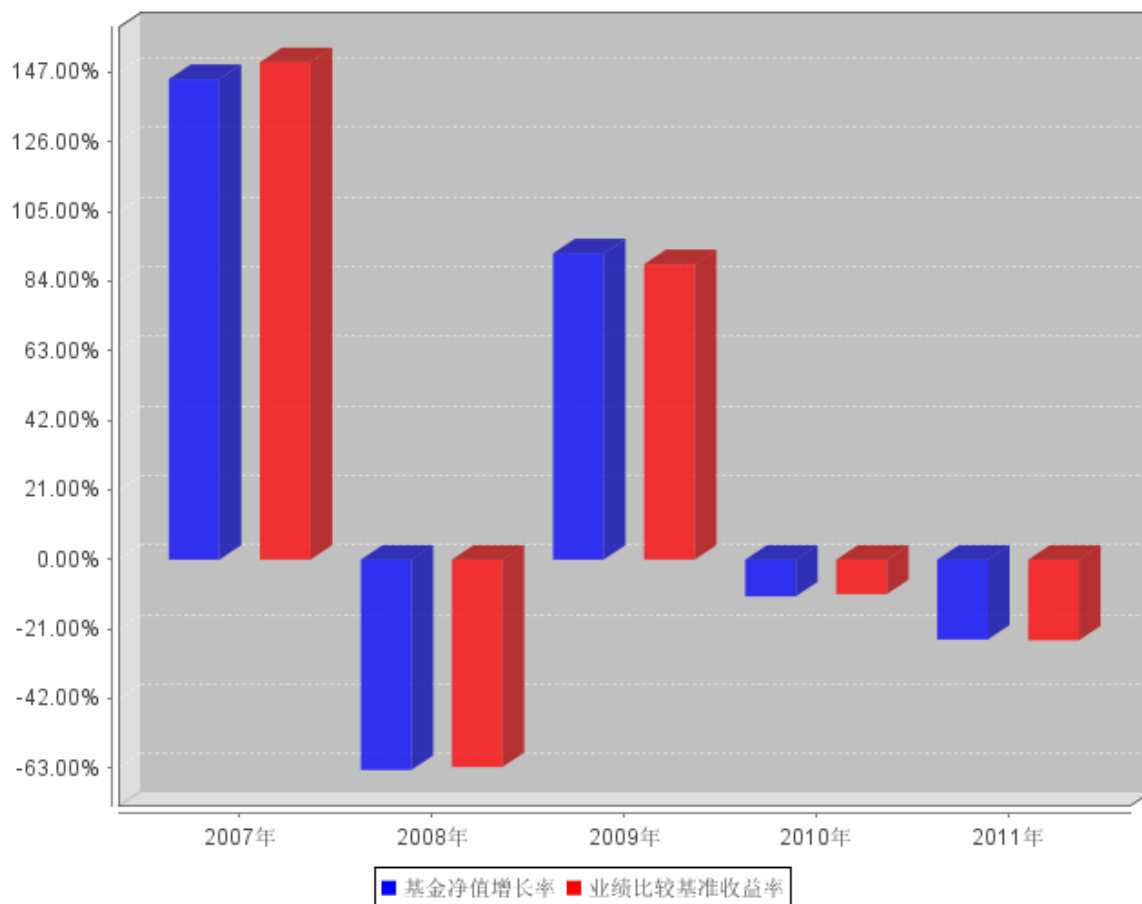
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：过往三年无利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券有限责任公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券有限责任公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监

会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	投资总监、基金管理部总经理、本基金的基金经理、长城久富和长城中小盘基金的基金经理	2004年5月21日	-	11年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部，2001年10月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况，本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整，有效地保护了基金持有人利益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序，保证各基金获得了公平的交易机会。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为增强指数型基金，投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为，未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，我国所处的外部经济环境更趋复杂。美国尽管受到国债规模不断膨胀的困扰，宏观经济仍然缓慢复苏，失业率水平也开始缓慢下降。相比之下欧洲的欧元区则深陷主权债务危机，多国主权信用评级被不断下调，不但影响到金融体系的稳定，更进而威胁实体经济，甚至造成政府的更迭。众多发展中国家和新兴经济体则饱受高通胀的困扰。国内宏观经济政策则紧紧围绕控制通货膨胀这个重心，连续上调存款准备金率水平直至历史新高，多地出台住房限购政策和房产税试点。在持续紧缩政策的作用下，国内需求逐渐显露疲态，宏观经济增速开始放缓，通胀水平也终于见顶后开始缓慢回落。持续的紧缩政策还推高了民间借贷利率水平和规模，“金融脱媒”现象严重，金融体系流通性趋紧。紧缩政策也影响到上市公司的资金成本和盈利能力，盈利预期被不断下调。此外，A股市场还受到包括IPO、再融资、大小非减持在内的扩容压力的困扰。受到这些政策面、资金面、企业业绩层面的影响，A股市场2011年总体呈现震荡下跌的态势，期间结构分化明显，部分板块也有结构性的行情，总体上银行为代表的低估值的大盘蓝筹股和以白酒为代表的高景气的食品饮料股全年表现较好，业绩低于预期的中小盘个股调整幅度较大。全年沪深300指数收益率为-25.01%，中小板综合指数收益率为-34.08%。本基金本报告期内进行了跟踪标的指数的调整，将目标指数从中信标普300指数调整为更有市场影响力的沪深300指数。本基金报告期内严格遵守基金合同，严控跟踪误差，总体操作基本得当。



#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金目标指数沪深 300 指数涨幅为-25.01%,本基金比较基准涨幅为-24.37%,本基金份额净值增长率为-24.12%,小幅领先比较基准 0.25%。本基金自更换跟踪标的指数生效日(2011 年 4 月 1 日)起至报告期末日均跟踪误差为 0.0351%,年化跟踪误差为 0.5435%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年,我们依然面临着更加复杂的外部环境。欧洲主权债务危机将把欧元引向何处?是否会出台更强约束各国财政政策的措施,财政紧缩是否会导致欧元区陷入全面衰退?这些都存在着诸多不确定性。美国经济状况相对乐观些,但是不确定性也依然存在,是否有进一步的量化宽松?量化宽松何时开始退出?失业率下降的趋势能否保持。此外许多重要经济体进入选举年,这带来较多政治上的不确定性。总体上,我们面临的外需环境比较严峻,依赖外需拉动国内宏观经济增长的可能性较低。国内方面,经过超过一年紧缩政策后,通胀压力有所缓解,但是仍存在反复的可能。房地产价格仍然相对坚挺,过高的房地产库存如何消化、以什么样的形式消化?这也存在一定的不确定性。在房价回归到合理水平之前,对政策放松的预期、对固定资产投资增长的预期都不能过于乐观。证券市场方面,扩容压力依然存在,上市公司业绩预期仍存在继续下调的可能。尽管如此,经过近两年的业绩增长和估值水平下移,市场整体估值水平已经处于较低水平,考虑到进一步紧缩政策出台的可能性较低,资金紧张程度将不会超过 2011 年,因此总体上我们判断,证券市场整体状况将好于 2011 年。从全年的角度看,我们仍然看好国家政策支持的大消费类、低碳经济、节能减排、战略新兴产业等领域的投资机会,我们认为投资机会将从行业板块转向个股选择。总体估值水平偏低的大盘蓝筹股也存在估值修复的机会。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。本基金在 2012 年将继续按照基金合同的规定,努力控制跟踪偏差,争取获得适度超越目标指数的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了基金估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司分管估值业务副总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席基金估值委员会。

基金估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评

价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因数，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据基金估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

基金估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、剪作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》规定的收益分配原则为：基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成。

截止本报告期末，本基金可供分配利润为-1,140,338,074.68 元，不进行年度收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明, 在本报告期内, 基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同, 完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告, 投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日: 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		89,129,304.61	113,434,860.68
结算备付金		53,674.04	109,523.71
存出保证金		760,000.00	760,000.00
交易性金融资产		1,372,889,936.71	1,872,797,831.57
其中：股票投资		1,372,889,936.71	1,872,797,831.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		19,474.95	25,235.50
应收股利		-	-
应收申购款		1,069,149.68	1,143,283.21
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,463,921,539.99	1,988,270,734.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2010 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,471,230.36	4,694,643.32
应付赎回款		368,951.72	2,004,121.86
应付管理人报酬		1,243,677.98	1,676,955.78
应付托管费		253,811.85	342,235.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		107,568.90	779,164.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		552,732.56	565,498.78
负债合计		12,997,973.37	10,062,620.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		1,565,605,571.52	1,619,815,046.65
未分配利润		-114,682,004.90	358,393,067.42
所有者权益合计		1,450,923,566.62	1,978,208,114.07

负债和所有者权益总计		1, 463, 921, 539. 99	1, 988, 270, 734. 67
------------	--	----------------------	----------------------

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9267 元，基金份额总额 1,565,605,571.52 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-427, 831, 946. 72	-207, 341, 019. 73
1.利息收入		752, 174. 42	873, 119. 54
其中：存款利息收入		750, 556. 06	871, 277. 59
债券利息收入		1, 618. 36	1, 841. 95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-835, 177. 48	19, 002, 931. 69
其中：股票投资收益		-21, 164, 192. 66	-1, 035, 392. 90
基金投资收益		-	-
债券投资收益		454, 486. 24	81, 974. 45
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		19, 874, 528. 94	19, 956, 350. 14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-428, 150, 714. 06	-228, 714, 781. 36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		401, 770. 40	1, 497, 710. 40
<b>二、费用</b>		22, 795, 858. 71	27, 827, 265. 18
1. 管理人报酬		17, 454, 879. 31	20, 815, 305. 19
2. 托管费		3, 562, 220. 27	4, 248, 021. 51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1, 417, 534. 34	2, 395, 416. 79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		361, 224. 79	368, 521. 69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		<b>-450, 627, 805. 43</b>	<b>-235, 168, 284. 91</b>

号填列)			
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-450,627,805.43	-235,168,284.91

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,619,815,046.65	358,393,067.42	1,978,208,114.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-450,627,805.43	-450,627,805.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-54,209,475.13	-22,447,266.89	-76,656,742.02
其中: 1. 基金申购款	214,396,091.25	30,360,242.32	244,756,333.57
2. 基金赎回款	-268,605,566.38	-52,807,509.21	-321,413,075.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,565,605,571.52	-114,682,004.90	1,450,923,566.62
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,902,315,858.32	709,593,903.10	2,611,909,761.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-235,168,284.91	-235,168,284.91
三、本期基金份额交易	-282,500,811.67	-116,032,550.77	-398,533,362.44

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	647, 783, 346. 44	151, 846, 712. 40	799, 630, 058. 84
2. 基金赎回款	-930, 284, 158. 11	-267, 879, 263. 17	-1, 198, 163, 421. 28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1, 619, 815, 046. 65	358, 393, 067. 42	1, 978, 208, 114. 07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 杨光裕	_____ 熊科金	_____ 桑煜
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金(以下简称“本基金”),由长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金更名而成,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字(2004)51 号文《关于同意长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金设立的批复》的核准,由基金管理人长城基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2004 年 5 月 21 日正式生效,首次设立募集规模为 1,512,020,891.32 基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(“招商银行”)。

本基金的指数化投资采用分层抽样法,自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数,即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。自 2011 年 4 月 1 日起,所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数,并在 2011 年 4 月 20 日前将现有的组合调整为跟踪沪深 300 指数的新组合。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。自 2011 年 4 月 1 日起本基金的业绩比较基准为:95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日本基金的业绩比较基准为:95%×中信标普 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用



基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行	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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东

注：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	306,850,764.35	33.95%	388,592,717.42	27.04%
东方证券	597,071,269.53	66.05%	1,048,523,874.53	72.96%

### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于 2011 年度及 2010 年度，均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于 2011 年度及 2010 年度，均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金于 2011 年度及 2010 年度，均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	249,318.43	32.94%	35,382.26	32.89%
东方证券	507,509.98	67.06%	72,186.64	67.11%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	315,733.73	26.16%	205,150.76	26.33%
东方证券	891,244.77	73.84%	574,014.23	73.67%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,454,879.31	20,815,305.19
其中：支付销售机构的客户维护费	3,952,255.01	4,629,243.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.98% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.98\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本期末本基金未支付的管理费余额 1,243,677.98 元。（2010 年：1,676,955.78 元）

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,562,220.27	4,248,021.51

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

本期末本基金未支付的托管费余额 253,811.85 元。（2010 年：342,235.87 元）

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于 2011 年度及 2010 年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于 2011 年度及 2010 年度均未投资于本基金，于 2011 年 12 月 31 日及 2010 年 12 月 31 日亦均未持有本基金份额。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方于 2011 年 12 月 31 日及 2010 年 12 月 31 日均未持有本基金份额。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	89,129,304.61	734,100.49	113,434,860.68	848,774.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于 2011 年度及 2010 年度均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于 2011 年末无因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600132	重庆啤酒	2011-12-23	重大事项	28.45	2012-1-10	25.61	79,363	2,712,455.90	2,257,877.35	-
000768	西飞国际	2011-12-28	资产重组	7.26	2012-01-04	7.61	362,529	4,430,264.35	2,631,960.54	

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于 2011 年末未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,372,889,936.71	93.78
	其中：股票	1,372,889,936.71	93.78
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	89,182,978.65	6.09
6	其他各项资产	1,848,624.63	0.13
7	合计	1,463,921,539.99	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,609,545.84	0.59
B	采掘业	149,361,431.27	10.29
C	制造业	490,032,936.16	33.77
C0	食品、饮料	106,450,826.78	7.34
C1	纺织、服装、皮毛	4,514,503.63	0.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,429,571.50	1.89
C5	电子	13,096,743.23	0.90
C6	金属、非金属	111,699,218.50	7.70
C7	机械、设备、仪表	155,232,848.28	10.70
C8	医药、生物制品	68,525,703.04	4.72
C99	其他制造业	3,083,521.20	0.21
D	电力、煤气及水的生产和供应业	32,944,254.35	2.27

E	建筑业	36,703,812.77	2.53
F	交通运输、仓储业	42,987,204.90	2.96
G	信息技术业	50,304,790.68	3.47
H	批发和零售贸易	36,004,035.97	2.48
I	金融、保险业	421,919,594.82	29.08
J	房地产业	65,023,227.52	4.48
K	社会服务业	10,672,119.52	0.74
L	传播与文化产业	3,044,592.33	0.21
M	综合类	25,282,390.58	1.74
	合计	1,372,889,936.71	94.62

### 8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

## 8.3 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

### 8.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	7,611,174	44,829,814.86	3.09
2	601318	中国平安	1,011,661	34,841,604.84	2.40
3	600000	浦发银行	4,030,264	34,216,941.36	2.36
4	601166	兴业银行	2,701,277	33,819,988.04	2.33
5	601328	交通银行	6,819,809	30,552,744.32	2.11
6	601088	中国神华	1,004,596	25,446,416.68	1.75
7	600519	贵州茅台	130,721	25,268,369.30	1.74
8	000001	深发展 A	1,577,359	24,591,026.81	1.69
9	600030	中信证券	2,326,803	22,593,257.13	1.56
10	000002	万科 A	2,962,801	22,132,123.47	1.53

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）的年度报告正文。

### 8.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601288	农业银行	16,772,500.00	0.85
2	601088	中国神华	12,299,961.94	0.62
3	601818	光大银行	11,588,850.26	0.59
4	601989	中国重工	10,226,518.00	0.52
5	000776	广发证券	9,936,208.70	0.50
6	601600	中国铝业	8,977,758.17	0.45
7	002304	洋河股份	8,827,756.58	0.45
8	600837	海通证券	8,455,144.57	0.43
9	601009	南京银行	8,172,406.09	0.41
10	601668	中国建筑	7,957,362.95	0.40
11	000063	中兴通讯	7,203,595.03	0.36
12	601688	华泰证券	6,959,806.43	0.35
13	601788	光大证券	6,873,939.12	0.35
14	600362	江西铜业	6,523,781.46	0.33
15	600010	包钢股份	6,290,700.70	0.32
16	000792	盐湖股份	6,120,300.39	0.31
17	000629	攀钢钒钛	5,785,801.02	0.29
18	600115	东方航空	5,520,000.00	0.28
19	002142	宁波银行	5,411,777.55	0.27
20	601998	中信银行	5,246,499.64	0.27

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	13,572,002.60	0.69
2	600016	民生银行	10,044,286.87	0.51
3	601166	兴业银行	7,428,961.63	0.38
4	600837	海通证券	6,278,906.14	0.32

5	002073	软控股份	6,238,787.10	0.32
6	601111	中国国航	6,027,857.69	0.30
7	000338	潍柴动力	6,008,821.50	0.30
8	000157	中联重科	5,967,979.38	0.30
9	000937	冀中能源	5,650,848.09	0.29
10	600030	中信证券	5,491,858.02	0.28
11	600031	三一重工	5,383,077.57	0.27
12	601668	中国建筑	5,346,543.88	0.27
13	000581	威孚高科	5,020,708.80	0.25
14	600252	中恒集团	4,840,194.98	0.24
15	002038	双鹭药业	4,756,425.49	0.24
16	600018	上港集团	4,676,370.23	0.24
17	601939	建设银行	4,249,318.30	0.21
18	600900	长江电力	4,241,198.81	0.21
19	601857	中国石油	4,157,645.30	0.21
20	002106	莱宝高科	4,036,664.99	0.20

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	435,676,417.55
卖出股票收入（成交）总额	486,269,405.69

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。



## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

**8.9.1** 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

**8.9.2** 基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	760,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,474.95
5	应收申购款	1,069,149.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,848,624.63

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
93,722	16,704.78	23,056,684.62	1.47%	1,542,548,886.90	98.53%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本开放式基金	148,495.95	0.0095%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年5月21日）基金份额总额	1,512,020,891.32
本报告期期初基金份额总额	1,619,815,046.65
本报告期基金总申购份额	214,396,091.25
减：本报告期基金总赎回份额	268,605,566.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,565,605,571.52

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

因任期届满，并经第四届董事会第一次会议审议并决议，关林戈先生不再担任公司总经理；韩浩先生不再担任公司副总经理；彭洪波先生不再担任公司督察长；聘任熊科金先生为公司总经理，车君女士为公司督察长。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

公司总行资产托管部原总经理夏博辉同志已调离招商银行，根据公司招银发[2011]331 号文，夏博辉先生不再担任公司总行资产托管部总经理职务，公司已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金自 2011 年 4 月 1 日起跟踪的标的指数由原来的中信标普 300 指数变更为沪深 300 指数，而基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略等未发生变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。 2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币伍万元。 3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所，为本基金提供审计服务 3 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	597,071,269.53	66.05%	507,509.98	67.06%	-
长城证券	1	306,850,764.35	33.95%	249,318.43	32.94%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：无

2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金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、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	6,769,104.60	100.00%	-	-	-	-