

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 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 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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 08 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动	43

§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 备查文件目录	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金
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	1,677,423,610.05 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 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数量化投资技术，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。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险，获取市场平均收益。

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
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		杨光裕	傅育宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-50,179,305.42
本期利润	70,444,944.90
加权平均基金份额本期利润	0.0421
本期加权平均净值利润率	4.20%
本期基金份额净值增长率	5.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,272,533,189.35

期末可供分配基金份额利润	-0.7586
期末基金资产净值	1,638,522,481.15
期末基金份额净值	0.9768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	152.71%

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“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去一个月	-5.22%	1.03%	-6.15%	1.04%	0.93%	-0.01%
过去三个月	1.35%	1.05%	0.29%	1.07%	1.06%	-0.02%
过去六个月	5.41%	1.25%	4.76%	1.26%	0.65%	-0.01%
过去一年	-17.40%	1.27%	-18.16%	1.28%	0.76%	-0.01%
过去三年	-19.72%	1.48%	-19.69%	1.48%	-0.03%	0.00%
自基金合同生效起至今	152.71%	1.77%	119.16%	1.78%	33.55%	-0.01%

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：

$$\text{从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准收益率} = (1 + \text{D1 日业绩比较基准收益率}) \times (1 + \text{D2 日业绩比较基准收益率}) \times \dots \times (1 + \text{Dn 日业绩比较基准收益率}) - 1$$

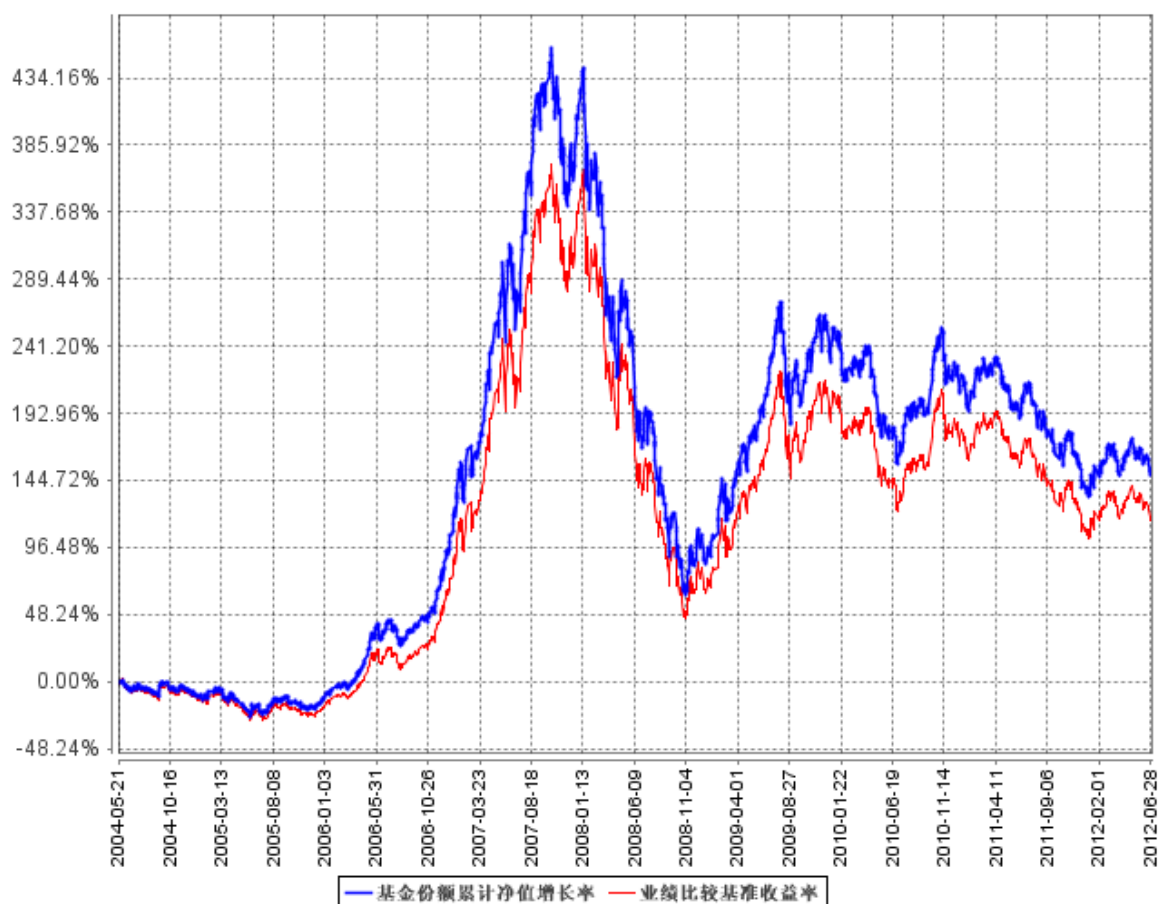
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

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 日后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%。

§ 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和长城优化升级股票型证券投资基金。

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	公司总经理助理、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	-	12 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遵规守信情况的说明

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。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过信息系统以及人工严格保证交易公平制度的执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易制度》的规定，在投资决策、交易执行、风险监控等环节保证投资者的利益得到公平对待。

在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控部门在事前、事中、事后加大监控力度。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易进行事后分析，定期出具公平交易制度执行情况分析报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内。通过上述分析我们得出结论：在本报告期，公平交易制度在本基金管理人内部得到了贯彻执行，不同投资者的利益得到了公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

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

2012 年上半年, 伴随着宏观调控政策的预调微调, 以及国际经济政治环境的动荡反复, 国内宏观经济继续呈现增速回落态势。外部环境方面: 希腊由于主权债务危机引发政治动荡至 6 月末才以组成新政府而告一段落, 而围绕救助与紧缩政策的政治博弈还在继续, 欧元区经济整体上处于衰退之中; 美国经济虽有反复, 但整体上仍在温和复苏。国内通胀压力进一步缓解, CPI 在 1 月份由于季节性因素达到 4.5% 的高点后, 呈现逐月震荡回落的态势, 到六月份已经回落到 2.2% 的较低水平, 以至于开始出现对通缩的担忧。伴随着通胀的回落及经济增长的减速, 宏观经济政策逐步走向货币放松和“稳增长”上来。央行通过下调存款准备金率和降息的措施释放流动性。发改委和部分地方政府则通过批准新投资项目、汽车家电的节能补贴、结构性放松房地产等措施来实现稳定经济增长的目标。证券市场则整体上呈现出宽幅震荡、结构分化加剧的态势。报告期内, 处于景气高点的食品饮料、景气逐步向好的医药、预期政策见底、估值水平较低的房地产、金融创新政策带来业绩预期改善的券商、保险等有良好的表现。而大量的中游制造业和上游原材料则由于需求疲弱、产品价格下跌等导致业绩预期不断下调, 股价表现落后。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 4.94%, 本基金比较基准涨幅为 4.76%, 本基金净值增长率为 5.41%。本基金报告期内日均跟踪误差为 0.0380%, 年化跟踪误差为 0.5887%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 我们认为, 伴随着“稳增长”政策的陆续实施, 以及基数效应, 二季度可能是经济增长的阶段性底部, 宏观经济有望在下半年企稳并温和复苏; 外需乏力、国内消费疲弱, 政府短期刺激经济增长的着力点依然在投资。然而由于政策空间相对有限和动荡的外部环境, 宏观经济将很可能是阶段性的弱复苏。证券市场短期内仍然处于政策预期与基本面何时触底的存量资金的博弈过程中。中长期来看, 中国潜在经济增长率下移不可避免, 经济结构转型势在必行。在转型过程中, 上市公司整体上盈利能力不可避免地受到影响, 证券市场将维持反复震荡调整、结构不断分化的态势。考虑到货币政策的逐步宽松以及周期股的调整幅度已经较大, 市场下跌空间有限, 但是反弹也会比较疲弱。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、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素，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、操作性强、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-1,272,533,189.35 元，不进行收益分配。

§ 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	90,283,850.97	89,129,304.61

结算备付金		1,737,225.82	53,674.04
存出保证金		500,000.00	760,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,545,328,436.93	1,372,889,936.71
其中：股票投资		1,545,328,436.93	1,372,889,936.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	19,007.14	19,474.95
应收股利		3,161,609.32	-
应收申购款		901,390.98	1,069,149.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,641,931,521.16	1,463,921,539.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	10,471,230.36
应付赎回款		677,414.45	368,951.72
应付管理人报酬		1,374,312.24	1,243,677.98
应付托管费		280,471.90	253,811.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	398,679.02	107,568.90
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	678,162.40	552,732.56
负债合计		3,409,040.01	12,997,973.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,677,423,610.05	1,565,605,571.52
未分配利润	6.4.7.10	-38,901,128.90	-114,682,004.90
所有者权益合计		1,638,522,481.15	1,450,923,566.62
负债和所有者权益总计		1,641,931,521.16	1,463,921,539.99

注：截至 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9768 元，基金份额总额 1,677,423,610.05 份。

6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		81,268,085.72	-42,455,222.49
1.利息收入		358,587.85	391,707.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	358,154.37	390,747.77
债券利息收入		433.48	959.60
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）		-40,057,764.60	22,449,671.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-58,837,013.71	6,804,583.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	180,201.02	440,674.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	18,599,048.09	15,204,413.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	120,624,250.32	-65,581,404.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	343,012.15	284,803.53
二、费用		10,823,140.82	12,540,663.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,145,937.03	9,277,950.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,662,436.15	1,893,459.20
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	840,383.30	1,186,407.36
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	174,384.34	182,846.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		70,444,944.90	-54,995,885.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		70,444,944.90	-54,995,885.51

6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	1,565,605,571.52	-114,682,004.90	1,450,923,566.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	70,444,944.90	70,444,944.90
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）	111,818,038.53	5,335,931.10	117,153,969.63
其中：1.基金申购款	384,712,283.44	6,849,775.42	391,562,058.86
2.基金赎回款	-272,894,244.91	-1,513,844.32	-274,408,089.23
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）	1,677,423,610.05	-38,901,128.90	1,638,522,481.15
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	-	-54,995,885.51	-54,995,885.51
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）	-71,986,639.22	-20,851,592.65	-92,838,231.87
其中：1.基金申购款	111,911,999.34	23,090,622.45	135,002,621.79
2.基金赎回款	-183,898,638.56	-43,942,215.10	-227,840,853.66
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）	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,547,828,407.43	282,545,589.26	1,830,373,996.69

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨光裕</u>	<u>熊科金</u>	<u>彭洪波</u>
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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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，并按照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 3 号《半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》和《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编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局研究决定，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》的规定，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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	90,283,850.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	90,283,850.97

注：本基金本期末投资于定期存款和其他存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,904,371,429.36	1,545,328,436.93	-359,042,992.43
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,904,371,429.36	1,545,328,436.93	-359,042,992.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	18,223.65
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	781.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.79
其他	-
合计	19,007.14

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	398,679.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	398,679.02

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	4,121.26
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	149,178.12
合计	678,162.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,565,605,571.52	1,565,605,571.52
本期申购	384,712,283.44	384,712,283.44
本期赎回(以“-”号填列)	-272,894,244.91	-272,894,244.91
本期末	1,677,423,610.05	1,677,423,610.05

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,140,338,074.68	1,025,656,069.78	-114,682,004.90
本期利润	-50,179,305.42	120,624,250.32	70,444,944.90
本期基金份额交易产生的变动数	-82,015,809.25	87,351,740.35	5,335,931.10
其中：基金申购款	-282,190,947.99	289,040,723.41	6,849,775.42
基金赎回款	200,175,138.74	-201,688,983.06	-1,513,844.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,272,533,189.35	1,233,632,060.45	-38,901,128.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	342,889.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,471.71
其他	10,792.90
合计	358,154.37

注：其他包括申购款利息收入 10,079.20 元以及权证保证金利息收入 713.70 元。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	236,392,236.71
减：卖出股票成本总额	295,229,250.42
买卖股票差价收入	-58,837,013.71

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,817,634.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,637,000.00
减：应收利息总额	433.48
债券投资收益	180,201.02

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	18,599,048.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,599,048.09

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	120,624,250.32
——股票投资	120,624,250.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	120,624,250.32

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	335,947.84
转出基金补偿收入	7,064.31
合计	343,012.15

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	840,383.30
银行间市场交易费用	-
合计	840,383.30

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	149,178.12
银行费用	343.20
合计	174,384.34

6.4.7.20 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

于本报告期，并无对本基金存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	149,948,877.54	25.78%	248,273,834.01	33.31%
东方证券	103,237,064.56	17.75%	497,080,734.49	66.69%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	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 成交总额的 比例
东方证券	2,817,634.50	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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	123,912.17	25.01%	94,717.72	23.76%
东方证券	88,300.11	17.82%	20,800.53	5.22%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	201,724.39	32.32%	173,240.67	34.20%
东方证券	422,518.85	67.68%	333,384.48	65.80%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,145,937.03	9,277,950.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,749,222.76	2,098,863.48

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 为每日应计提的基金管理费

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。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,662,436.15	1,893,459.20

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未投资于本基金，于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.4.2 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，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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	
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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	90,283,850.97	342,889.76	96,556,460.86	380,732.88

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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
002500	山西证券	2012 年 5 月 15 日	重大事项停牌	8.19	-	-	223,100	1,924,806.76	1,827,189.00	-
000059	辽通化工	2012 年 6 月 26 日	重大事项停牌	7.91	2012 年 7 月 3 日	8.15	206,766	1,964,556.31	1,635,519.06	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 06 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	90,283,850.97	-	-	-	-	-	90,283,850.97
结算备付金	1,737,225.82	-	-	-	-	-	1,737,225.82
存出保证金	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,545,328,436.93	1,545,328,436.93
应收利息	-	-	-	-	-	19,007.14	19,007.14
应收股利	-	-	-	-	-	3,161,609.32	3,161,609.32
应收申购款	-	-	-	-	-	901,390.98	901,390.98
资产总计	92,021,076.79	-	-	-	-	1,549,910,444.37	1,641,931,521.16
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	677,414.45	677,414.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,374,312.24	1,374,312.24
应付托管费	-	-	-	-	-	280,471.90	280,471.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	398,679.02	398,679.02
其他负债	-	-	-	-	-	678,162.40	678,162.40
负债总计	-	-	-	-	-	3,409,040.01	3,409,040.01
利率敏感度缺口	92,021,076.79	-	-	-	-	-	
上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	89,129,304.61	-	-	-	-	-	89,129,304.61
结算备付金	53,674.04	-	-	-	-	-	53,674.04
存出保证金	260,000.00	-	-	-	-	500,000.00	760,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,372,889,936.71	1,372,889,936.71
应收利息	-	-	-	-	-	19,474.95	19,474.95
应收申购款	1,069,149.68	-	-	-	-	-	1,069,149.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	90,512,128.33	-	-	-	-	1,373,409,411.66	1,463,921,539.99
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,471,230.36	10,471,230.36
应付赎回款	-	-	-	-	-	368,951.72	368,951.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,243,677.98	1,243,677.98
应付托管费	-	-	-	-	-	253,811.85	253,811.85
应付交易费用	-	-	-	-	-	107,568.90	107,568.90
其他负债	-	-	-	-	-	552,732.56	552,732.56
负债总计	-	-	-	-	-	12,997,973.37	12,997,973.37
利率敏感度缺口	90,512,128.33	-	-	-	-		

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资，因此在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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%。于本期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,545,328,436.93	94.31	1,372,889,936.71	94.62

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,545,328,436.93	94.31	1,372,889,936.71	94.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2012年6月30日)	上年度末 (2011年12月31日)
	沪深300指数上升5%	77,057,802.51	67,099,995.66
	沪深300指数下降5%	-77,057,802.51	-67,099,995.66

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,545,328,436.93	94.12
	其中：股票	1,545,328,436.93	94.12
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	92,021,076.79	5.60
6	其他各项资产	4,582,007.44	0.28
7	合计	1,641,931,521.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	10,117,802.15	0.62
B	采掘业	156,186,853.08	9.53
C	制造业	530,559,761.08	32.38
C0	食品、饮料	120,749,743.17	7.37
C1	纺织、服装、皮毛	4,159,784.31	0.25
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,969,754.89	1.71
C5	电子	16,621,558.96	1.01
C6	金属、非金属	123,587,329.71	7.54
C7	机械、设备、仪表	162,989,086.98	9.95
C8	医药、生物制品	73,941,774.84	4.51
C99	其他制造业	540,728.22	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	35,160,526.97	2.15
E	建筑业	42,689,579.00	2.61
F	交通运输、仓储业	42,353,070.44	2.58
G	信息技术业	44,936,690.39	2.74
H	批发和零售贸易	40,510,605.48	2.47
I	金融、保险业	483,067,029.64	29.48
J	房地产业	83,976,627.58	5.13
K	社会服务业	12,523,952.25	0.76
L	传播与文化产业	3,223,380.00	0.20
M	综合类	25,236,575.94	1.54
	合计	1,510,542,454.00	92.19

7.2.2 积极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	-	-
B	采掘业	2,648,585.00	0.16
C	制造业	14,244,300.00	0.87
C0	食品、饮料	564,200.00	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	1,671,000.00	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,096,050.00	0.25
C5	电子	5,741,450.00	0.35
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2,171,600.00	0.13
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,524,000.00	0.46
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,972,497.93	0.12
I	金融、保险业	6,375,600.00	0.39
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	2,021,000.00	0.12
M	综合类	-	-
	合计	34,785,982.93	2.12

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 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所有股票投资明细

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	8,367,268	50,119,935.32	3.06
2	601318	中国平安	1,052,632	48,147,387.68	2.94
3	601166	兴业银行	2,906,688	37,728,810.24	2.30
4	600000	浦发银行	4,267,347	34,693,531.11	2.12
5	601328	交通银行	7,440,436	33,779,579.44	2.06
6	600519	贵州茅台	136,772	32,709,023.80	2.00
7	600030	中信证券	2,465,912	31,144,468.56	1.90
8	000002	万科A	3,070,456	27,357,762.96	1.67
9	600837	海通证券	2,749,122	26,474,044.86	1.62

10	601088	中国神华	1,040,088	23,381,178.24	1.43
11	601601	中国太保	983,285	21,809,261.30	1.33
12	601169	北京银行	2,226,277	21,750,726.29	1.33
13	000858	五粮液	662,067	21,689,314.92	1.32
14	601398	工商银行	5,176,752	20,448,170.40	1.25
15	600111	包钢稀土	470,217	18,554,762.82	1.13
16	000001	深发展 A	1,151,535	17,457,270.60	1.07
17	601288	农业银行	6,596,865	17,085,880.35	1.04
18	601668	中国建筑	4,876,448	16,287,336.32	0.99
19	600048	保利地产	1,393,132	15,798,116.88	0.96
20	600015	华夏银行	1,589,075	15,048,540.25	0.92
21	000157	中联重科	1,414,556	14,187,996.68	0.87
22	000651	格力电器	668,986	13,948,358.10	0.85
23	002304	洋河股份	103,371	13,908,568.05	0.85
24	600031	三一重工	986,382	13,730,437.44	0.84
25	601939	建设银行	3,247,595	13,639,899.00	0.83
26	601006	大秦铁路	1,911,296	13,436,410.88	0.82
27	601818	光大银行	4,020,773	11,418,995.32	0.70
28	600900	长江电力	1,631,774	11,096,063.20	0.68
29	002024	苏宁电器	1,310,192	10,992,510.88	0.67
30	600887	伊利股份	529,468	10,896,451.44	0.67
31	000568	泸州老窖	256,807	10,865,504.17	0.66
32	600104	上汽集团	689,929	9,859,085.41	0.60
33	600050	中国联通	2,649,513	9,856,188.36	0.60
34	601857	中国石油	1,088,997	9,855,422.85	0.60
35	601899	紫金矿业	2,526,697	9,803,584.36	0.60
36	600585	海螺水泥	640,277	9,488,905.14	0.58
37	600383	金地集团	1,417,145	9,183,099.60	0.56
38	000776	广发证券	300,557	8,965,615.31	0.55
39	600256	广汇能源	665,463	8,963,786.61	0.55
40	601628	中国人寿	480,325	8,789,947.50	0.54
41	000063	中兴通讯	613,588	8,565,688.48	0.52
42	600795	国电电力	3,160,911	8,534,459.70	0.52
43	600028	中国石化	1,343,722	8,465,448.60	0.52
44	000983	西山煤电	514,597	8,027,713.20	0.49
45	600518	康美药业	507,827	7,830,692.34	0.48
46	600547	山东黄金	230,566	7,571,787.44	0.46
47	600019	宝钢股份	1,704,514	7,363,500.48	0.45
48	000338	潍柴动力	246,096	7,306,590.24	0.45

49	000527	美的电器	660,927	7,303,243.35	0.45
50	000069	华侨城 A	1,135,125	7,242,097.50	0.44
51	000423	东阿阿胶	178,385	7,137,183.85	0.44
52	000792	盐湖股份	210,302	7,101,898.54	0.43
53	600489	中金黄金	318,021	6,843,811.92	0.42
54	601989	中国重工	1,313,747	6,818,346.93	0.42
55	600739	辽宁成大	436,943	6,816,310.80	0.42
56	000629	攀钢钒钛	1,022,950	6,731,011.00	0.41
57	000895	双汇发展	108,607	6,720,601.16	0.41
58	601988	中国银行	2,356,932	6,646,548.24	0.41
59	600362	江西铜业	265,931	6,358,410.21	0.39
60	601009	南京银行	733,199	6,246,855.48	0.38
61	601699	潞安环能	293,121	6,079,329.54	0.37
62	601788	光大证券	460,437	6,063,955.29	0.37
63	600690	青岛海尔	509,397	5,970,132.84	0.36
64	600276	恒瑞医药	205,327	5,894,938.17	0.36
65	000538	云南白药	99,303	5,886,681.84	0.36
66	601688	华泰证券	558,858	5,868,009.00	0.36
67	600089	特变电工	861,358	5,831,393.66	0.36
68	600406	国电南瑞	303,595	5,674,190.55	0.35
69	601600	中国铝业	915,265	5,647,185.05	0.34
70	600348	阳泉煤业	364,543	5,577,507.90	0.34
71	000024	招商地产	223,731	5,488,121.43	0.33
72	601766	中国南车	1,201,043	5,476,756.08	0.33
73	601299	中国北车	1,325,816	5,316,522.16	0.32
74	000783	长江证券	575,228	5,234,574.80	0.32
75	601168	西部矿业	605,999	5,187,351.44	0.32
76	000402	金融街	780,427	5,096,188.31	0.31
77	601991	大唐发电	861,766	4,851,742.58	0.30
78	600309	烟台万华	356,497	4,759,234.95	0.29
79	600999	招商证券	400,000	4,644,000.00	0.28
80	601898	中煤能源	589,867	4,565,570.58	0.28
81	000709	河北钢铁	1,635,443	4,464,759.39	0.27
82	600068	葛洲坝	680,599	4,444,311.47	0.27
83	600642	申能股份	942,990	4,347,183.90	0.27
84	601186	中国铁建	976,794	4,346,733.30	0.27
85	000630	铜陵有色	225,141	4,345,221.30	0.27
86	600535	天士力	99,255	4,339,428.60	0.26
87	000100	TCL 集团	2,109,517	4,282,319.51	0.26

88	601390	中国中铁	1,659,036	4,263,722.52	0.26
89	600100	同方股份	501,265	4,220,651.30	0.26
90	000623	吉林敖东	242,748	4,209,250.32	0.26
91	600600	青岛啤酒	109,509	4,182,148.71	0.26
92	600150	中国船舶	180,970	4,156,880.90	0.25
93	600009	上海机场	324,837	4,138,423.38	0.25
94	000060	中金岭南	478,958	4,128,617.96	0.25
95	600010	宝钢股份	838,429	4,091,533.52	0.25
96	000878	云南铜业	227,571	4,073,520.90	0.25
97	601998	中信银行	1,005,585	4,022,340.00	0.25
98	600875	东方电气	217,887	3,904,535.04	0.24
99	600369	西南证券	343,465	3,884,589.15	0.24
100	600123	兰花科创	214,860	3,880,371.60	0.24
101	002142	宁波银行	387,978	3,872,020.44	0.24
102	600549	厦门钨业	87,098	3,824,473.18	0.23
103	600583	海油工程	627,348	3,820,549.32	0.23
104	000425	徐工机械	263,557	3,779,407.38	0.23
105	000039	中集集团	280,132	3,725,755.60	0.23
106	000562	宏源证券	225,088	3,722,955.52	0.23
107	601666	平煤股份	367,297	3,717,045.64	0.23
108	600196	复星医药	358,885	3,700,104.35	0.23
109	000012	南玻 A	407,017	3,663,153.00	0.22
110	601618	中国中冶	1,476,019	3,660,527.12	0.22
111	600085	同仁堂	209,005	3,647,137.25	0.22
112	600188	兖州煤业	191,780	3,639,984.40	0.22
113	601958	金钼股份	287,256	3,639,533.52	0.22
114	000009	中国宝安	360,243	3,602,430.00	0.22
115	600660	福耀玻璃	454,640	3,555,284.80	0.22
116	002422	科伦药业	75,871	3,540,140.86	0.22
117	601919	中国远洋	758,215	3,518,117.60	0.21
118	600415	小商品城	448,011	3,494,485.80	0.21
119	000869	张裕 A	51,927	3,492,610.02	0.21
120	600271	航天信息	184,450	3,487,949.50	0.21
121	000581	威孚高科	126,260	3,459,524.00	0.21
122	600029	南方航空	748,658	3,451,313.38	0.21
123	000728	国元证券	314,926	3,435,842.66	0.21
124	000937	冀中能源	223,296	3,409,729.92	0.21
125	002155	辰州矿业	176,119	3,409,663.84	0.21
126	600177	雅戈尔	399,283	3,389,912.67	0.21

127	600881	亚泰集团	614,164	3,377,902.00	0.21
128	600066	宇通客车	149,682	3,361,857.72	0.21
129	601111	中国国航	544,281	3,347,328.15	0.20
130	600143	金发科技	551,129	3,290,240.13	0.20
131	600694	大商股份	97,267	3,253,581.15	0.20
132	002415	海康威视	119,540	3,251,488.00	0.20
133	600166	福田汽车	454,608	3,250,447.20	0.20
134	600005	武钢股份	1,207,577	3,248,382.13	0.20
135	600115	东方航空	769,784	3,217,697.12	0.20
136	600376	首开股份	242,098	3,205,377.52	0.20
137	600109	国金证券	221,347	3,185,183.33	0.19
138	600153	建发股份	443,914	3,178,424.24	0.19
139	601808	中海油服	189,134	3,122,602.34	0.19
140	600058	五矿发展	138,103	3,083,839.99	0.19
141	000422	湖北宣化	251,662	3,082,859.50	0.19
142	600655	豫园商城	383,913	3,025,234.44	0.18
143	000625	长安汽车	617,829	3,015,005.52	0.18
144	600809	山西汾酒	79,818	3,008,340.42	0.18
145	000960	锡业股份	151,513	2,984,806.10	0.18
146	000933	神火股份	322,185	2,938,327.20	0.18
147	000999	华润三九	134,374	2,936,071.90	0.18
148	600741	华域汽车	322,751	2,895,076.47	0.18
149	600252	中恒集团	262,797	2,880,255.12	0.18
150	000768	西飞国际	364,989	2,865,163.65	0.17
151	600703	三安光电	209,419	2,850,192.59	0.17
152	600395	盘江股份	105,851	2,845,274.88	0.17
153	601377	兴业证券	271,031	2,840,404.88	0.17
154	600674	川投能源	408,390	2,826,058.80	0.17
155	600497	驰宏锌锗	200,636	2,822,948.52	0.17
156	000800	一汽轿车	256,912	2,790,064.32	0.17
157	600259	广晟有色	42,281	2,787,586.33	0.17
158	600779	水井坊	114,069	2,768,454.63	0.17
159	601106	中国一重	867,456	2,741,160.96	0.17
160	601333	广深铁路	931,349	2,738,166.06	0.17
161	600832	东方明珠	508,292	2,729,528.04	0.17
162	601117	中国化学	472,365	2,725,546.05	0.17
163	002202	金风科技	422,707	2,709,551.87	0.17
164	000528	柳工	217,969	2,704,995.29	0.17
165	600649	城投控股	374,523	2,704,056.06	0.17

166	601717	郑煤机	230,404	2,672,686.40	0.16
167	000729	燕京啤酒	364,650	2,661,945.00	0.16
168	000758	中色股份	139,485	2,646,030.45	0.16
169	601607	上海医药	247,540	2,641,251.80	0.16
170	000825	太钢不锈	736,606	2,600,219.18	0.16
171	600108	亚盛集团	520,243	2,564,797.99	0.16
172	000876	新希望	170,682	2,556,816.36	0.16
173	601888	中国国旅	90,585	2,556,308.70	0.16
174	002038	双鹭药业	79,194	2,550,046.80	0.16
175	002001	新和成	119,904	2,533,571.52	0.15
176	002385	大北农	130,318	2,528,169.20	0.15
177	600588	用友软件	165,221	2,521,272.46	0.15
178	600839	四川长虹	1,190,938	2,512,879.18	0.15
179	600125	铁龙物流	295,988	2,509,978.24	0.15
180	002106	莱宝高科	124,399	2,496,687.93	0.15
181	600208	新湖中宝	602,558	2,488,564.54	0.15
182	600804	鹏博士	414,345	2,461,209.30	0.15
183	601118	海南橡胶	354,706	2,436,830.22	0.15
184	600219	南山铝业	359,068	2,405,755.60	0.15
185	601001	大同煤业	219,168	2,399,889.60	0.15
186	600811	东方集团	436,644	2,392,809.12	0.15
187	600267	海正药业	135,339	2,365,725.72	0.14
188	600372	中航电子	130,792	2,352,948.08	0.14
189	601018	宁波港	922,700	2,334,431.00	0.14
190	002092	中泰化学	304,645	2,330,534.25	0.14
191	000401	冀东水泥	162,231	2,280,967.86	0.14
192	600320	振华重工	539,647	2,277,310.34	0.14
193	000898	鞍钢股份	583,011	2,273,742.90	0.14
194	600893	航空动力	174,638	2,272,040.38	0.14
195	600266	北京城建	149,457	2,270,251.83	0.14
196	600216	浙江医药	89,667	2,255,125.05	0.14
197	002007	华兰生物	90,271	2,218,861.18	0.14
198	601101	昊华能源	129,536	2,217,656.32	0.14
199	002310	东方园林	37,699	2,213,308.29	0.14
200	600859	王府井	80,236	2,195,256.96	0.13
201	601918	国投新集	179,438	2,190,937.98	0.13
202	000718	苏宁环球	268,910	2,178,171.00	0.13
203	000778	新兴铸管	325,439	2,177,186.91	0.13
204	600895	张江高科	253,360	2,171,295.20	0.13

205	600062	华润双鹤	110,519	2,108,702.52	0.13
206	000969	安泰科技	172,357	2,107,926.11	0.13
207	000061	农产品	360,370	2,090,146.00	0.13
208	002073	软控股份	244,736	2,050,887.68	0.13
209	600997	开滦股份	193,264	2,023,474.08	0.12
210	600718	东软集团	231,341	1,991,846.01	0.12
211	600550	天威保变	227,772	1,988,449.56	0.12
212	000839	中信国安	294,914	1,981,822.08	0.12
213	600971	恒源煤电	141,448	1,970,370.64	0.12
214	601866	中海集运	776,427	1,964,360.31	0.12
215	600498	烽火通信	74,034	1,962,641.34	0.12
216	002146	荣盛发展	178,641	1,947,186.90	0.12
217	600664	哈药股份	293,772	1,935,957.48	0.12
218	600352	浙江龙盛	324,381	1,858,703.13	0.11
219	600118	中国卫星	146,973	1,850,390.07	0.11
220	601158	重庆水务	314,147	1,850,325.83	0.11
221	002500	山西证券	223,100	1,827,189.00	0.11
222	600316	洪都航空	139,837	1,822,076.11	0.11
223	600132	重庆啤酒	83,931	1,812,070.29	0.11
224	000680	山推股份	307,026	1,796,102.10	0.11
225	600516	方大炭素	209,298	1,787,404.92	0.11
226	002069	獐子岛	85,573	1,784,197.05	0.11
227	600331	宏达股份	219,985	1,768,679.40	0.11
228	600528	中铁二局	259,323	1,753,023.48	0.11
229	600970	中材国际	149,752	1,728,138.08	0.11
230	600160	巨化股份	169,166	1,708,576.60	0.10
231	600221	海南航空	347,714	1,696,844.32	0.10
232	600508	上海能源	93,564	1,696,315.32	0.10
233	002128	露天煤业	129,034	1,687,764.72	0.10
234	002299	圣农发展	116,346	1,680,036.24	0.10
235	601098	中南传媒	174,537	1,672,064.46	0.10
236	601179	中国西电	415,752	1,654,692.96	0.10
237	600598	北大荒	221,737	1,651,940.65	0.10
238	002344	海宁皮城	63,243	1,649,377.44	0.10
239	600812	华北制药	257,337	1,636,663.32	0.10
240	601933	永辉超市	60,380	1,636,298.00	0.10
241	000059	辽通化工	206,766	1,635,519.06	0.10
242	601099	太平洋	236,555	1,632,229.50	0.10
243	000807	云铝股份	270,849	1,595,300.61	0.10

244	600169	太原重工	451,591	1,585,084.41	0.10
245	600170	上海建工	218,705	1,579,050.10	0.10
246	600770	综艺股份	137,506	1,578,568.88	0.10
247	600500	中化国际	229,663	1,552,521.88	0.09
248	600037	歌华有线	206,018	1,551,315.54	0.09
249	600432	吉恩镍业	112,595	1,495,261.60	0.09
250	600595	中孚实业	263,358	1,469,537.64	0.09
251	000686	东北证券	83,913	1,438,268.82	0.09
252	601369	陕鼓动力	154,614	1,431,725.64	0.09
253	600418	江淮汽车	264,387	1,430,333.67	0.09
254	600546	山煤国际	66,231	1,385,552.52	0.08
255	000559	万向钱潮	270,109	1,358,648.27	0.08
256	600456	宝钛股份	70,658	1,326,250.66	0.08
257	000780	平庄能源	125,519	1,315,439.12	0.08
258	000961	中南建设	105,383	1,313,072.18	0.08
259	601992	金隅股份	190,471	1,266,632.15	0.08
260	000968	煤气化	82,695	1,261,098.75	0.08
261	600096	云天化	92,904	1,231,907.04	0.08
262	600183	生益科技	238,445	1,227,991.75	0.07
263	601718	际华集团	380,911	1,203,678.76	0.07
264	002405	四维图新	100,770	1,203,193.80	0.07
265	002122	天马股份	186,094	1,202,167.24	0.07
266	000021	长城开发	212,169	1,141,469.22	0.07
267	002431	棕榈园林	42,666	1,100,356.14	0.07
268	601258	庞大集团	170,017	1,037,103.70	0.06
269	002378	章源钨业	31,435	995,232.10	0.06
270	002603	以岭药业	35,519	978,548.45	0.06
271	002493	荣盛石化	63,293	970,281.69	0.06
272	600873	梅花集团	140,700	949,725.00	0.06
273	600307	酒钢宏兴	272,819	946,681.93	0.06
274	600783	鲁信创投	52,711	841,267.56	0.05
275	601233	桐昆股份	88,086	769,871.64	0.05
276	601558	华锐风电	107,420	753,014.20	0.05
277	002399	海普瑞	33,747	715,436.40	0.04
278	601268	二重重装	100,013	613,079.69	0.04
279	002594	比亚迪	27,227	540,728.22	0.03

7.3.2 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所有股票投资明细

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	601669	中国水电	1,200,000	5,244,000.00	0.32
2	600315	上海家化	105,000	4,096,050.00	0.25
3	002241	歌尔声学	105,000	3,831,450.00	0.23
4	601901	方正证券	570,000	2,895,600.00	0.18
5	002353	杰瑞股份	54,610	2,648,585.00	0.16
6	002081	金螳螂	60,000	2,280,000.00	0.14
7	601633	长城汽车	122,000	2,171,600.00	0.13
8	601928	凤凰传媒	235,000	2,021,000.00	0.12
9	600827	友谊股份	174,403	1,972,497.93	0.12
10	000725	京东方A	1,000,000	1,910,000.00	0.12
11	601555	东吴证券	200,000	1,768,000.00	0.11
12	601336	新华保险	50,000	1,712,000.00	0.10
13	601566	九牧王	60,000	1,671,000.00	0.10
14	002570	贝因美	28,000	564,200.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600016	民生银行	11,440,609.92	0.79
2	601318	中国平安	8,045,418.28	0.55
3	601166	兴业银行	7,571,813.66	0.52
4	601328	交通银行	7,180,311.27	0.49
5	600000	浦发银行	6,796,689.14	0.47
6	600030	中信证券	5,410,710.44	0.37
7	601669	中国水电	5,252,000.00	0.36
8	600519	贵州茅台	5,020,968.65	0.35
9	601088	中国神华	4,925,746.72	0.34
10	000002	万科A	4,707,844.61	0.32
11	600999	招商证券	4,641,667.00	0.32
12	600837	海通证券	4,633,878.46	0.32

13	000001	深发展 A	4,148,084.50	0.29
14	600315	上海家化	4,086,427.85	0.28
15	000858	五 粮 液	3,955,215.97	0.27
16	601398	工商银行	3,906,884.20	0.27
17	601601	中国太保	3,755,992.61	0.26
18	002241	歌尔声学	3,513,454.08	0.24
19	601169	北京银行	3,489,583.38	0.24
20	600104	上汽集团	3,107,711.96	0.21

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000001	深发展 A	10,740,360.56	0.74
2	601318	中国平安	6,345,566.38	0.44
3	600016	民生银行	6,014,426.54	0.41
4	601166	兴业银行	4,415,752.86	0.30
5	600000	浦发银行	4,310,903.10	0.30
6	600519	贵州茅台	4,145,145.71	0.29
7	601328	交通银行	3,950,034.42	0.27
8	000002	万 科 A	3,885,828.63	0.27
9	600030	中信证券	3,801,448.03	0.26
10	601088	中国神华	3,735,409.42	0.26
11	601727	上海电气	3,700,819.87	0.26
12	601601	中国太保	3,445,331.65	0.24
13	600837	海通证券	3,237,922.72	0.22
14	600111	包钢稀土	2,625,863.19	0.18
15	000858	五 粮 液	2,521,237.39	0.17
16	601398	工商银行	2,518,856.41	0.17
17	601169	北京银行	2,475,593.92	0.17
18	600582	天地科技	2,454,141.74	0.17
19	600635	大众公用	2,325,550.46	0.16
20	000651	格力电器	2,235,939.49	0.15

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。

7.4.3 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	347,043,500.32
卖出股票收入（成交）总额	236,392,236.71

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

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本报告期内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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,161,609.32
4	应收利息	19,007.14
5	应收申购款	901,390.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,582,007.44

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.9.5.1 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。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
93,887	17,866.41	120,024,237.30	7.16%	1,557,399,372.75	92.84%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	203,048.73	0.0121%

注：①本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0。

②本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§ 9 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	1,565,605,571.52
本报告期基金总申购份额	384,712,283.44
减：本报告期基金总赎回份额	272,894,244.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,677,423,610.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

经公司第四届董事会第十二次会议审议并决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】881 号文核准批复，聘任彭洪波先生和桑煜先生为公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华西证券	1	317,660,616.37	54.61%	273,987.64	55.31%	-
长城证券	1	149,948,877.54	25.78%	123,912.17	25.01%	-
东方证券	1	103,237,064.56	17.75%	88,300.11	17.82%	-
银河证券	1	10,843,863.88	1.86%	9,190.18	1.86%	-

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
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (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。

10.7.2 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
华西证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	2,817,634.50	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中信证券（浙江）增加为代销机构及开通定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 2 月 15 日
2	关于与通联支付合作开通农行、建行借记卡网上交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 1 日
3	关于民族证券增加为代销机构及开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 14 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 3 月 29 日
5	关于大同证券增加为代销机构及开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 5 日
6	关于恢复旗下基金所持中百集团股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2012 年 4 月 25 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (二) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

11.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>