

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2012 年年度报告

2012 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：2013 年 3 月 26 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 2013 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。

本报告期自 2012 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
8.7 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.....	52
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.....	52

8.9 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息.....	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
§10 开放式基金份额变动.....	54
§11 重大事件揭示.....	54
11.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8 其他重大事件	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§13 备查文件目录.....	57
13.1 备查文件目录	57
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§ 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	1,895,275,936.88 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	自基金合同生效至 2011 年 3 月 31 日的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中信标普 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ ；自 2011 年 4 月 1 日开始业绩比较基准为： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
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 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-84,700,344.21	-22,477,091.37	-6,453,503.55

本期利润	127,421,902.07	-450,627,805.43	-235,168,284.91
加权平均基金份额本期利润	0.0737	-0.2889	-0.1333
本期加权平均净值利润率	7.68%	-25.35%	-11.07%
本期基金份额净值增长率	7.92%	-24.12%	-11.05%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-1,471,982,039.01	-1,140,338,074.68	-1,156,517,342.19
期末可供分配基金份额利润	-0.7767	-0.7284	-0.7140
期末基金资产净值	1,895,476,096.38	1,450,923,566.62	1,978,208,114.07
期末基金份额净值	1.0001	0.9267	1.2213
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	158.74%	139.75%	215.97%

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
过去三个月	8.99%	1.20%	9.53%	1.22%	-0.54%	-0.02%
过去六个月	2.39%	1.16%	2.43%	1.18%	-0.04%	-0.02%
过去一年	7.92%	1.20%	7.30%	1.22%	0.62%	-0.02%
过去三年	-27.16%	1.31%	-27.29%	1.32%	0.13%	-0.01%
过去五年	-48.76%	1.87%	-48.55%	1.86%	-0.21%	0.01%
自基金合同生效日起至今	158.74%	1.74%	124.49%	1.74%	34.25%	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

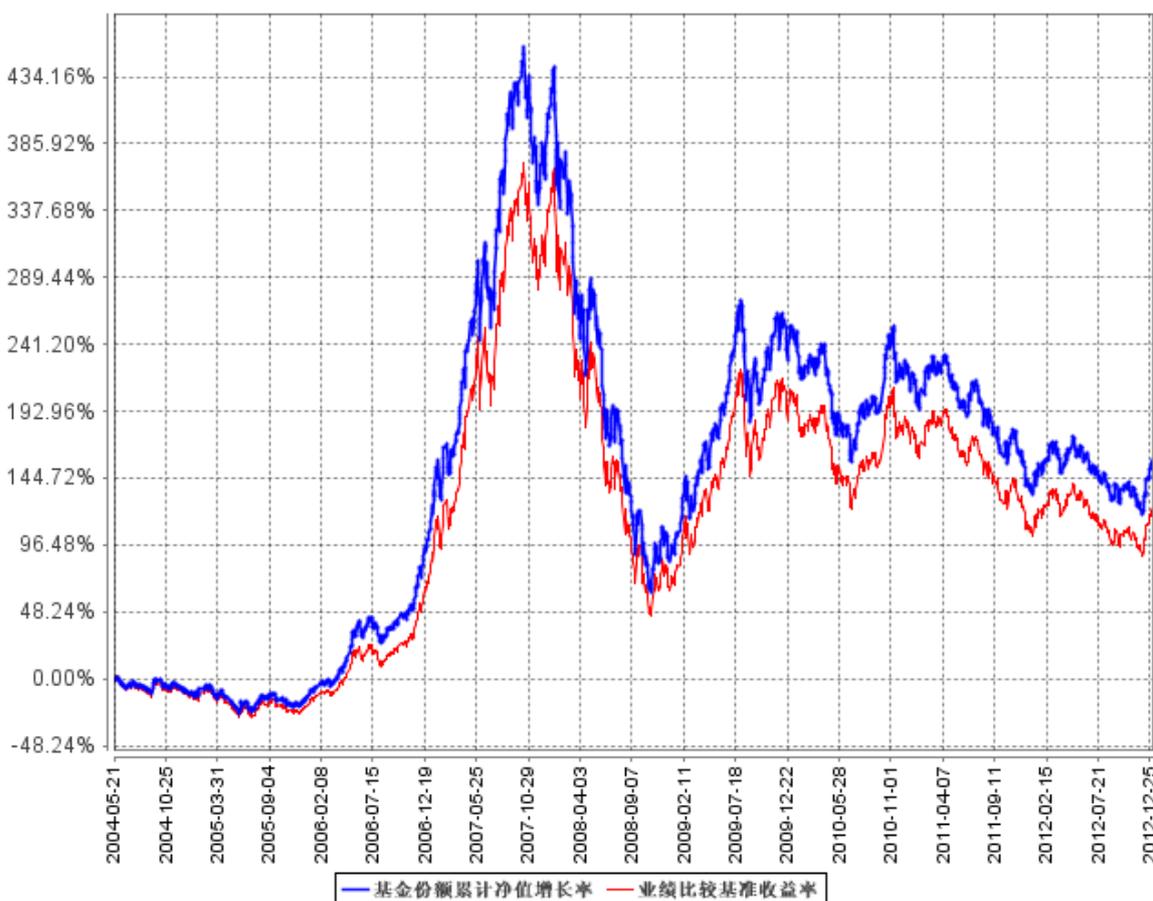
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

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

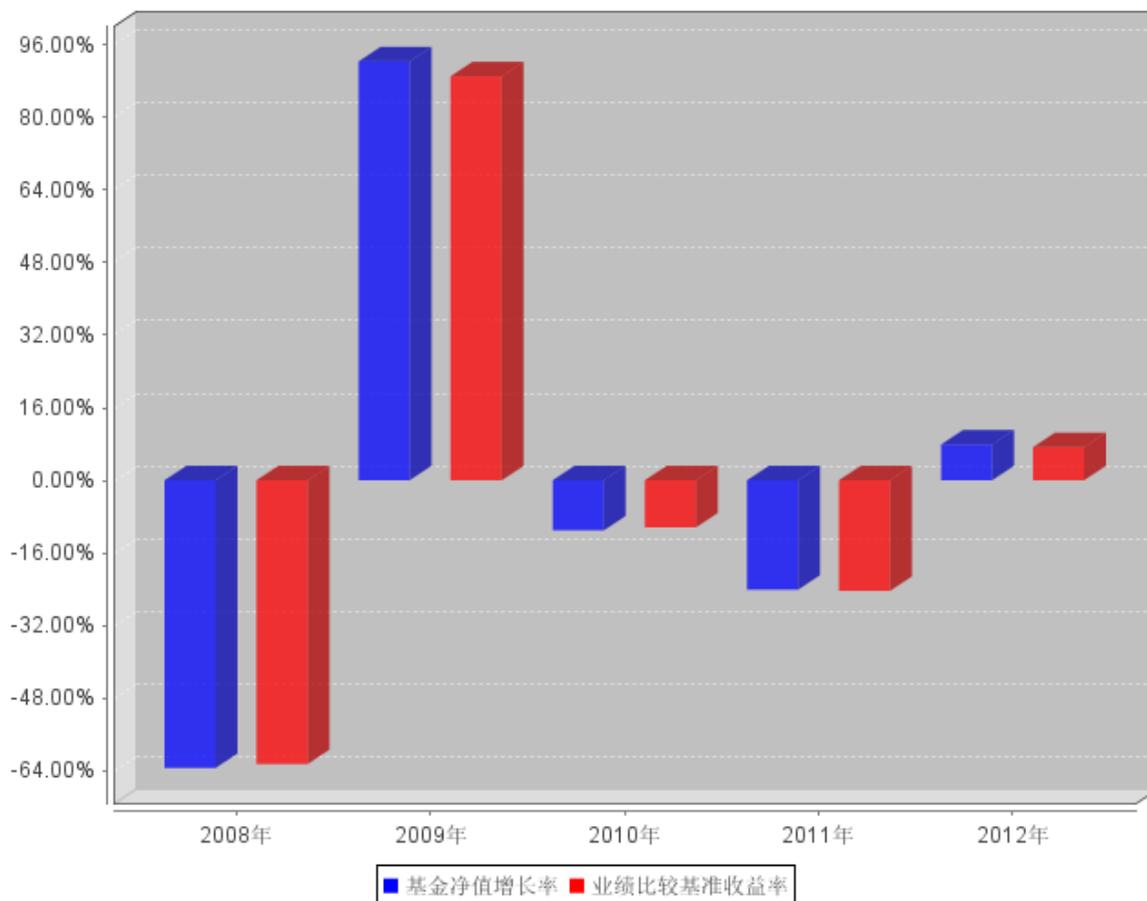
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金。

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、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、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《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管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

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，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。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，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 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

本报告期内，我国所处的外部经济环境依然疲弱，但是不确定性大为降低。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，美联储在三季度末推出了新一轮量化宽松政策，并且在年末推出了后续政策以维持弱复苏的格局，努力降低失业率。相比之下欧元区国家则继续纠结于财政紧缩和刺激增长两种解决主权债务危机途径之中，但是并无新的危机因素出现。国内宏观经济最终呈现出探底回升的态势：通胀指标终于开始稳步回落并在年底达到 2.5% 的较低水平；伴随着 CPI 的回落，货币政策也有所松动，年内多次下调存款准备金率和存贷款利率，进入下半年后持续采用公开市场操作调节流动性，并稳步推进利率市场化；发改委适时放行地方投资项目，固定资产投资增速也企稳回升。在流动性放松和“稳增长”措施的推动下，房地产市场逐步回暖，宏观经济也终于在三季度末见底后缓慢复苏。金融领域则是创新主题贯穿全年。A 股市场 2012 年总体呈现宽幅震荡的走势，各主要板块全年都有阶段性的表现，年底在“十八大”胜利召开后，在多重政策呵护下蓝筹股出现快速的估值修复行情。全年沪深 300 指数收益率为 7.55%。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 7.55%，本基金比较基准涨幅为 7.30%，本基金净值增长率为 7.92%，小幅领先比较基准。本基金日均跟踪误差为 0.0368%，年化跟踪误差为 0.5706%。

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 2013 年，我们认为外部需求依然难见大的起色，但是面临的不确定性降低，依赖外需拉动国内宏观经济增长并不现实，因此经济复苏仍然要依靠内需。新一届政府“新型工业化、信息化、城镇化、农业现代化”的政策在“两会”后将逐步细化，宏观经济有望在持续的温和复苏中走上依靠内需增长的转型之路。预计全年通胀水平虽有上行压力但仍能维持在合理水平，货币政策将比上年相对宽松，金融创新继续深化。经过 2012 年底蓝筹股估值修复后，目前估值水平仍处于合理偏低水平。因此总体上我们判断，证券市场活跃程度将好于 2012 年。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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监控和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 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。

4.8 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-1,471,982,039.01 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2013）审字第 60737541_H04 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长城久泰沪深 300 指数证券投资基金财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表和 2012 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长城基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、实施和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	昌 华 周刚
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2013 年 3 月 22 日

§ 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：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	96,821,825.02	89,129,304.61
结算备付金		96,234.60	53,674.04
存出保证金		500,000.00	760,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,801,226,404.29	1,372,889,936.71
其中：股票投资		1,801,226,404.29	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	21,987.89	19,474.95
应收股利		-	-
应收申购款		666,673.95	1,069,149.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,899,333,125.75	1,463,921,539.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31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	7.4.7.3	-	-
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		1,171,903.17	368,951.72
应付管理人报酬		1,452,629.08	1,243,677.98
应付托管费		296,454.94	253,811.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	278,847.34	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	7.4.7.8	657,194.84	552,732.56
负债合计		3,857,029.37	12,997,973.37
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,895,275,936.88	1,565,605,571.52
未分配利润	7.4.7.10	200,159.50	-114,682,004.90
所有者权益合计		1,895,476,096.38	1,450,923,566.62
负债和所有者权益总计		1,899,333,125.75	1,463,921,539.99

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0001 元，基金份额总额 1,895,275,936.88 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		148,538,592.25	-427,831,946.72
1.利息收入		731,804.85	752,174.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	729,341.56	750,556.06
债券利息收入		2,463.29	1,618.36
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）		-64,749,762.66	-835,177.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-93,994,755.47	-21,164,192.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	177,667.21	454,486.24
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	29,067,325.60	19,874,528.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	212,122,246.28	-428,150,714.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	434,303.78	401,770.40
二、费用		21,116,690.18	22,795,858.71
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,216,266.15	17,454,879.31
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,309,442.05	3,562,220.27
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,240,284.25	1,417,534.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	350,697.73	361,224.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		127,421,902.07	-450,627,805.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		127,421,902.07	-450,627,805.43

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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	1,565,605,571.52	-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）	-	127,421,902.07	127,421,902.07
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）	329,670,365.36	-12,539,737.67	317,130,627.69
其中：1. 基金申购款	681,856,194.23	-17,285,674.32	664,570,519.91
2. 基金赎回款	-352,185,828.87	4,745,936.65	-347,439,892.22
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）	1,895,275,936.88	200,159.50	1,895,476,096.38
项目	上年度可比期间 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

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：

<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

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人募集，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： $95\% \times \text{沪深300指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。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： $95\% \times \text{中信标普300指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和

其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，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；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易

日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入

“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面上已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.98% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 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；
- (3) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- (4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- (5) 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，成立不满 3 个月，收益可以不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；
- (6) 投资者可以选择现金分红方式或红利再投资方式，默认方式为现金分红方式，投资者分红方式的变更须在分红权益登记日前向销售机构提出申请；
- (7) 红利分配时所发生的银行转账或其他注册登记费用由投资者自行承担。基金管理人若收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定；
- (8) 法律法规以及中国证监会的其他规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	96,821,825.02	89,129,304.61
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	96,821,825.02	89,129,304.61

注：本基金于本期及上年度均未投资定期存款和其他存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,068,771,400.76	1,801,226,404.29	-267,544,996.47
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	2,068,771,400.76	1,801,226,404.29	-267,544,996.47
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,852,557,179.46	1,372,889,936.71	-479,667,242.75
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	1,852,557,179.46	1,372,889,936.71	-479,667,242.75

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	21,940.26	19,164.85
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	47.63	26.51
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	154.89
其他	-	128.70
合计	21,987.89	19,474.95

注：其他为应收权证保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末其他资产余额均为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	278,847.34	107,568.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	278,847.34	107,568.90

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	7,194.84	2,732.56
预提审计费用	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	100,000.00	-
合计	657,194.84	552,732.56

7.4.7.9 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 12 月 31 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	681,856,194.23	681,856,194.23
本期赎回(以“-”号填列)	-352,185,828.87	-352,185,828.87
本期末	1,895,275,936.88	1,895,275,936.88

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。

7.4.7.10 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	-84,700,344.21	212,122,246.28	127,421,902.07
本期基金份额交易产生的变动数	-246,943,620.12	234,403,882.45	-12,539,737.67
其中：基金申购款	-507,280,386.59	489,994,712.27	-17,285,674.32
基金赎回款	260,336,766.47	-255,590,829.82	4,745,936.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,471,982,039.01	1,472,182,198.51	200,159.50

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	709,958.98
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	8,576.97	5,794.07
其他	10,805.61	10,661.50
合计	729,341.56	750,556.06

注：其他包括申购款利息收入（2012 年度：10,091.91 元；2011 年度：6,570.40 元）以及权证保证金利息收入（2012 年度：713.70 元；2011 年度：4,091.10 元）。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	299,838,721.91	486,269,405.69
减：卖出股票成本总额	393,833,477.38	507,433,598.35
买卖股票差价收入	-93,994,755.47	-21,164,192.66

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,077,130.50	6,769,104.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,897,000.00	6,313,000.00
减：应收利息总额	2,463.29	1,618.36
债券投资收益	177,667.21	454,486.24

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生衍生工具收益/损失。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	29,067,325.60	19,874,528.94
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	29,067,325.60	19,874,528.94

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	212,122,246.28	-428,150,714.06
——股票投资	212,122,246.28	-428,150,714.06
——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	212, 122, 246. 28	-428, 150, 714. 06

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	421, 521. 77	377, 413. 60
转出基金补偿收入	12, 782. 01	24, 356. 80
合计	434, 303. 78	401, 770. 40

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1, 240, 284. 25	1, 417, 534. 34
银行间市场交易费用	-	-
合计	1, 240, 284. 25	1, 417, 534. 34

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
审计费用	50, 000. 00	50, 000. 00
信息披露费	300, 000. 00	300, 000. 00
银行费用	697. 73	624. 79
其他	-	100. 00
债券账户维护费	-	10, 500. 00
合计	350, 697. 73	361, 224. 79

注：其他费用为支付深圳证券账户的变更费。

7.4.7.20 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	384,672,242.31	42.36%	306,850,764.35	33.95%
东方证券	103,237,064.56	11.37%	597,071,269.53	66.05%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	4,077,130.50	100.00%	-	-
------	--------------	---------	---	---

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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	335,158.16	42.42%	205,933.88	73.85%
东方证券	88,300.11	11.18%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	16,216,266.15
其中：支付销售机构的客户维护费	3,382,768.70	3,952,255.01

注：1) 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。

2) 本期末本基金未支付的管理费余额人民币 1,452,629.08 元。(2011 年：人民币 1,243,677.98 元)

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,309,442.05	3,562,220.27

注：1) 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。

2) 本期末本基金未支付的托管费余额人民币 296,454.94 元。(2011 年：人民币 253,811.85 元)

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 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	96,821,825.02	709,958.98	89,129,304.61	734,100.49

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。

7.4.10.6 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均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于 2012 年末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
000002	万科 A	2012 年 12 月 26 日	重大事项	10.12	2013 年 1 月 21 日	11.13	3,373,056	37,596,255.20	34,135,326.72	-
000527	美的电器	2012 年 8 月 25 日	资产重组	9.18	-	-	660,927	7,846,314.88	6,067,309.86	-
600100	同方股份	2012 年 12 月 27 日	重大事项	7.48	2013 年 1 月 10 日	7.90	566,965	5,243,141.24	4,240,898.20	-
601618	中国中冶	2012 年 12 月 28 日	重大事项	2.26	2013 年 1 月 4 日	2.33	1,669,519	7,086,582.34	3,773,112.94	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所正回购交易形成的卖出回购证

券款余额为 0.00 元, 无质押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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股票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。

7.4.13.3 流动性风险

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 7.4.12 期末持有的流通受限股票外, 本基金持有的其他证券在本年度末均能及时变现。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的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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、权证保证金、债券投资、应收申购款及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 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	96,821,825.02	-	-	-	-	-	96,821,825.02
结算备付金	96,234.60	-	-	-	-	-	96,234.60
存出保证金	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,801,226,404.29	1,801,226,404.29
应收利息	-	-	-	-	-	21,987.89	21,987.89
应收申购款	-	-	-	-	-	666,673.95	666,673.95
资产总计	96,918,059.62	-	-	-	-	1,802,415,066.13	1,899,333,125.75
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,171,903.17	1,171,903.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,452,629.08	1,452,629.08
应付托管费	-	-	-	-	-	296,454.94	296,454.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	278,847.34	278,847.34
其他负债	-	-	-	-	-	657,194.84	657,194.84
负债总计	-	-	-	-	-	3,857,029.37	3,857,029.37
利率敏感度缺口	96,918,059.62	-	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2012 年 12 月 31 日及 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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%。于 2012 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	1,801,226,404.29	95.03	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	1,801,226,404.29	95.03	1,372,889,936.71	94.62

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2011年12月31日）
	沪深300指数上升5%	93,663,773.02	67,099,995.66
	沪深300指数下降5%	-93,663,773.02	-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，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。

7.4.14 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。

§ 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	1,801,226,404.29	94.83
	其中：股票	1,801,226,404.29	94.83
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	96,918,059.62	5.10
6	其他各项资产	1,188,661.84	0.06
7	合计	1,899,333,125.75	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末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	10,700,133.15	0.56
B	采掘业	177,465,487.02	9.36
C	制造业	608,383,732.68	32.10
C0	食品、饮料	120,452,827.56	6.35
C1	纺织、服装、皮毛	4,462,069.04	0.24
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	33,812,405.70	1.78
C5	电子	38,621,218.82	2.04
C6	金属、非金属	134,046,337.50	7.07
C7	机械、设备、仪表	193,062,680.44	10.19
C8	医药、生物制品	83,300,899.17	4.39
C99	其他制造业	625,294.45	0.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	41,480,304.01	2.19
E	建筑业	64,061,646.39	3.38
F	交通运输、仓储业	43,170,564.50	2.28
G	信息技术业	41,447,721.15	2.19
H	批发和零售贸易	40,955,053.41	2.16
I	金融、保险业	613,783,617.92	32.38
J	房地产业	108,606,370.19	5.73
K	社会服务业	18,183,121.80	0.96
L	传播与文化产业	6,238,437.38	0.33
M	综合类	26,750,214.69	1.41
	合计	1,801,226,404.29	95.03

8.2.2 期末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所有股票投资明细

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	9,464,331	74,389,641.66	3.92
2	601166	兴业银行	3,287,703	54,871,763.07	2.89
3	601318	中国平安	1,170,582	53,015,658.78	2.80
4	600000	浦发银行	4,826,825	47,882,104.00	2.53
5	601328	交通银行	8,416,036	41,575,217.84	2.19
6	000002	万科A	3,373,056	34,135,326.72	1.80
7	600030	中信证券	2,449,912	32,730,824.32	1.73
8	600519	贵州茅台	154,662	32,327,451.24	1.71
9	600837	海通证券	3,109,522	31,872,600.50	1.68
10	601088	中国神华	1,151,305	29,185,581.75	1.54
11	601169	北京银行	2,871,832	26,708,037.60	1.41
12	601601	中国太保	1,092,114	24,572,565.00	1.30
13	601398	工商银行	5,855,552	24,300,540.80	1.28
14	601288	农业银行	8,592,965	24,060,302.00	1.27
15	000651	格力电器	839,286	21,401,793.00	1.13
16	600104	上汽集团	1,170,329	20,644,603.56	1.09
17	601668	中国建筑	5,265,848	20,536,807.20	1.08
18	600048	保利地产	1,490,685	20,273,316.00	1.07
19	000858	五粮液	708,867	20,011,315.41	1.06
20	600111	包钢稀土	511,817	19,167,546.65	1.01
21	000001	平安银行	1,072,434	17,180,392.68	0.91
22	601939	建设银行	3,673,395	16,897,617.00	0.89
23	600015	华夏银行	1,397,278	14,461,827.30	0.76
24	000157	中联重科	1,559,956	14,367,194.76	0.76
25	601006	大秦铁路	2,061,896	13,938,416.96	0.74
26	601818	光大银行	4,547,892	13,871,070.60	0.73
27	000776	广发证券	879,914	13,568,273.88	0.72
28	600585	海螺水泥	724,177	13,361,065.65	0.70
29	600887	伊利股份	598,868	13,163,118.64	0.69
30	600900	长江电力	1,845,619	12,679,402.53	0.67
31	600256	广汇能源	737,663	12,090,296.57	0.64
32	600031	三一重工	1,081,683	11,455,022.97	0.60
33	601628	中国人寿	528,225	11,304,015.00	0.60
34	600383	金地集团	1,602,945	11,252,673.90	0.59
35	601857	中国石油	1,231,697	11,134,540.88	0.59
36	002304	洋河股份	116,866	10,911,778.42	0.58
37	601899	紫金矿业	2,757,997	10,563,128.51	0.56

38	600050	中国联通	2,946,913	10,314,195.50	0.54
39	600028	中国石化	1,489,822	10,309,568.24	0.54
40	000568	泸州老窖	290,362	10,278,814.80	0.54
41	002024	苏宁电器	1,538,492	10,230,971.80	0.54
42	000069	华侨城 A	1,283,925	9,629,437.50	0.51
43	600795	国电电力	3,575,311	9,403,067.93	0.50
44	600547	山东黄金	242,766	9,263,950.56	0.49
45	600019	宝钢股份	1,848,014	9,036,788.46	0.48
46	000538	云南白药	125,708	8,548,144.00	0.45
47	600489	中金黄金	513,532	8,540,037.16	0.45
48	000338	潍柴动力	334,011	8,453,818.41	0.45
49	000423	东阿阿胶	201,675	8,149,686.75	0.43
50	601688	华泰证券	798,158	7,821,948.40	0.41
51	000983	西山煤电	561,697	7,813,205.27	0.41
52	601988	中国银行	2,665,932	7,784,521.44	0.41
53	600690	青岛海尔	576,097	7,719,699.80	0.41
54	601009	南京银行	829,280	7,629,376.00	0.40
55	600999	招商证券	702,400	7,410,320.00	0.39
56	601788	光大证券	520,737	7,342,391.70	0.39
57	000024	招商地产	242,975	7,262,522.75	0.38
58	601699	潞安环能	331,521	7,256,994.69	0.38
59	600518	康美药业	546,127	7,176,108.78	0.38
60	600739	辽宁成大	476,065	7,136,214.35	0.38
61	000895	双汇发展	122,807	7,110,525.30	0.38
62	601989	中国重工	1,485,947	7,087,967.19	0.37
63	600362	江西铜业	289,731	6,912,981.66	0.36
64	000063	中兴通讯	705,988	6,883,383.00	0.36
65	600276	恒瑞医药	217,213	6,538,111.30	0.34
66	000100	TCL 集团	2,975,417	6,516,163.23	0.34
67	601299	中国北车	1,439,616	6,492,668.16	0.34
68	601186	中国铁建	1,104,794	6,485,140.78	0.34
69	601377	兴业证券	506,531	6,220,200.68	0.33
70	600535	天士力	112,166	6,199,414.82	0.33
71	600089	特变电工	949,172	6,131,651.12	0.32
72	000629	攀钢钒钛	1,485,625	6,120,775.00	0.32
73	000783	长江证券	650,628	6,115,903.20	0.32
74	000792	盐湖股份	227,802	6,105,093.60	0.32
75	601766	中国南车	1,228,443	6,093,077.28	0.32
76	000527	美的电器	660,927	6,067,309.86	0.32

77	600315	上海家化	118,620	6,048,433.80	0.32
78	600348	阳泉煤业	412,311	5,990,878.83	0.32
79	000402	金融街	882,727	5,958,407.25	0.31
80	600309	烟台万华	377,197	5,888,045.17	0.31
81	601117	中国化学	697,365	5,746,287.60	0.30
82	000725	京东方A	2,409,800	5,470,246.00	0.29
83	601168	西部矿业	685,399	5,373,528.16	0.28
84	601600	中国铝业	1,035,265	5,310,909.45	0.28
85	601111	中国国航	883,681	5,302,086.00	0.28
86	601390	中国中铁	1,726,536	5,248,669.44	0.28
87	601669	中国水电	1,357,300	5,184,886.00	0.27
88	601898	中煤能源	642,167	5,021,745.94	0.26
89	000425	徐工机械	428,057	4,935,497.21	0.26
90	600123	兰花科创	242,871	4,927,852.59	0.26
91	600010	包钢股份	908,329	4,904,976.60	0.26
92	000970	中科三环	150,000	4,888,500.00	0.26
93	601998	中信银行	1,137,385	4,879,381.65	0.26
94	600029	南方航空	1,246,758	4,874,823.78	0.26
95	600406	国电南瑞	303,595	4,866,627.85	0.26
96	000630	铜陵有色	254,641	4,812,714.90	0.25
97	002422	科伦药业	85,771	4,804,891.42	0.25
98	000562	宏源证券	254,588	4,798,983.80	0.25
99	002081	金螳螂	107,718	4,741,746.36	0.25
100	600642	申能股份	1,066,583	4,714,296.86	0.25
101	002142	宁波银行	438,778	4,677,373.48	0.25
102	002241	歌尔声学	123,650	4,661,605.00	0.25
103	000625	长安汽车	698,829	4,647,212.85	0.25
104	000060	中金岭南	506,758	4,586,159.90	0.24
105	000581	威孚高科	142,760	4,554,044.00	0.24
106	600150	中国船舶	194,670	4,524,130.80	0.24
107	600660	福耀玻璃	514,240	4,509,884.80	0.24
108	600109	国金证券	250,347	4,466,190.48	0.24
109	600066	宇通客车	177,123	4,463,499.60	0.24
110	002415	海康威视	142,570	4,435,352.70	0.23
111	600741	华域汽车	395,051	4,416,670.18	0.23
112	600674	川投能源	511,806	4,278,698.16	0.23
113	600196	复星医药	405,885	4,257,733.65	0.22
114	000623	吉林敖东	249,548	4,242,316.00	0.22
115	600100	同方股份	566,965	4,240,898.20	0.22

116	600009	上海机场	337,337	4,203,219.02	0.22
117	002236	大华股份	90,000	4,171,500.00	0.22
118	600600	青岛啤酒	123,809	4,093,125.54	0.22
119	600068	葛洲坝	739,799	4,061,496.51	0.21
120	000709	河北钢铁	1,510,510	4,048,166.80	0.21
121	600085	同仁堂	226,405	4,034,537.10	0.21
122	600583	海油工程	679,548	3,988,946.76	0.21
123	000728	国元证券	356,126	3,967,243.64	0.21
124	000878	云南铜业	257,309	3,893,085.17	0.21
125	600549	厦门钨业	98,498	3,839,452.04	0.20
126	601958	金钼股份	324,760	3,802,939.60	0.20
127	600208	新湖中宝	881,558	3,799,514.98	0.20
128	000012	南玻A	460,317	3,797,615.25	0.20
129	600005	武钢股份	1,365,877	3,783,479.29	0.20
130	601618	中国中冶	1,669,519	3,773,112.94	0.20
131	600188	兖州煤业	206,840	3,770,693.20	0.20
132	600809	山西汾酒	90,127	3,754,690.82	0.20
133	600177	雅戈尔	474,183	3,746,045.70	0.20
134	601607	上海医药	336,540	3,738,959.40	0.20
135	601901	方正证券	844,700	3,725,127.00	0.20
136	002155	辰州矿业	184,119	3,697,109.52	0.20
137	600694	大商股份	103,948	3,666,245.96	0.19
138	000999	华润三九	151,974	3,601,783.80	0.19
139	600376	首开股份	273,795	3,592,190.40	0.19
140	601992	金隅股份	438,371	3,550,805.10	0.19
141	600703	三安光电	259,419	3,548,851.92	0.19
142	601666	平煤股份	415,397	3,547,490.38	0.19
143	600143	金发科技	657,329	3,543,003.31	0.19
144	601633	长城汽车	149,299	3,538,386.30	0.19
145	002038	双鹭药业	89,405	3,536,861.80	0.19
146	600153	建发股份	502,114	3,529,861.42	0.19
147	601808	中海油服	213,919	3,508,271.60	0.19
148	000937	冀中能源	252,496	3,492,019.68	0.18
149	600881	亚泰集团	694,664	3,487,213.28	0.18
150	600369	西南证券	388,465	3,468,992.45	0.18
151	600166	福田汽车	514,208	3,460,619.84	0.18
152	600886	国投电力	600,000	3,456,000.00	0.18
153	000768	中航飞机	412,789	3,434,404.48	0.18
154	600875	东方电气	246,387	3,422,315.43	0.18

155	000009	中国宝安	385,443	3,391,898.40	0.18
156	600340	华夏幸福	120,000	3,387,600.00	0.18
157	600062	华润双鹤	147,619	3,350,951.30	0.18
158	600108	亚盛集团	488,443	3,336,065.69	0.18
159	000758	中色股份	157,685	3,216,774.00	0.17
160	600497	驰宏锌锗	226,936	3,211,144.40	0.17
161	600832	东方明珠	574,892	3,196,399.52	0.17
162	002385	大北农	147,256	3,180,729.60	0.17
163	600415	小商品城	476,711	3,165,361.04	0.17
164	002353	杰瑞股份	66,162	3,151,957.68	0.17
165	000960	锡业股份	157,313	3,127,382.44	0.16
166	600655	豫园商城	434,213	3,117,649.34	0.16
167	600271	航天信息	208,550	3,090,711.00	0.16
168	000039	中集集团	266,832	3,076,572.96	0.16
169	601333	广深铁路	1,053,449	3,076,071.08	0.16
170	600395	盘江股份	179,576	3,056,383.52	0.16
171	601717	郑煤机	294,504	3,039,281.28	0.16
172	600649	城投控股	550,680	3,012,219.60	0.16
173	000825	太钢不锈	833,086	3,007,440.46	0.16
174	601158	重庆水务	555,247	2,948,361.57	0.16
175	600115	东方航空	820,684	2,880,600.84	0.15
176	000422	湖北宣化	254,562	2,828,183.82	0.15
177	002146	荣盛发展	202,041	2,826,553.59	0.15
178	601888	中国国旅	102,385	2,807,396.70	0.15
179	600259	广晟有色	47,781	2,794,232.88	0.15
180	600804	鹏博士	468,645	2,793,124.20	0.15
181	600839	四川长虹	1,347,038	2,774,898.28	0.15
182	600219	南山铝业	406,068	2,769,383.76	0.15
183	601106	中国一重	981,156	2,766,859.92	0.15
184	000869	张裕A	58,693	2,758,571.00	0.15
185	600252	中恒集团	297,197	2,713,408.61	0.14
186	000046	泛海建设	502,140	2,711,556.00	0.14
187	601018	宁波港	1,043,600	2,682,052.00	0.14
188	600058	五矿发展	156,203	2,682,005.51	0.14
189	600811	东方集团	493,844	2,681,572.92	0.14
190	002310	东方园林	42,519	2,665,516.11	0.14
191	002202	金风科技	478,107	2,576,996.73	0.14
192	000898	鞍钢股份	659,411	2,558,514.68	0.13
193	000933	神火股份	339,385	2,555,569.05	0.13

194	000401	冀东水泥	183,431	2,531,347.80	0.13
195	600779	水井坊	128,969	2,498,129.53	0.13
196	600893	航空动力	197,438	2,493,641.94	0.13
197	000528	柳工	246,469	2,467,154.69	0.13
198	002092	中泰化学	344,485	2,452,733.20	0.13
199	000800	一汽轿车	290,512	2,417,059.84	0.13
200	000718	苏宁环球	304,110	2,411,592.30	0.13
201	000876	新希望	192,982	2,410,345.18	0.13
202	600125	铁龙物流	334,788	2,407,125.72	0.13
203	002500	山西证券	323,100	2,368,323.00	0.12
204	600027	华电国际	600,000	2,364,000.00	0.12
205	002001	新和成	125,589	2,361,073.20	0.12
206	600157	永泰能源	250,000	2,352,500.00	0.12
207	000729	燕京啤酒	412,450	2,326,218.00	0.12
208	000061	农产品	407,570	2,323,149.00	0.12
209	600266	北京城建	153,957	2,292,419.73	0.12
210	601001	大同煤业	247,845	2,290,087.80	0.12
211	601118	海南橡胶	401,206	2,278,850.08	0.12
212	600267	海正药业	153,022	2,278,497.58	0.12
213	600997	开滦股份	218,564	2,233,724.08	0.12
214	600352	浙江龙盛	366,855	2,226,809.85	0.12
215	600169	太原重工	610,791	2,217,171.33	0.12
216	000778	新兴铸管	339,958	2,196,128.68	0.12
217	600316	洪都航空	158,137	2,169,639.64	0.11
218	002106	莱宝高科	140,699	2,154,101.69	0.11
219	002007	华兰生物	102,071	2,147,573.84	0.11
220	601866	中海集运	878,227	2,142,873.88	0.11
221	600516	方大炭素	236,698	2,101,878.24	0.11
222	600970	中材国际	169,352	2,086,416.64	0.11
223	601101	昊华能源	155,443	2,070,500.76	0.11
224	600971	恒源煤电	159,878	2,059,228.64	0.11
225	000969	安泰科技	194,940	2,058,566.40	0.11
226	600664	哈药股份	332,272	2,053,440.96	0.11
227	600598	北大荒	250,726	2,045,924.16	0.11
228	600118	中国卫星	166,173	2,032,295.79	0.11
229	600859	王府井	84,736	2,030,274.56	0.11
230	600718	东软集团	261,641	2,012,019.29	0.11
231	600895	张江高科	286,560	2,011,651.20	0.11
232	000839	中信国安	333,476	2,007,525.52	0.11

233	601933	永辉超市	78,280	1,973,438.80	0.10
234	002128	露天煤业	145,934	1,958,434.28	0.10
235	601918	国投新集	202,938	1,942,116.66	0.10
236	002570	贝因美	87,600	1,934,208.00	0.10
237	600170	上海建工	247,305	1,931,452.05	0.10
238	600582	天地科技	170,000	1,929,500.00	0.10
239	600216	浙江医药	91,274	1,918,579.48	0.10
240	600498	烽火通信	83,646	1,903,782.96	0.10
241	600588	用友软件	186,741	1,841,266.26	0.10
242	601555	东吴证券	226,195	1,823,131.70	0.10
243	601928	凤凰传媒	265,800	1,802,124.00	0.10
244	600160	巨化股份	191,266	1,767,297.84	0.09
245	601098	中南传媒	197,337	1,764,192.78	0.09
246	600432	吉恩镍业	127,295	1,718,482.50	0.09
247	002073	软控股份	226,736	1,714,124.16	0.09
248	600508	上海能源	105,730	1,701,195.70	0.09
249	600528	中铁二局	253,323	1,692,197.64	0.09
250	600827	友谊股份	197,173	1,691,744.34	0.09
251	600550	天威保变	257,514	1,676,416.14	0.09
252	600331	宏达股份	248,785	1,664,371.65	0.09
253	600221	海南航空	393,214	1,663,295.22	0.09
254	601179	中国西电	470,252	1,636,476.96	0.09
255	002069	獐子岛	103,573	1,634,381.94	0.09
256	000961	中南建设	119,101	1,634,065.72	0.09
257	601336	新华保险	56,500	1,628,330.00	0.09
258	000807	云铝股份	306,349	1,614,459.23	0.09
259	601099	太平洋	294,311	1,609,881.17	0.08
260	000059	辽通化工	233,767	1,591,953.27	0.08
261	601800	中国交建	300,000	1,590,000.00	0.08
262	000686	东北证券	94,883	1,584,546.10	0.08
263	002344	海宁皮城	59,443	1,579,994.94	0.08
264	601369	陕鼓动力	174,814	1,576,822.28	0.08
265	600037	歌华有线	233,018	1,561,220.60	0.08
266	600372	中航电子	97,892	1,551,588.20	0.08
267	600546	山煤国际	74,831	1,522,810.85	0.08
268	002405	四维图新	125,270	1,469,417.10	0.08
269	600132	重庆啤酒	94,931	1,459,089.47	0.08
270	600770	综艺股份	233,259	1,443,873.21	0.08
271	600456	宝钛股份	79,858	1,416,680.92	0.07

272	002299	圣农发展	131,546	1,404,911.28	0.07
273	000559	万向钱潮	305,509	1,371,735.41	0.07
274	000596	古井贡酒	40,000	1,371,200.00	0.07
275	600096	云天化	105,004	1,360,851.84	0.07
276	000780	平庄能源	141,919	1,359,584.02	0.07
277	002375	亚厦股份	50,000	1,324,000.00	0.07
278	601558	华锐风电	234,520	1,233,575.20	0.07
279	000750	国海证券	100,000	1,199,000.00	0.06
280	002122	天马股份	210,494	1,161,926.88	0.06
281	000968	煤气化	93,457	1,153,259.38	0.06
282	600637	百视通	70,000	1,110,900.00	0.06
283	002431	棕榈园林	48,093	1,106,139.00	0.06
284	600022	山东钢铁	477,701	1,046,165.19	0.06
285	601258	庞大集团	192,167	993,503.39	0.05
286	002603	以岭药业	40,119	933,569.13	0.05
287	002378	章源钨业	35,462	863,854.32	0.05
288	600873	梅花集团	159,027	863,516.61	0.05
289	601233	桐昆股份	99,586	716,023.34	0.04
290	002399	海普瑞	38,147	715,256.25	0.04
291	600783	鲁信创投	59,611	658,701.55	0.03
292	002594	比亚迪	30,727	625,294.45	0.03

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所有股票投资明细

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	600016	民生银行	17,719,430.28	1.22
2	601318	中国平安	13,872,266.18	0.96
3	601166	兴业银行	12,181,877.86	0.84
4	601328	交通银行	11,371,767.27	0.78
5	600000	浦发银行	10,953,579.94	0.75
6	600104	上汽集团	10,513,128.40	0.72
7	600519	贵州茅台	9,356,010.35	0.64

8	600030	中信证券	8,764,653.02	0.60
9	600837	海通证券	8,147,141.31	0.56
10	601088	中国神华	8,074,994.42	0.56
11	000002	万 科 A	8,050,116.61	0.55
12	601288	农业银行	7,996,971.00	0.55
13	600999	招商证券	7,691,669.00	0.53
14	000858	五 粮 液	6,859,142.97	0.47
15	000651	格力电器	6,659,353.87	0.46
16	601398	工商银行	6,487,136.27	0.45
17	601601	中国太保	6,388,389.66	0.44
18	000001	平安银行	6,134,589.77	0.42
19	000725	京东方 A	6,011,861.00	0.41
20	601169	北京银行	5,914,759.90	0.41

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	000001	平安银行	14,185,760.56	0.98
2	601318	中国平安	7,176,586.38	0.49
3	600030	中信证券	7,174,708.03	0.49
4	600016	民生银行	6,014,426.54	0.41
5	600015	华夏银行	5,739,717.62	0.40
6	000002	万 科 A	4,816,828.63	0.33
7	601166	兴业银行	4,415,752.86	0.30
8	601088	中国神华	4,326,909.42	0.30
9	600000	浦发银行	4,310,903.10	0.30
10	601991	大唐发电	4,223,405.55	0.29
11	601919	中国远洋	4,149,266.83	0.29
12	600519	贵州茅台	4,145,145.71	0.29
13	601328	交通银行	3,950,034.42	0.27
14	601169	北京银行	3,849,593.92	0.27
15	601601	中国太保	3,848,038.65	0.27
16	601727	上海电气	3,700,819.87	0.26
17	000858	五 粮 液	3,595,236.39	0.25
18	600111	包钢稀土	3,269,863.19	0.23

19	600837	海通证券	3,237,922.72	0.22
20	600048	保利地产	2,803,572.06	0.19

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	610,047,698.68
卖出股票收入（成交）总额	299,838,721.91

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。

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

本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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,987.89
5	应收申购款	666,673.95

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,188,661.84

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科 A	34,135,326.72	1.80	重大事项

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
89,586	21,155.94	338,028,841.04	17.84%	1,557,247,095.84	82.16%

9.2 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	259,653.12	0.0137%

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。

§ 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	1,565,605,571.52
本报告期基金总申购份额	681,856,194.23
减：本报告期基金总赎回份额	352,185,828.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,895,275,936.88

§ 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

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。

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

本基金本报告期投资策略无改变。

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（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务 4 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	
华西证券	1	409,387,935.16	45.08%	357,496.08	45.24%	-
长城证券	2	384,672,242.31	42.36%	335,158.16	42.42%	-
东方证券	1	103,237,064.56	11.37%	88,300.11	11.18%	-
银河证券	1	10,843,863.88	1.19%	9,190.18	1.16%	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增长城证券一个交易单元，截止本报告期末共计五个交易单元。

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
华西证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	4,077,130.50	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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
7	关于东兴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 7 月 13 日
8	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2012 年 7 月 20 日

		基金管理人网站	
9	关于信达证券增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	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 7 月 20 日
10	长城基金管理有限公司关于开通工商银行借记卡基金网上直销业务的公告	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 9 月 10 日
11	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金对账单服务方式的公告	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 9 月 19 日
12	关于深圳众禄基金增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告 0919	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 9 月 19 日
13	关于杭州数米基金销售有限公司增加为代销机构及及实施费率优惠的公告	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 9 月 21 日
14	长城基金管理有限公司关于开展工商银行借记卡网上直销费率优惠的公告	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 11 月 12 日
15	关于广发证券增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	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 11 月 14 日
16	关于诺亚正行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 11 月 16 日
17	关于天天基金增加为代销机构及开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	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 12 月 14 日
18	关于包商银行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 12 月 20 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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

网站：www.ccfund.com.cn