

# 景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年年度报告

2012年12月31日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013年3月28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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 26 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	48

8.9 投资组合报告附注.....	48
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
11.4 基金投资策略的改变.....	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
11.8 其他重大事件.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城中小盘股票
基金主代码	260115
交易代码	260115
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,284,426,880.37 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力的中小型优势企业，充分把握其高成长特性和市值高速扩张所带来的投资机会，追求基金资产的长期资本增值，以超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>资产配置：基金经理依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>股票投资策略：本基金股票投资遵循“自下而上”的个股选择策略，制定相应的投资策略，本基金在对投资标的进行研究筛选时，将从定性及定量两个方面加以考察分析。</p> <p>债券投资策略：债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p>
业绩比较基准	中证 700 指数×80%+中证全债指数×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险收益水平高于债券型基金与混合型基金。本基金主要投资于中小盘股票，在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

## 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		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨焱阳	赵会军
	联系电话	0755-82370388	010-66105799
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	010-66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		赵如冰	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.invescogreatwall.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 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)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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 3 月 22 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-91,129,810.56	-250,430,012.40
本期利润	5,730,811.32	-362,178,520.82
加权平均基金份额本期利润	0.0040	-0.2047
本期加权平均净值利润率	0.51%	-22.38%
本期基金份额净值增长率	0.75%	-20.40%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末

期末可供分配利润	-277,155,438.40	-320,455,296.44
期末可供分配基金份额利润	-0.2158	-0.2044
期末基金资产净值	1,029,702,942.18	1,247,510,078.84
期末基金份额净值	0.802	0.796
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	-19.80%	-20.40%

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、期末可供分配利润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、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

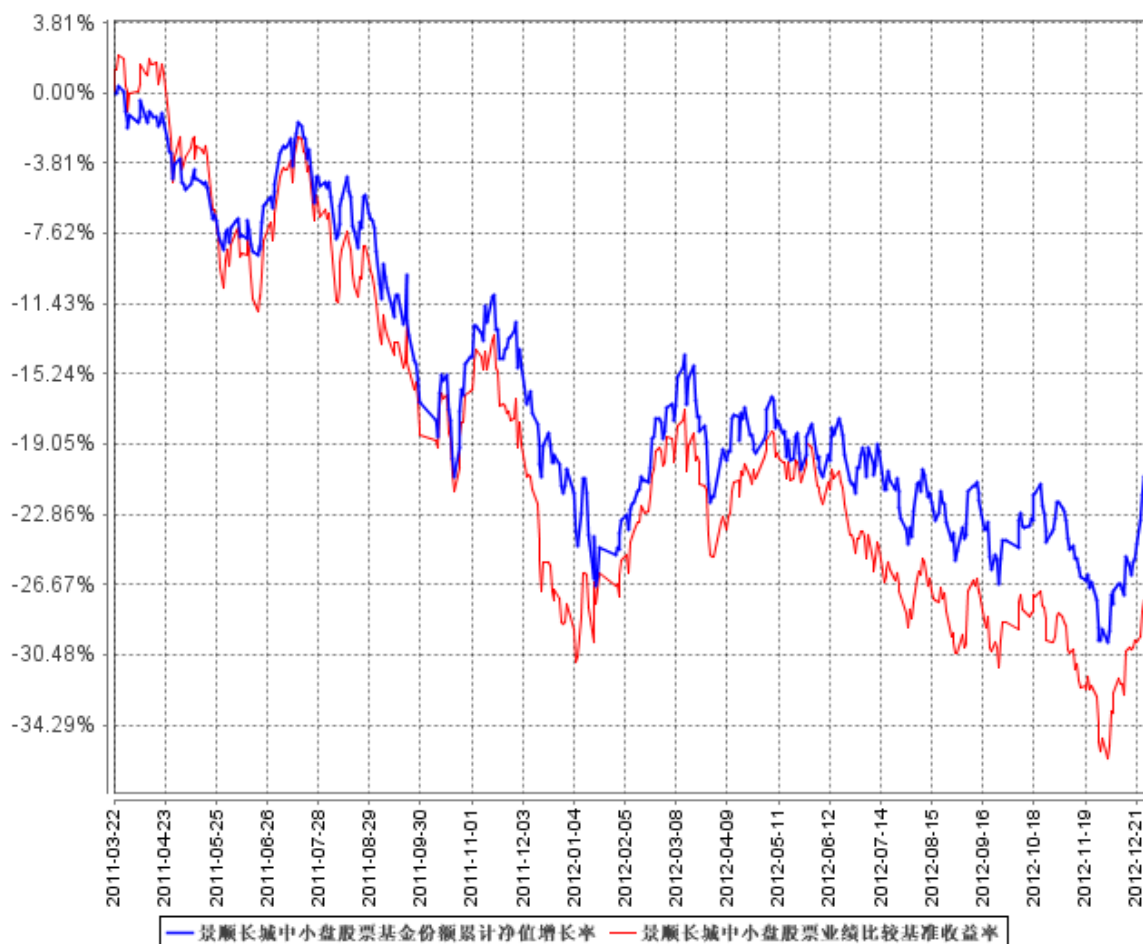
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 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	5.94%	1.03%	3.24%	1.10%	2.70%	-0.07%
过去六个月	0.63%	1.08%	-2.83%	1.12%	3.46%	-0.04%
过去一年	0.75%	1.17%	1.86%	1.19%	-1.11%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-19.80%	1.11%	-26.35%	1.17%	6.55%	-0.06%

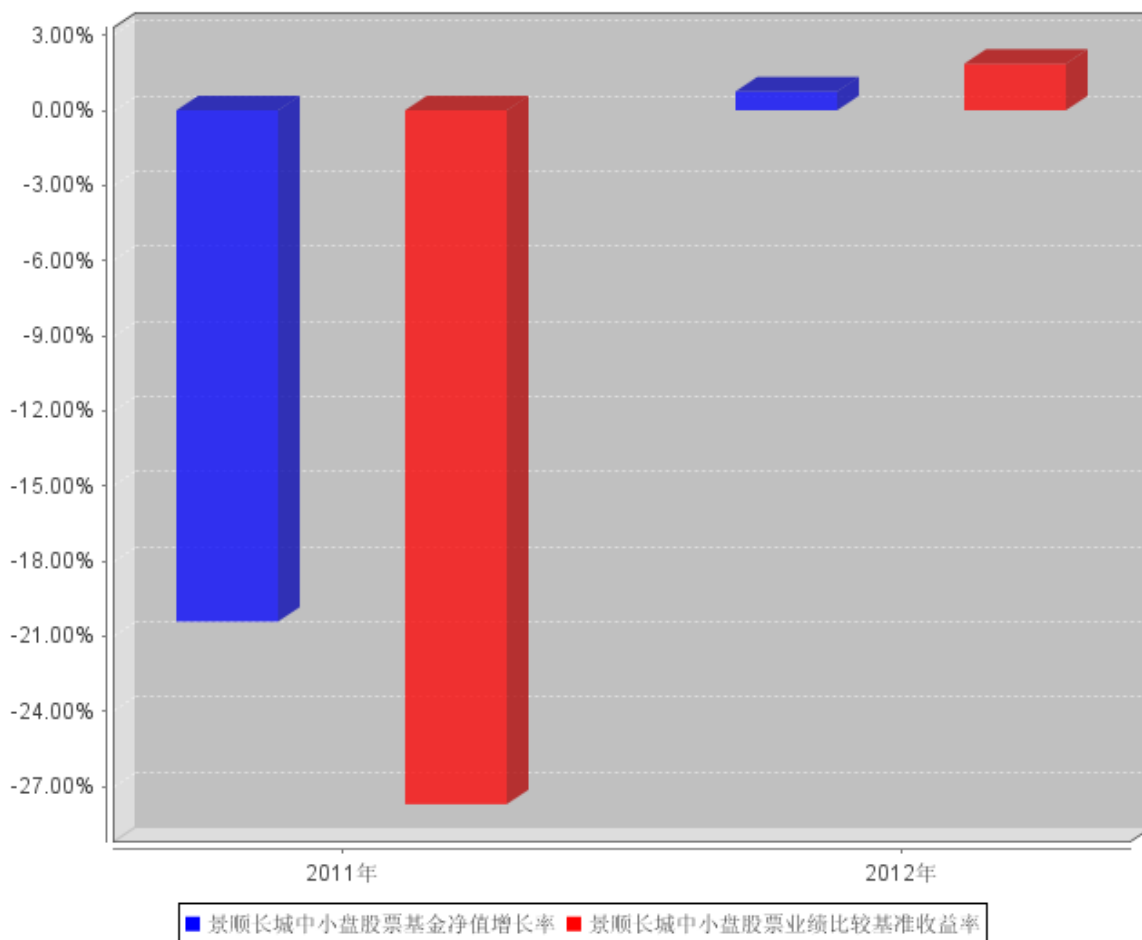
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：本基金的资产配置比例为：基金资产的 60%–95%投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），基金资产的 5%–40%投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%）。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。本基金的建仓期为自 2011 年 3 月 22 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。



### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：2011 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2011 年 3 月 22 日（基金合同生效日）至 2011 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

基金合同生效日（2011 年 3 月 22 日）至本报告期末期间，本基金未进行利润分配。

## § 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券有限责任公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、

1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司。

截止 2012 年 12 月 31 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 19 只开放式基金，包括管理景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金、景顺长城公司治理股票型证券投资基金、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、景顺长城中小盘股票型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华股票型证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金（ETF）、景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选股票证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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		
王鹏辉	本基金基金经理，景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理，景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理，投资总监	2011 年 3 月 22 日	-	11	华中理工大学工学学士、经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员；2007 年 3 月加入本公司。
杨鹏	本基金基金经理，景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理，景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理	2011 年 3 月 22 日	-	8	北京大学经济学学士、上海财经大学经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部，担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务；2008 年 3 月

	理				加入本公司。
--	---	--	--	--	--------

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公  
司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任  
后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运  
作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律  
法规及各项实施准则、《景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规  
定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持  
有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。  
基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 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

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律  
法规关于公平交易的相关规定，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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》等法律法规，本  
公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券  
的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行  
的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异  
常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

#### 1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投  
资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；  
确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和  
投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据  
投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

#### 2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机

制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

### 3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

### 4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现异常交易情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合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% 的交易共有 3 次，均为 ETF 基金因被动跟踪标的指数与其他组合发生的反向交易。

## 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 年的 A 股市场，不愧是龙年的市场，摇头摆尾，年初短暂表现后，即跟随经济数据下滑，年中充分宣泄了投资人不断恶化的悲观情绪，年末又在乐观憧憬的气氛中强劲反弹，实现尾盘逆转，上证指数全年上涨 3.17%。结构上有所分化，大盘股代表中证 100 指数全年上涨 10.77%，而中小盘的代表中证 700 指数仅微涨 0.89%。

具备成长性或低估值的地产、金融、家电、医药等行业领涨，而估值不低又成长乏力的通信、电力设备、计算机、纺织、商贸等行业遭到抛弃。个股方面，在成长显得愈加难能可贵的 2012 年，投资者更趋追捧少数兑现成长的公司，而概念炒作之风则明显收敛，整个市场运作更加理性、成熟。

本基金全年股票仓位稳定，坚持重点配置新兴产业和大消费行业，超配了医药、传媒、旅游等行业，保持了房地产行业的标准配置，下半年兑现了白酒行业投资收益，规避了 4 季度的波动风险。全年本基金维持了对周期品行业的低配。总结 2012 年的配置得失，在白酒、医药、房地产、机械行业精选成长股、控制风险是超额收益的主要来源，而传媒、旅游、汽车等行业则是负贡献的主要来源，缺乏成长的旅游股等尽管具备防御的概念，但相对较高的估值使其并未经受住 2012 年市场的检验，消极防守无法继续作为 A 股市场的求存之道，在新兴产业和大消费行业精选成长股才是积极的防御。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2012 年度，本基金份额净值增长率为 0.75%，低于业绩比较基准收益率 1.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

### 宏观经济

十八大后，新一届领导集体释放了积极的改革信号，投资者对经济增长的悲观预期得以逆转，GDP、PMI、外贸等多项经济数据恰与此印证，展现出年中低、两头高的态势。但我们认为，我们对 2013 年经济数据不宜过于乐观，房价、信贷、环境等问题或成为现实的制约因素，同时正是这些短期看似不利的因素，可以让我们对中长期的增长方式转变更趋乐观，毕竟在 2012 年相对困难的经济环境中，我们看到货币龙头挺住了没松、地产调控挺住了没松，展现了管理层下盘大棋的决心和调结构的鸿鹄之志，或许我们歌唱多年的结构调整、产业升级真的要开始了。

### 证券市场

我们认为 A 股市场尽管经历了年底的强劲反弹，但仍处在相对底部区域，长期来看 A 股已经

能为投资者提供优于其他资产和地区的良好投资价值。

#### 行业走势

展望未来，我们仍然坚信中国经济的转型终将成功，产业结构升级和消费升级的趋势不可逆转，成长型中小市值公司将成为改革红利释放的最大受益者，民营经济的活力必将得到释放，会有一大批中小市值公司成长起来。我们将更加重视自下而上的精选个股，估值与成长性并重，重点关注新兴产业和消费行业，从中发掘良好的投资机会。

#### 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，本基金管理人根据深圳证监局（深证局发【2012】16号）《关于开展深圳辖区基金公司内部控制专项治理活动的通知》要求，开展了公司内部控制专项治理活动。在本次活动中，公司通过自查，全面细致地梳理了业务流程、风险点及内控问题，并对发现的风险点及问题逐一进行整改或制定计划逐步整改。通过本次活动，内控机制得到进一步改善。

除此之外，本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行

评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 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

公司成立基金估值小组对基金财产的估值方法及估值程序作决策，基金估值小组在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值意见及独立第三方机构估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，以求公平对待投资者。

估值小组成员包括公司投资部、交易管理部、基金事务部、法律、监察稽核部、风险控制岗等相关人员。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式或双方认可的其他方式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值小组的运作。对长期停牌股票等没有市价的投资品种，由投资部人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，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小组提出有关估值方法或估值模型的建议。风险控制人员根据投资部提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资部共同确定估值方法并提交估值小组。估值小组共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值小组确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对。法律、监察稽核部相关人员负

责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险，并对有关信息披露文件进行合规性审查。

基金估值小组核心成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉政策法规，并具有丰富的实践经验。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理在需要时出席估值小组会议，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，向估值小组提出估值建议。估值小组将充分考虑基金经理的意见和建议，确定估值方法。

#### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值小组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。

本基金参与估值流程的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

本基金管理人尚未与定价服务机构签署任何协议。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截止本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，报告期内本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

## § 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

2012 年，本基金托管人在对景顺长城中小盘股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

2012 年，景顺长城中小盘股票型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城中小盘股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，景顺长城中小盘股票型证券投资基金未进行利润分配。



### 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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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 60467014_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	景顺长城中小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的景顺长城中小盘股票型证券投资基金的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表、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景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金管理人景顺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、执行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，公允反映了景顺长城中小盘股票型证券投资基金

	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 陈立群
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 26 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中小盘股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	72,805,671.42	65,186,058.66
结算备付金		926,485.75	1,416,759.68
存出保证金		1,173,630.99	1,532,643.11
交易性金融资产	7.4.7.2	957,536,528.16	1,042,815,733.16
其中：股票投资		887,596,528.16	799,170,733.16
基金投资		-	-
债券投资		69,940,000.00	243,645,000.00
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	-	150,000,270.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,062,871.67	1,680,085.56
应收股利		-	-
应收申购款		46,494.05	27,769.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,033,551,682.04	1,262,659,319.24
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	11,193,023.95
应付赎回款		1,246,628.46	780,874.22
应付管理人报酬		1,276,369.73	1,669,380.98
应付托管费		212,728.32	278,230.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	666,157.01	815,288.16
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	446,856.34	412,442.93
负债合计		3,848,739.86	15,149,240.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,284,426,880.37	1,567,965,375.28
未分配利润	7.4.7.10	-254,723,938.19	-320,455,296.44
所有者权益合计		1,029,702,942.18	1,247,510,078.84
负债和所有者权益总计		1,033,551,682.04	1,262,659,319.24

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.802 元，基金份额总额 1,284,426,880.37 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城中小盘股票型证券投资基金

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 3 月 22 日(基 金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		30,130,505.03	-334,312,310.62
1. 利息收入		3,363,683.98	5,730,249.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	751,884.92	2,442,825.14
债券利息收入		2,537,977.64	2,822,915.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		73,821.42	464,509.65
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-70,330,258.95	-229,005,622.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-82,850,786.99	-237,331,783.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	350,620.00	-86,670.00
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	12,169,908.04	8,412,830.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	96,860,621.88	-111,748,508.42
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	236,458.12	711,570.45
<b>减：二、费用</b>		24,399,693.71	27,866,210.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,781,704.60	18,872,404.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,796,950.75	3,145,400.83
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,404,760.27	5,515,555.29
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	416,278.09	332,849.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,730,811.32	-362,178,520.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,730,811.32	-362,178,520.82

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中小盘股票型证券投资基金

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）	1,567,965,375.28	-320,455,296.44	1,247,510,078.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,730,811.32	5,730,811.32
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）	-283,538,494.91	60,000,546.93	-223,537,947.98
其中：1. 基金申购款	56,998,593.98	-13,373,045.49	43,625,548.49
2. 基金赎回款	-340,537,088.89	73,373,592.42	-267,163,496.47
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)	1,284,426,880.37	-254,723,938.19	1,029,702,942.18
项目	上年度可比期间 2011年3月22日(基金合同生效日)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)	2,062,589,600.71	-	2,062,589,600.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-362,178,520.82	-362,178,520.82
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)	-494,624,225.43	41,723,224.38	-452,901,001.05
其中:1.基金申购款	126,308,975.81	-9,963,548.98	116,345,426.83
2.基金赎回款	-620,933,201.24	51,686,773.36	-569,246,427.88
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)	1,567,965,375.28	-320,455,296.44	1,247,510,078.84

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:

许义明	吴建军	邵媛媛
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

景顺长城中小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]41号文《关于核准景顺长城中小盘股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由景顺长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集,基金合同于2011年03月22日生效。首次设立募集规模为2,062,589,600.71份基金份额。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景顺长城基金管理有限公司,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括

在中小板、创业板上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种, 本基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。本基金业绩比较基准为: 中证 700 指数×80%+中证全债指数×20%。

#### 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。

本基金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 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 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

金融资产应当在初始确认时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、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时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；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

#### (2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分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两类。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。

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、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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；

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，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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并确认产生的资产和负债；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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交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；

卖出债券于成交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

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

配股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；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (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）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 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利润的已实现部分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分配利润的未实现部分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；
- (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，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（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 1.5% 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 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购证券支出，按融入资金应收或实际收到金额及实际利率（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) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 其基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- (5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (6) 投资者可在不同销售机构选择不同的分红方式，基金注册登记机构将以投资者在该销售机构最后一次选择的分红方式为准；
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 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需要披露。

### 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[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。

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。

## 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	72,805,671.42	65,186,058.66
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	72,805,671.42	65,186,058.66

注：本基金于本期及上年度可比期间均未投资于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	902,522,564.70	887,596,528.16	-14,926,036.54	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	69,901,850.00	69,940,000.00	38,150.00
	合计	69,901,850.00	69,940,000.00	38,150.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	972,424,414.70	957,536,528.16	-14,887,886.54	
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	911,332,941.58	799,170,733.16	-112,162,208.42	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	243,231,300.00	243,645,000.00	413,700.00

	合计	243,231,300.00	243,645,000.00	413,700.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,154,564,241.58	1,042,815,733.16	-111,748,508.42

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末和上年度末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	-	-
交易所市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	100,000,270.00	-
交易所市场	50,000,000.00	-
合计	150,000,270.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末和上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 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	19,090.38	51,086.45
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	416.90	637.60
应收债券利息	1,043,364.39	1,560,928.96
应收买入返售证券利息	-	67,432.55
应收申购款利息	-	-
其他	-	-

合计	1,062,871.67	1,680,085.56
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末的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	上年度末
	2012年12月31日	2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	665,682.01	813,818.16
银行间市场应付交易费用	475.00	1,470.00
合计	666,157.01	815,288.16

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2012年12月31日	2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	2,356.34	2,942.93
预提费用	194,500.00	159,500.00
合计	446,856.34	412,442.93

#### 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	1,567,965,375.28	1,567,965,375.28
本期申购	56,998,593.98	56,998,593.98
本期赎回(以“-”号填列)	-340,537,088.89	-340,537,088.89
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,284,426,880.37	1,284,426,880.37

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。



**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	-235,949,962.59	-84,505,333.85	-320,455,296.44
本期利润	-91,129,810.56	96,860,621.88	5,730,811.32
本期基金份额交易产生的变动数	49,924,334.75	10,076,212.18	60,000,546.93
其中：基金申购款	-9,620,160.67	-3,752,884.82	-13,373,045.49
基金赎回款	59,544,495.42	13,829,097.00	73,373,592.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-277,155,438.40	22,431,500.21	-254,723,938.19

**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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
活期存款利息收入	730,542.75	2,404,371.80
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	20,543.88	34,090.04
其他	798.29	4,363.30
合计	751,884.92	2,442,825.14

**7.4.7.12 股票投资收益**

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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
卖出股票成交总额	1,440,435,400.18	1,437,370,256.10
减：卖出股票成本总额	1,523,286,187.17	1,674,702,039.56
买卖股票差价收入	-82,850,786.99	-237,331,783.46

**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3月22日(基金合同生效日)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	247,614,010.16	200,114,916.16
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	243,231,300.00	197,384,890.00
减:应收利息总额	4,032,090.16	2,816,696.16
债券投资收益	350,620.00	-86,670.00

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本期及上年度可比期间均无权证投资收益;本基金于本期及上年度可比期间均无权证行权产生的收益/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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,169,908.04	8,412,830.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,169,908.04	8,412,830.93

#### 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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	96,860,621.88	-111,748,508.42
——股票投资	97,236,171.88	-112,162,208.42
——债券投资	-375,550.00	413,700.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	96,860,621.88	-111,748,508.42

#### 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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日

基金赎回费收入	195,872.75	710,560.64
基金转换费收入	40,585.37	1,009.81
合计	236,458.12	711,570.45

#### 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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
交易所市场交易费用	4,402,885.27	5,512,680.29
银行间市场交易费用	1,875.00	2,875.00
合计	4,404,760.27	5,515,555.29

#### 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3月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
审计费用	90,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	225,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	13,500.00
银行费用	8,278.09	13,449.42
其他	-	900.00
合计	416,278.09	332,849.42

#### 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，本基金无需做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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东

注：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3月22日(基金合同生效日)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	11,519,754.50	0.39%	274,908,694.88	6.84%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金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。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	9,359.89	0.37%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年3月22日(基金合同生效日)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	223,364.42	6.72%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费

和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,781,704.60	18,872,404.66
其中：支付销售机构的客户维护费	4,760,199.81	4,891,120.59

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2) 基金管理费于 2012 年末尚未支付的金额为人民币 1,276,369.73 元，于 2011 年末尚未支付的金额为人民币 1,669,380.98 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 3 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,796,950.75	3,145,400.83

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、公休日等, 支付日期顺延。

2) 基金托管费于 2012 年末尚未支付的金额为人民币 212, 728. 32 元, 于 2011 年末尚未支付的金额为人民币 278, 230. 16 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

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

本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未投资本基金。

##### 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

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。

#### 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 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)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
中国工商银行	72, 805, 671. 42	730, 542. 75	65, 186, 058. 66	2, 404, 371. 80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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的证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000826	桑德环境	2012 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 9 日	配股未上市	12. 71	22. 99	377, 036	4, 792, 127. 56	8, 668, 057. 64	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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管理委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四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的发行人出现违约、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，不得超过该证券的 10%。

本基金在证券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。

于本期末，本基金未持有信用类债券。

##### 7.4.13.3 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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。于本期末，除在附注 7.4.12 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国债资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，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。

##### 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、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	72,805,671.42	-	-	-	-	-	72,805,671.42
结算备付金	926,485.75	-	-	-	-	-	926,485.75
存出保证金	-	-	-	-	-	1,173,630.99	1,173,630.99
交易性金融资产	-	-	69,940,000.00	-	-	887,596,528.16	957,536,528.16
应收利息	-	-	-	-	-	1,062,871.67	1,062,871.67
应收申购款	-	-	-	-	-	46,494.05	46,494.05
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	73,732,157.17	-	69,940,000.00	-	-	889,879,524.87	1,033,551,682.04



负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,246,628.46	1,246,628.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,276,369.73	1,276,369.73
应付托管费	-	-	-	-	-	212,728.32	212,728.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	666,157.01	666,157.01
其他负债	-	-	-	-	-	446,856.34	446,856.34
负债总计	-	-	-	-	-	3,848,739.86	3,848,739.86
利率敏感度缺口	73,732,157.17	-	69,940,000.00	-	-	-	-
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	65,186,058.66	-	-	-	-	-	65,186,058.66
结算备付金	1,416,759.68	-	-	-	-	-	1,416,759.68
存出保证金	-	-	-	-	-	1,532,643.11	1,532,643.11
交易性金融资产	-	-	193,280,000.00	50,365,000.00	-	799,170,733.16	1,042,815,733.16
买入返售金融资产	150,000,270.00	-	-	-	-	-	150,000,270.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,680,085.56	1,680,085.56
应收申购款	-	-	-	-	-	27,769.07	27,769.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	216,603,088.34	-	193,280,000.00	50,365,000.00	-	802,411,230.90	1,262,659,319.24
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	11,193,023.95	11,193,023.95
应付赎回款	-	-	-	-	-	780,874.22	780,874.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,669,380.98	1,669,380.98
应付托管费	-	-	-	-	-	278,230.16	278,230.16
应付交易费用	-	-	-	-	-	815,288.16	815,288.16
其他负债	-	-	-	-	-	412,442.93	412,442.93
负债总计	-	-	-	-	-	15,149,240.40	15,149,240.40
利率敏感度缺口	216,603,088.34	-	193,280,000.00	50,365,000.00	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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将对基金净值产生的影响。		
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）
	市场利率上升 25 个基点	-75,724.56	-717,363.14
市场利率下降 25 个基点	75,991.57	721,720.43	

	基点		
--	----	--	--

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，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它价格风险，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。

本基金将基金资产的 60%-95% 投资于股票等权益类资产（其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%），将基金资产的 5%-40% 投资于债券和现金等固定收益类品种（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2012 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 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	887,596,528.16	86.20	799,170,733.16	64.06
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	69,940,000.00	6.79	243,645,000.00	19.53
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	957,536,528.16	92.99	1,042,815,733.16	83.59

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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。		
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	上年度末（2011 年 12 月

		31 日 )	31 日 )
	沪深 300 指数×80%下降 5%	-49,940,592.70	-46,157,872.92
	沪深 300 指数×80%上升 5%	49,940,592.70	46,157,872.92

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 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。

##### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2013 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	887,596,528.16	85.88
	其中：股票	887,596,528.16	85.88
2	固定收益投资	69,940,000.00	6.77
	其中：债券	69,940,000.00	6.77
	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	73,732,157.17	7.13
6	其他各项资产	2,282,996.71	0.22
7	合计	1,033,551,682.04	100.00

### 8.2 期末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	9,663,488.16	0.94

C	制造业	507,457,085.75	49.28
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	8,306,551.75	0.81
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	106,289,120.19	10.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	147,091,773.95	14.28
C8	医药、生物制品	245,769,639.86	23.87
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,813,750.08	1.15
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	23,850,334.20	2.32
H	批发和零售贸易	12,847,528.06	1.25
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	59,208,597.46	5.75
K	社会服务业	136,129,533.03	13.22
L	传播与文化产业	126,626,211.42	12.30
M	综合类	-	-
	合计	887,596,528.16	86.20

### 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

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	300124	汇川技术	2,591,080	62,056,366.00	6.03
2	002422	科伦药业	1,071,153	60,005,991.06	5.83
3	000430	张家界	5,098,056	47,462,901.36	4.61
4	000024	招商地产	1,509,984	45,133,421.76	4.38
5	000423	东阿阿胶	1,116,116	45,102,247.56	4.38
6	300133	华策影视	2,603,008	43,730,534.40	4.25
7	300026	红日药业	1,231,753	41,707,156.58	4.05
8	000887	中鼎股份	4,401,174	40,710,859.50	3.95
9	000826	桑德环境	1,633,823	37,561,590.77	3.65
10	002450	康得新	1,436,007	34,894,970.10	3.39
11	300027	华谊兄弟	2,304,691	32,841,846.75	3.19
12	300132	青松股份	2,417,911	30,683,290.59	2.98

13	600637	百视通	1,828,717	29,021,738.79	2.82
14	601299	中国北车	5,663,680	25,543,196.80	2.48
15	000538	云南白药	355,652	24,184,336.00	2.35
16	000661	长春高新	390,594	23,865,293.40	2.32
17	300182	捷成股份	1,032,482	23,850,334.20	2.32
18	000400	许继电气	871,361	21,479,048.65	2.09
19	600062	华润双鹤	707,358	16,057,026.60	1.56
20	002159	三特索道	1,244,094	15,600,938.76	1.52
21	002566	益盛药业	932,572	14,706,660.44	1.43
22	000069	华侨城 A	1,859,973	13,949,797.50	1.35
23	300251	光线传媒	393,852	13,780,881.48	1.34
24	300171	东富龙	458,944	13,740,783.36	1.33
25	002011	盾安环境	1,444,753	13,205,042.42	1.28
26	002419	天虹商场	1,153,279	12,847,528.06	1.25
27	600674	川投能源	1,413,128	11,813,750.08	1.15
28	600754	锦江股份	788,644	11,167,199.04	1.08
29	000888	峨眉山 A	538,192	10,387,105.60	1.01
30	002038	双鹭药业	259,204	10,254,110.24	1.00
31	002603	以岭药业	424,874	9,886,817.98	0.96
32	002353	杰瑞股份	202,844	9,663,488.16	0.94
33	002293	罗莱家纺	192,059	8,306,551.75	0.81
34	600048	保利地产	569,485	7,744,996.00	0.75
35	601928	凤凰传媒	1,069,500	7,251,210.00	0.70
36	000550	江铃汽车	355,964	6,400,232.72	0.62
37	600383	金地集团	901,735	6,330,179.70	0.61
38	000800	一汽轿车	560,950	4,667,104.00	0.45

## 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	002422	科伦药业	56,860,837.80	4.56
2	600637	百视通	47,424,419.37	3.80
3	300026	红日药业	41,114,717.10	3.30
4	002477	雏鹰农牧	38,858,301.91	3.11
5	002450	康得新	36,315,670.29	2.91

6	000826	桑德环境	35,929,585.93	2.88
7	000783	长江证券	35,264,684.62	2.83
8	002638	勤上光电	35,066,130.57	2.81
9	000024	招商地产	33,125,838.77	2.66
10	000423	东阿阿胶	31,407,574.95	2.52
11	000887	中鼎股份	27,753,806.38	2.22
12	300182	捷成股份	27,388,194.79	2.20
13	002385	大北农	27,332,625.14	2.19
14	300027	华谊兄弟	26,068,524.90	2.09
15	002033	丽江旅游	25,524,097.44	2.05
16	300133	华策影视	25,361,767.99	2.03
17	000538	云南白药	23,984,918.34	1.92
18	000666	经纬纺机	23,891,981.40	1.92
19	600285	羚锐制药	23,320,149.97	1.87
20	600062	华润双鹤	22,643,630.99	1.82

注：买入金额按成交金额（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	000568	泸州老窖	63,599,457.78	5.10
2	600702	沱牌舍得	59,124,442.53	4.74
3	300251	光线传媒	42,883,084.45	3.44
4	600754	锦江股份	39,589,293.83	3.17
5	000783	长江证券	38,602,433.26	3.09
6	002477	雏鹰农牧	37,437,524.76	3.00
7	002638	勤上光电	32,854,630.35	2.63
8	000937	冀中能源	29,456,919.02	2.36
9	600637	百视通	29,127,883.13	2.33
10	002385	大北农	27,960,334.62	2.24
11	000002	万科A	27,555,042.97	2.21
12	000858	五粮液	26,265,483.19	2.11
13	002656	卡奴迪路	24,544,895.21	1.97
14	600285	羚锐制药	24,244,504.04	1.94
15	600048	保利地产	23,900,953.51	1.92
16	601888	中国国旅	23,763,015.27	1.90

17	300027	华谊兄弟	22,325,618.90	1.79
18	300182	捷成股份	21,210,906.00	1.70
19	000666	经纬纺机	20,723,928.52	1.66
20	000423	东阿阿胶	20,463,798.80	1.64

注：卖出金额按成交金额（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	1,514,475,810.29
卖出股票收入（成交）总额	1,440,435,400.18

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均按买卖股票成交金额（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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	69,940,000.00	6.79
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	69,940,000.00	6.79

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1001047	10 央行票据 47	500,000	49,960,000.00	4.85
2	1001055	10 央行票据 55	200,000	19,980,000.00	1.94

#### 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

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

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.9.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	1,173,630.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,062,871.67
5	应收申购款	46,494.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,282,996.71

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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	000826	桑德环境	8,668,057.64	0.84	老股东配股，配股上市日为2013年1月9日



## § 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
23,411	54,864.25	209,356,780.17	16.30%	1,075,070,100.20	83.70%

### 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	49,408.11	0.00%

注：1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年3月22日）基金份额总额	2,062,589,600.71
本报告期期初基金份额总额	1,567,965,375.28
本报告期基金总申购份额	56,998,593.98
减：本报告期基金总赎回份额	340,537,088.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,284,426,880.37

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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、本基金管理人于2012年1月6日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意蔡宝美女士辞去本公司副总经理一职。

2、本基金管理人于 2012 年 4 月 27 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】520 号文核准，聘任邓体顺先生担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2012 年 11 月 13 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，同意 Patrick Song Liu (刘颂) 辞去本公司副总经理一职。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

本报告期内，本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

在本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 2 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 90,000.00 元。

### 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

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

### 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	
华创证券有限责任公司	1	616,081,540.24	21.01%	519,741.92	20.65%	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	500,047,527.36	17.05%	421,928.29	16.76%	未变更
方正证券股份有限公司	1	497,434,187.98	16.96%	426,044.43	16.93%	未变更

安信证券股份 有限公司	1	485,794,114.29	16.56%	415,580.95	16.51%	未变更
海通证券股份 有限公司	1	193,713,575.26	6.61%	165,201.85	6.56%	未变更
国金证券股份 有限公司	1	192,837,135.83	6.58%	174,711.29	6.94%	未变更
民生证券股份 有限公司	1	190,939,834.24	6.51%	172,041.05	6.84%	未变更
兴业证券股份 有限公司	1	181,931,175.86	6.20%	156,553.90	6.22%	未变更
中信证券股份 有限公司	2	42,296,810.91	1.44%	37,223.93	1.48%	未变更
北京高华证券 有限责任公司	1	20,148,426.44	0.69%	18,343.20	0.73%	未变更
长城证券有限 责任公司	1	11,519,754.50	0.39%	9,359.89	0.37%	未变更
招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
申银万国证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国国际金融 有限公司	2	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

#### 1) 选择标准

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

#### 2) 选择程序

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

### 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
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融	-	-	-	-	-	-

有限公司						
------	--	--	--	--	--	--

### 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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2011 年度最后一个市场交易日基金资产净值和份额净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 1 月 3 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 1 月 6 日
3	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2011 年第四季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 1 月 20 日
4	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2011 年年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 3 月 29 日
5	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2011 年年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 3 月 29 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 3 月 29 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国泰君安证券自助式交易系统申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
8	景顺长城中小盘股票型证券投资基金	中国证券报, 上海证	2012 年 4 月 23 日

	基金 2012 年第 1 季度报告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
9	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 4 月 27 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 4 月 27 日
11	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 1 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 5 月 5 日
12	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 5 月 5 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于开通建设银行借记卡直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 2 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于开通通联支付直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 2 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众禄基金申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 5 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增众禄基金为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 5 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于	中国证券报, 上海证	2012 年 6 月 5 日

	旗下部分基金在天相投顾开通基金转换业务的公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加申银万国证券和东方证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 22 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 28 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购与定期定额投资申购费率优惠活动的补充公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 1 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金 2012 年上半年度最后一个市场交易日基金资产净值和份额净值的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 1 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中投证券开通定期定额投资业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 3 日

25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中投证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 3 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增金华银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 12 日
27	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 2 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 17 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 19 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉兴银行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 7 月 23 日
30	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年半年度报告摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 8 月 28 日
31	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年半年度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 8 月 28 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 9 月 28 日
33	关于景顺长城基金管理有限公司	中国证券报, 上海证	2012 年 10 月 11 日



	旗下基金持有的长期停牌股票估值方法变更的提示性公告	券报, 证券时报, 基金管理人网站	
34	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 3 季度报告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 10 月 26 日
35	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 2 号更新招募说明书	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 11 月 6 日
36	景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2012 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 11 月 6 日
37	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 11 月 13 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 11 月 29 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下基金在华泰证券定期定额投资申购金额下限的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 4 日
40	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增数米基金网为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 19 日
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金新增诺亚正行为代销机构并开通基金转换业务及基金“定期定额投资业务”的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 27 日

42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行申购与定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 31 日
43	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 31 日
44	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2013 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城中小盘股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城中小盘股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中小盘股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中小盘股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司  
2013 年 3 月 28 日