

# 景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2013 年半年度报告摘要

2013年6月30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8月26日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经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 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	925, 231, 735. 52 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	杨崑阳	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

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.invescogreatwall.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	116,938,429.20
本期利润	207,506,101.44
加权平均基金份额本期利润	0.1780
本期基金份额净值增长率	19.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1044
期末基金资产净值	885,875,215.49
期末基金份额净值	0.957

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。

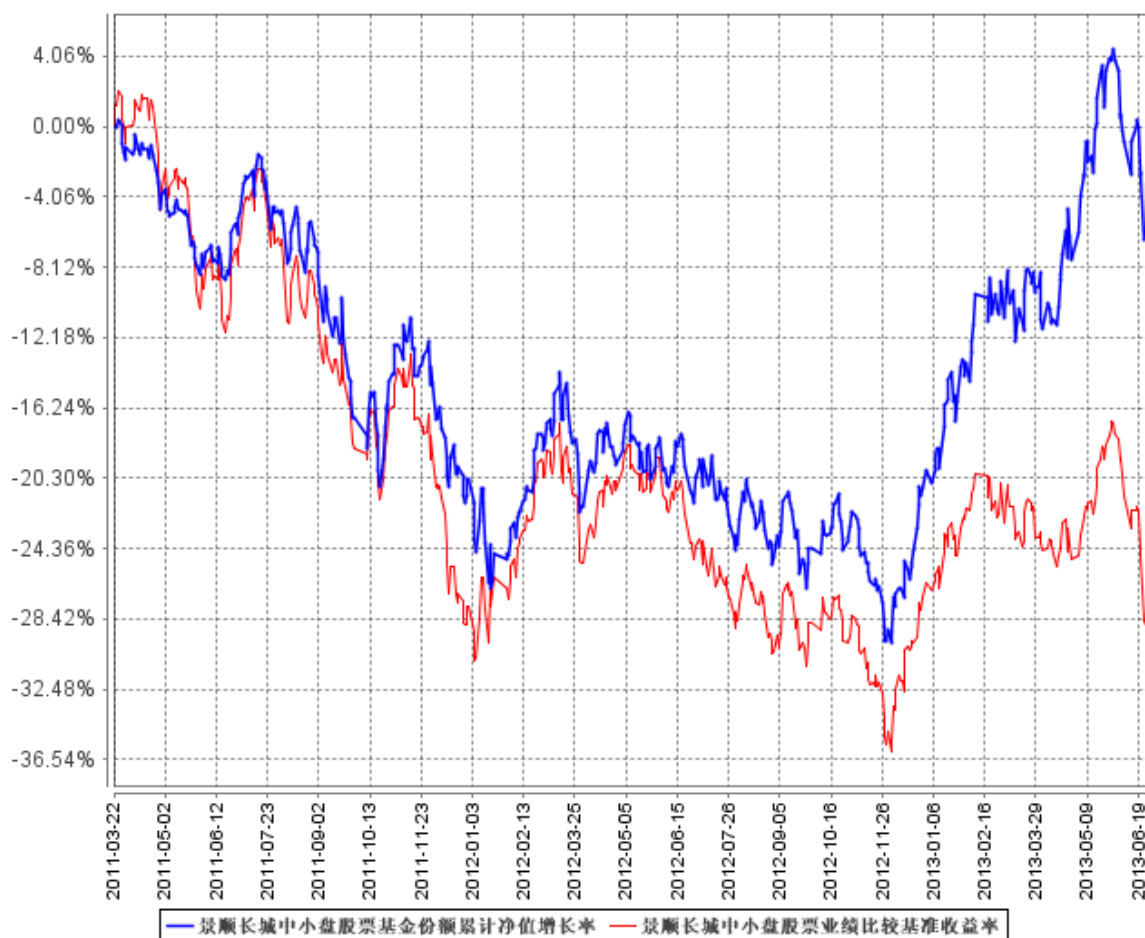
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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
过去一个月	-7.89%	1.67%	-12.61%	1.56%	4.72%	0.11%
过去三个月	5.40%	1.49%	-5.83%	1.21%	11.23%	0.28%
过去六个月	19.33%	1.40%	-2.45%	1.18%	21.78%	0.22%
过去一年	20.08%	1.24%	-5.20%	1.14%	25.28%	0.10%
自基金合同生效起至今	-4.30%	1.18%	-28.15%	1.17%	23.85%	0.01%

### 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。

## § 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 2013 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 21 只开放式基金，包括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、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、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金。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，	2011 年 3 月 22 日	-	12	经济学硕士。曾先

	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，景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，投资总监				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，担任研究员等职务；自2007年9月起担任基金经理。
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	-	9	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月加入本公司，担任研究员等职务；自2010年8月起担任基金经理。

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基金和投资组合。

### 4.3.2 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。

## 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

上半年，新一届政府真正力行治理环境、调整结构的政策，在货币政策上顶住压力不搞刺激，盘活存量，6月末流动性风波更是让市场参与者清晰感受到了管理层转型的决心。A股市场的表现有力的印证了实体经济真实发生的转变，成长股受到追捧，周期股遭到了抛弃，传统低估值行业眼前的高盈利，恰如南辕北辙中的宝马良车——成为转型和改革的标靶，白酒公司业绩变脸一定程度上证明了市场风格转变的基本面的合理性。

国际环境方面，美国经济复苏，美股热点不断，互联网视频、电动车、手机游戏、大数据等主题漂洋过海，给国内本已火爆的转型行情推波助澜。从上世纪末网络股泡沫至今，新兴产业相关公司的基本面走了一条从90年代拼“游客”，到当前拼“常住人口”，未来拼“纳税人口”之路，是从拼想象到拼体验、再到拼盈利的成长之路，然而股市今年上半年的表现则是将这三个阶



段浓缩、倒序演绎，市场表现逐步从已形成盈利模式的优质公司向初具客户基础的公司拓展，并发展到对目前仅有巨大想象空间的公司追捧，无疑，市场风险正在加大。

基于上述判断，本基金继续超配了传媒、医药、环保等行业，取得了较大超额收益，但基于对市场风险加大的评判，二季度后操作渐趋保守，适当降低了股票投资仓位，组合集中于具备确定性和执行力的成长型公司。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年上半年，本基金份额净值增长率为 19.33%，高于业绩比较基准收益率 21.78%。

#### 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

预计随着通胀、劳动力、环境和外贸形势对经济刺激政策的负面弹性增强，依靠刺激政策扶植传统行业的老路已经难以为继，经济转型将是未来多年的主线，只要上下限不突破，中性的流动性政策应是常态。

##### 证券市场

我们认为 A 股市场机会与风险并存，经历了上半年的成长股行情后，A 股中的成长股普遍并不便宜，整体上看风险加剧，但在经济转型的宏观环境中，少数真正具备执行力和竞争优势的中小型企业，能够获得更好的发展空间，考虑其成长性，具备投资价值。

##### 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，风险与成长性并重，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其适用性的情况时，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。

### 4.7 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

本报告期内，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

本报告期内，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 2013 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		48,683,368.03	72,805,671.42
结算备付金		1,485,064.11	926,485.75
存出保证金		355,739.88	1,173,630.99
交易性金融资产		746,585,567.83	957,536,528.16
其中：股票投资		627,139,567.83	887,596,528.16
基金投资		-	-
债券投资		119,446,000.00	69,940,000.00
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		50,000,000.00	-
应收证券清算款		40,009,282.89	-
应收利息		2,166,618.08	1,062,871.67
应收股利		-	-
应收申购款		680,242.55	46,494.05
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		889,965,883.37	1,033,551,682.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,365,629.82	1,246,628.46
应付管理人报酬		1,144,596.28	1,276,369.73
应付托管费		190,766.05	212,728.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		941,174.00	666,157.01
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		448,501.73	446,856.34
负债合计		4,090,667.88	3,848,739.86
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		925,231,735.52	1,284,426,880.37
未分配利润		-39,356,520.03	-254,723,938.19
所有者权益合计		885,875,215.49	1,029,702,942.18
负债和所有者权益总计		889,965,883.37	1,033,551,682.04

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.957 元，基金份额总额 925,231,735.52 份。

## 6.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		219,913,112.92	15,805,275.74

1.利息收入		1,510,527.73	2,093,050.92
其中：存款利息收入		432,696.51	280,076.50
债券利息收入		985,797.26	1,739,153.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		92,033.96	73,821.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		127,785,088.88	19,187,857.19
其中：股票投资收益		123,641,144.20	10,884,000.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		63,750.00	343,445.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,080,194.68	7,960,411.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		90,567,672.24	-5,613,867.30
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		49,824.07	138,234.93
<b>减：二、费用</b>		12,407,011.48	12,175,690.77
1. 管理人报酬		7,926,585.99	8,825,486.87
2. 托管费		1,321,097.71	1,470,914.43
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,948,465.09	1,672,043.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		210,862.69	207,245.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		207,506,101.44	3,629,584.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		207,506,101.44	3,629,584.97

### 6.3 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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,284,426,880.37	-254,723,938.19	1,029,702,942.18

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	207,506,101.44	207,506,101.44
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）	-359,195,144.85	7,861,316.72	-351,333,828.13
其中：1.基金申购款	38,956,225.57	-1,842,242.42	37,113,983.15
2.基金赎回款	-398,151,370.42	9,703,559.14	-388,447,811.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	925,231,735.52	-39,356,520.03	885,875,215.49
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2012年1月1日至2012年6月30日</b>		
<b>项目</b>	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
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）	-	3,629,584.97	3,629,584.97
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）	-170,527,218.48	33,234,689.09	-137,292,529.39
其中：1.基金申购款	11,323,623.75	-2,129,528.36	9,194,095.39
2.基金赎回款	-181,850,842.23	35,364,217.45	-146,486,624.78
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）	1,397,438,156.80	-283,591,022.38	1,113,847,134.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
许义明

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
吴建军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
邵媛媛

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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3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%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

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

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

#### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

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

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

#### 3. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差



别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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个人所得税。

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

## 6.4.7 关联方关系

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

于本报告期，并无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
长城证券	-	-	11,519,754.50	1.00%

### 6.4.8.1.2 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。

### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	9,359.89	0.98%	9,359.89	3.12%

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月 30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,926,585.99
其中：支付销售机构的客户维护费	2,375,305.21	2,505,943.48

注：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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,321,097.71	1,470,914.43

注：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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期和上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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和上年度可比期间均未投资本基金。

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

本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	48,683,368.03	420,915.84	42,472,783.03	269,871.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 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参与关联方承销证券。

#### 6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

**6.4.9.2 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
300027	华谊兄弟	2013年6月5日	筹划重大资产重组	28.55	2013年7月24日	31.41	1,089,957	16,928,961.69	31,118,272.35	-
300133	华策影视	2013年5月28日	筹划重大事项	23.89	2013年7月30日	26.87	1,968,699	18,746,162.74	47,032,219.11	-

**6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.9.3.1 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。

**6.4.9.3.2 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。

**6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****6.4.10.1 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。

**6.4.10.2 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。

**6.4.10.3 财务报表的批准**

本财务报表已于 2013 年 8 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	627,139,567.83	70.47
	其中：股票	627,139,567.83	70.47
2	固定收益投资	119,446,000.00	13.42
	其中：债券	119,446,000.00	13.42
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	5.62
	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	50,168,432.14	5.64
6	其他各项资产	43,211,883.40	4.86
7	合计	889,965,883.37	100.00

## 7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	272,634,994.62	30.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	15,037,319.38	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,556,383.08	13.16
J	金融业	26,697,927.01	3.01
K	房地产业	47,201,877.97	5.33
L	租赁和商务服务业	13,101,264.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	49,609,564.31	5.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	86,300,237.46	9.74
S	综合	-	-
	合计	627,139,567.83	70.79

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600637	百视通	2,427,348	67,965,744.00	7.67
2	300133	华策影视	1,968,699	47,032,219.11	5.31
3	300124	汇川技术	1,063,235	37,202,592.65	4.20
4	300027	华谊兄弟	1,089,957	31,118,272.35	3.51
5	000430	张家界	4,376,085	30,107,464.80	3.40
6	601299	中国北车	7,676,205	28,862,530.80	3.26
7	002422	科伦药业	498,901	26,596,412.31	3.00
8	000887	中鼎股份	4,050,063	25,515,396.90	2.88
9	600867	通化东宝	1,511,482	22,505,966.98	2.54
10	002450	康得新	798,329	22,337,245.42	2.52

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300039	上海凯宝	46,291,534.85	4.50
2	002038	双鹭药业	35,201,447.18	3.42
3	000100	TCL 集团	26,148,177.00	2.54
4	300170	汉得信息	25,884,764.52	2.51
5	002011	盾安环境	24,668,677.02	2.40
6	600583	海油工程	24,193,521.16	2.35
7	300146	汤臣倍健	21,497,724.74	2.09
8	600867	通化东宝	19,064,170.47	1.85
9	600637	百视通	18,783,307.93	1.82
10	002400	省广股份	17,596,589.62	1.71
11	000024	招商地产	16,740,280.36	1.63
12	300072	三聚环保	16,455,321.42	1.60

13	000002	万 科A	16,369,277.48	1.59
14	000671	阳 光 城	16,357,199.89	1.59
15	600699	均胜电子	13,875,577.76	1.35
16	600458	时代新材	13,435,934.54	1.30
17	600804	鹏博士	13,429,656.09	1.30
18	300332	天壕节能	12,100,200.06	1.18
19	300334	津膜科技	11,471,361.56	1.11
20	600104	上汽集团	11,306,714.20	1.10

注：买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	000423	东阿阿胶	50,480,636.31	4.90
2	300124	汇川技术	46,947,383.66	4.56
3	000826	桑德环境	42,101,855.78	4.09
4	300026	红日药业	40,969,861.71	3.98
5	300039	上海凯宝	40,077,315.83	3.89
6	000024	招商地产	39,569,758.72	3.84
7	002422	科伦药业	39,256,024.82	3.81
8	002011	盾安环境	36,447,653.05	3.54
9	002450	康得新	35,815,323.07	3.48
10	300027	华谊兄弟	35,142,883.14	3.41
11	300133	华策影视	32,730,026.03	3.18
12	002038	双鹭药业	31,292,715.61	3.04
13	300132	青松股份	30,976,017.16	3.01
14	000661	长春高新	29,912,793.15	2.90
15	000887	中鼎股份	29,142,313.64	2.83
16	000538	云南白药	28,871,952.04	2.80
17	600583	海油工程	26,003,344.27	2.53
18	300146	汤臣倍健	23,352,239.25	2.27
19	000400	许继电气	21,854,938.79	2.12
20	000100	TCL 集团	19,034,176.49	1.85

注：卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	655,354,373.69
卖出股票收入（成交）总额	1,130,391,500.46

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	19,996,000.00	2.26
3	金融债券	99,450,000.00	11.23
	其中：政策性金融债	99,450,000.00	11.23
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	119,446,000.00	13.48

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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	130201	13 国开 01	1,000,000	99,450,000.00	11.23
2	1001055	10 央行票据 55	200,000	19,996,000.00	2.26

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。



## 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略：

时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1

1、2011 年，四川科伦药业股份有限公司（下称“科伦药业”，股票代码：002422）使用 4.26 亿元超募资金收购了崇州君健塑胶有限公司（下称“君健塑胶”）100%股权。君健塑胶实际出资人是四川惠丰投资发展有限责任公司（下称“惠丰投资”），惠丰投资的实际出资人主要是科伦药业和四川科伦实业集团有限公司（为公司实际控制人刘革新控制的企业）员工。科伦药业在 2010 年年报及 2011 年年报披露惠丰投资为公司关联方，该公司在上述收购事项中，未真实、准确、完整披露交易对方的情况及交易双方之间的关联关系，违反了《上市公司信息披露管理办法》的规定，于 2013 年 5 月 3 日收到中国证券监督管理委员会四川监管局下发的《关于对科伦药业采取责令改正措施的决定》，并于 2013 年 5 月 20 日收到中国证券监督管理委员会的《调查通知书》。

本基金投研人员分析认为，该事件确实反映了科伦药业治理方面发生的问题，但对科伦药业目前的生产经营尚不构成实质性影响，也不会对科伦药业的价值判断发生重大影响。君健塑胶 2011 年净利润 11502 万元，超过了 2011 年 3 月 15 日收购公告中预计的当年约 1 亿元净利润的预期，2012 年君健塑胶净利润 23861 万，进一步提升了上市公司的盈利能力，说明该收购符合上市公司股东利益。科伦药业于 2013 年 5 月 30 日召开 2013 年第二次临时股东大会，就收购君健塑胶 100%股权事项按照关联交易的决策程序重新履行审议程序，该议案在关联股东回避表决的情况下，以占出席本次股东大会（含网络投票）有效表决权股份总数的 92.5101%的同意率获得通过，从法律程序上进行了弥补。

我们认为，科伦药业进行的一系列整改措施有利于完善公司治理和促进公司长期健康发展。考虑到其业绩增长较快，估值合理，维持“持有”评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对科伦药业进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内

受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.10.2

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。

### 7.10.3 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	355,739.88
2	应收证券清算款	40,009,282.89
3	应收股利	-
4	应收利息	2,166,618.08
5	应收申购款	680,242.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,211,883.40

### 7.10.4 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。

### 7.10.5 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	300133	华策影视	47,032,219.11	5.31	筹划重大事项，于 2013 年 7 月 30 日复牌
2	300027	华谊兄弟	31,118,272.35	3.51	筹划重大资产重组，于 2013 年 7 月 24 日复牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
18,300	50,559.11	141,425,659.60	15.29%	783,806,075.92	84.71%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,408.11	0.01%

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。

## § 9 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	1,284,426,880.37
本报告期基金总申购份额	38,956,225.57
减：本报告期基金总赎回份额	398,151,370.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	925,231,735.52

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人于2013年5月7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，聘任 Xie Sheng（谢生）先生担任本公司副总经理。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。

2、本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

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。

**10.4 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。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券有限责任公司	1	383,266,353.40	21.49%	341,748.23	21.23%	未变更
兴业证券股份有限公司	1	257,704,284.67	14.45%	231,219.29	14.36%	未变更
中信证券股份有限公司	2	248,454,409.02	13.93%	226,192.65	14.05%	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	240,547,656.92	13.49%	218,359.96	13.56%	未变更
招商证券股份有限公司	1	234,431,298.68	13.15%	211,373.76	13.13%	未变更
安信证券股份有限公司	1	173,048,419.41	9.70%	157,193.89	9.76%	未变更
北京高华证券有限责任公司	1	141,604,924.01	7.94%	128,917.71	8.01%	未变更
申银万国证券股份有限公司	1	32,848,025.30	1.84%	29,904.68	1.86%	未变更
民生证券股份	1	32,430,407.96	1.82%	29,524.78	1.83%	未变更

有限公司						
国金证券股份 有限公司	1	18,968,791.66	1.06%	17,269.46	1.07%	未变更
国泰君安证券 股份有限公司	1	14,681,629.16	0.82%	13,365.87	0.83%	未变更
中国银河证券 股份有限公司	1	5,303,945.96	0.30%	4,828.43	0.30%	未变更
中信建投证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	未变更
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变更
海通证券股份 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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

华创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	170,000,000.00	100.00%	-	-
申银万国证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 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	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-

景顺长城基金管理有限公司  
2013 年 8 月 26 日