

# 长城优化升级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：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 08 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 01 月 01 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	长城优化升级股票
基金主代码	200015
交易代码	200015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 20 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,813,107.71 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在合理的资产配置基础上，积极寻找受益于我国经济结构优化升级而实现成长的企业投资价值，力争实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金为股票型证券投资基金，将依据市场情况进行基金的大类资产配置。本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中债综合财富指数收益率。
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于指数型基金，高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金产品。

### 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	长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

## 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.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## § 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	5,577,632.44
本期利润	1,072,721.59
加权平均基金份额本期利润	0.0181
本期基金份额净值增长率	5.76%
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	0.0228
期末基金资产净值	63,224,837.23
期末基金份额净值	1.023

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-5.45%	2.28%	-12.66%	1.50%	7.21%	0.78%
过去三个月	4.92%	2.05%	-9.30%	1.16%	14.22%	0.89%
过去六个月	5.76%	1.71%	-9.76%	1.20%	15.52%	0.51%
过去一年	12.21%	1.37%	-7.71%	1.09%	19.92%	0.28%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	14.23%	1.25%	-11.14%	1.06%	25.37%	0.19%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D1 到 Dn 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的收益率= (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

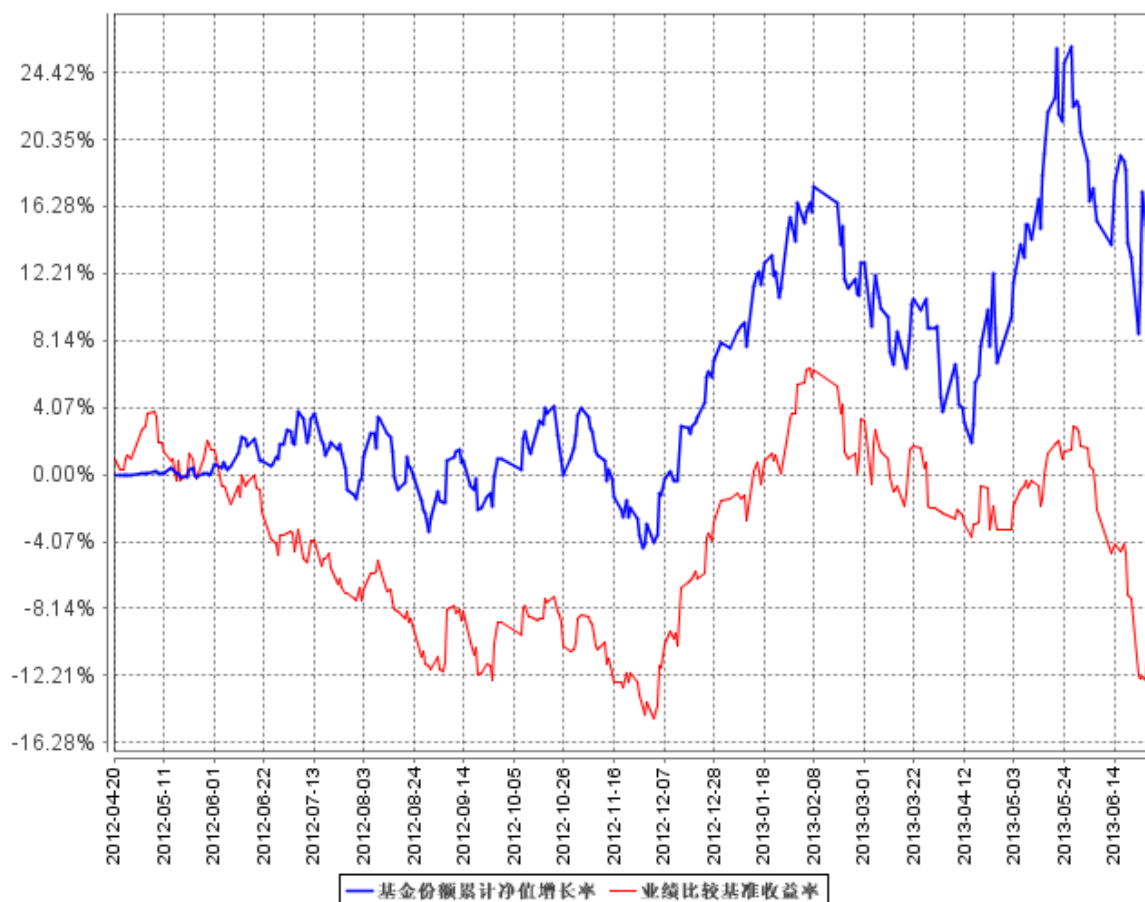
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

长城优化业绩比较基准每日收益率= 80%×沪深 300 指数日收益率+20%×中债综合财富指数日收益率

指数收益率以当日收盘价相对于上一个交易日收盘价计算而成。

### 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为：本基金股票投资占基金资产净值的比例范围为 60%-95%，其中，以不低于 80% 的股票资产投资于优化升级企业；债券投资占基金资产净值的比例范围为 0-35%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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、长城岁岁金理财债券型证券投资基金和长城久利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		
刘颖芳	本基金的基金经理、长城消费基金的基金经理	2012 年 4 月 20 日	-	9 年	女，中国籍。特许金融分析师（CFA），湘潭大学工学学士、清华大学 MBA。曾就职于西风信息科技产业集团、德维森实业（深圳）有限公司。2004 年进入长城基金管理有限公司，任长城基金管理有限公司研究部行业研究员。

于雷	长城优化升级股票基金、长城保本基金、长城中小盘股票基金和长城久利保本基金的基金经理	2013年3月8日	-	5年	男，中国籍。中国人民大学财政金融学院经济学学士、硕士，香港大学金融学博士，特许金融分析师（CFA）。曾就职于华夏基金管理有限公司。2008年进入长城基金管理有限公司，曾任宏观、策略研究员、投资决策委员会秘书、“长城优化升级股票型证券投资基金”基金经理助理。
----	---	-----------	---	----	--

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》、《长城优化升级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，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。



## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年上半年，A 股市场先涨后跌。年初经历了春季躁动，周期板块的估值修复引领大盘上涨。而二季度成长发力，在经济复苏受阻、流动性边际收缩的背景下，大盘回落，但是以创业板为代表的成长股连创新高。二季度末，在银行间阶段性的流动性危机影响下，市场暴跌，上证综指跌破前期低点。

在经济弱复苏的背景下，优化升级基金一季度主要持有医药和周期股。进入二季度，经济增长开始放缓，流动性也开始收缩，在这种背景下，优化升级基金减持了周期股，逐步加仓成长股。在结构转型的背景下，经济增长中枢下移，而新一届政府对金融风险的重视，也使得流动性边际收缩。在这种背景下，我们看好成长股全年的表现。优化升级基金目前主要配置了 TMT 为代表的成长，包括消费电子、通信、传媒等，以及消费类行业如医药和家电等。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年上半年长城优化升级股票基金份额净值增长率为 5.76%，与同类基金相比表现一般。一季度基金份额的频繁波动给我们的操作造成了很大影响，而二季度规模稳定的前提下，成长股的表现为我们赢回了一些收益。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2013 年下半年左右 A 股走势的核心问题有：美联储的货币政策、国际汇率及国债

收益率；国内货币政策导向及银行间流动性演绎；地产调控，地产、基建投资及经济下行风险；城镇化政策以及三中全会；中报、IPO。短期而言，静态来看，经济难言乐观，资金中性偏紧，政策欲拒还迎，IPO 箭在弦上，中报大考在即。动态来看，经济数据一再低于预期；IPO 时间表逐步清晰；外部内部、天灾人祸，资金最紧张时刻已经过去；市场放量暴跌且创出新低，金融大盘股领跌；银行普遍低于 1 倍 PB，地产估值创出 08 年以来新低；政策维稳导向出现。因此，短期而言，股票市场的大幅下跌已经部分反应了市场悲观预期，市场最黑暗时刻似已过去，但是依然需要消化和催化。下半年市场有望出现反弹，但绝对空间有限，非反转的趋势性行情。

依然看好成长股，尤其是以 TMT 为代表的中小板和创业板。中报是分化的界限。有业绩支撑、符合甚至超预期的个股会受到极度热捧；而略差于预期，但是下半年存在反转或者显著改善的个股下跌既是加仓时机；回避业绩显著低于预期的个股。我们将时刻关注经济增长状况及市场预期，以及流动性的变动情况，通过精选行业和个股来为基金持有人贡献收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

基金估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金

估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

#### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

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

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城优化升级股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定，. 本基金的每份基金份额享有同等分配权；. 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 10%；

本基金于 2013 年 3 月 4 日对本基金收益进行了收益分配。分配金额为 6,647,298.75 元，符合基金合同的规定。

截止本报告期末，本基金可供分配利润为 1,411,729.52 元，期末可供分配基金份额利润为 0.0228 元。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为：6647298.75 元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城优化升级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	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	8,709,164.80	23,830,494.99
结算备付金	369,787.88	77,366.92
存出保证金	55,369.50	-
交易性金融资产	58,073,054.96	51,902,975.75
其中：股票投资	58,073,054.96	51,902,975.75
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,347.97	4,805.41
应收股利	18,472.37	-
应收申购款	1,864,942.17	2,463.08

递延所得税资产	-	-
其他资产	35,287.82	-
资产总计	69,127,427.47	75,818,106.15
<b>负债和所有者权益</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	5,516,182.48	-
应付赎回款	35,646.69	2,120,950.37
应付管理人报酬	69,877.15	78,214.80
应付托管费	11,646.21	13,035.80
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	179,843.22	42,743.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	1,387,115.19
递延所得税负债	-	-
其他负债	89,394.49	112,993.51
负债合计	5,902,590.24	3,755,053.04
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	61,813,107.71	69,355,764.69
未分配利润	1,411,729.52	2,707,288.42
所有者权益合计	63,224,837.23	72,063,053.11
负债和所有者权益总计	69,127,427.47	75,818,106.15

注：截至 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.023 元，基金份额总额 61,813,107.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城优化升级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	上年度可比期间 2012年4月20日至2012 年6月30日
<b>一、收入</b>	2,299,214.27	4,032,479.15
1.利息收入	48,744.71	961,776.85
其中：存款利息收入	48,744.71	199,148.55
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	762,628.30

其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,599,358.76	68,555.01
其中：股票投资收益	6,291,108.79	-210,335.74
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	308,249.97	278,890.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,504,910.85	2,449,565.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	156,021.65	552,581.94
<b>减：二、费用</b>	<b>1,226,492.68</b>	<b>1,043,170.12</b>
1. 管理人报酬	453,825.56	776,836.64
2. 托管费	75,637.63	129,472.78
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	571,489.19	68,545.30
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	125,540.30	68,315.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>1,072,721.59</b>	<b>2,989,309.03</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>1,072,721.59</b>	<b>2,989,309.03</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城优化升级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）	69,355,764.69	2,707,288.42	72,063,053.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,072,721.59	1,072,721.59
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	-7,542,656.98	4,279,018.26	-3,263,638.72

列)			
其中：1.基金申购款	113,878,035.01	8,963,907.04	122,841,942.05
2.基金赎回款	-121,420,691.99	-4,684,888.78	-126,105,580.77
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）	-	-6,647,298.75	-6,647,298.75
五、期末所有者权益（基金净值）	61,813,107.71	1,411,729.52	63,224,837.23
项目	上年度可比期间 2012年4月20日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	523,254,064.01	-	523,254,064.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	2,989,309.03	2,989,309.03
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）	-422,068,228.31	-1,165,334.39	-423,233,562.70
其中：1.基金申购款	5,408,364.43	23,123.16	5,431,487.59
2.基金赎回款	-427,476,592.74	-1,188,457.55	-428,665,050.29
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）	101,185,835.70	1,823,974.64	103,009,810.34

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：

\_\_\_\_\_  
杨光裕

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
熊科金

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
彭洪波

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城优化升级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】1538号文“关于核准长城优化升级股票型证券投资

基金募集的批复”的核准，由长城基金管理有限公司作为发起人于 2012 年 3 月 19 日至 2012 年 4 月 18 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2012）验字第 60737541\_H02 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012 年 4 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 523,177,240.58 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 76,823.43 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 523,254,064.01 元，折合 523,254,064.01 份基金份额。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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金股票投资占基金资产净值的比例范围为 60%-95%，其中，以不低于 80%的股票资产投资于优化升级企业；债券投资占基金资产净值的比例范围为 0-35%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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。

#### 6.4.3 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 2013 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2013 年 01 月 01 日至 2013 年 06 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。



### 6.4.5 差错更正的说明

本基金于 2013 年上半年度未发生会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

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

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

#### 2. 营业税、企业所得税

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

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

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

#### 3. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、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，个人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

于本期，并无对本基金存在控制关系或重大影响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
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
中国建设银行	基金托管人、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

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联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

注：本基金本期及本期末未有应支付关联方的佣金。

## 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4月20日(基金合同生效日) 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	453,825.56	776,836.64
其中：支付销售机构的客户维护费	149,280.93	318,475.56

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

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4月20日(基金合同生效日) 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75,637.63	129,472.78

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 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

注：本基金于本期与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

份额单位：份

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 4 月 20 日至 2012 年 6 月 30 日
基金合同生效日( 2012 年 4 月 20 日 ) 持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	2,674,798.06	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	2,674,798.06	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.33%	-

#### 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

份额单位: 份

关联方名称	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
东方证券	-	-	9,999,000.00	9.88%

注: 除基金管理人之外的其他关联方于本期末未持有本基金份额。上年度末除基金管理人之外的其他关联方持有本基金份额的交易费用, 按基金合同及招募说明书的有关规定计算并支付。

#### 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2012 年 4 月 20 日(基金合同生效日)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
中国建设银行	8,709,164.80	45,809.15	50,725,417.28	192,036.10

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 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

注: 本基金于本期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 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

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。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

### 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 2013 年 06 月 30 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。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	58,073,054.96	84.01
	其中：股票	58,073,054.96	84.01
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	9,078,952.68	13.13
6	其他各项资产	1,975,419.83	2.86
7	合计	69,127,427.47	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	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,676,487.36	70.66
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,000,967.60	12.65
J	金融业	833,600.00	1.32
K	房地产业	4,562,000.00	7.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	58,073,054.96	91.85

### 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	600498	烽火通信	180,899	2,981,215.52	4.72
2	000063	中兴通讯	228,000	2,907,000.00	4.60
3	002241	歌尔声学	79,123	2,871,373.67	4.54
4	300083	劲胜股份	166,961	2,831,658.56	4.48
5	002313	日海通讯	169,338	2,792,383.62	4.42
6	300088	长信科技	124,995	2,636,144.55	4.17
7	000049	德赛电池	33,940	2,036,400.00	3.22

8	600519	贵州茅台	10,500	2,019,885.00	3.19
9	300346	南大光电	43,991	1,845,862.36	2.92
10	002415	海康威视	52,000	1,837,680.00	2.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）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	000063	中兴通讯	6,794,202.44	9.43
2	000513	丽珠集团	6,137,328.46	8.52
3	600498	烽火通信	5,567,377.46	7.73
4	002241	歌尔声学	4,688,508.51	6.51
5	600594	益佰制药	4,623,790.32	6.42
6	002313	日海通讯	4,611,825.72	6.40
7	300083	劲胜股份	3,379,165.78	4.69
8	600079	人福医药	3,363,829.00	4.67
9	000049	德赛电池	3,343,813.35	4.64
10	300088	长信科技	3,267,992.04	4.53
11	002106	莱宝高科	3,175,041.70	4.41
12	000568	泸州老窖	3,123,215.16	4.33
13	002335	科华恒盛	2,961,598.80	4.11
14	600261	阳光照明	2,961,477.00	4.11
15	000725	京东方 A	2,899,000.00	4.02
16	300026	红日药业	2,810,843.24	3.90
17	601006	大秦铁路	2,745,406.64	3.81
18	300134	大富科技	2,729,143.57	3.79
19	600585	海螺水泥	2,707,075.79	3.76
20	000625	长安汽车	2,559,475.90	3.55
21	300115	长盈精密	2,514,909.04	3.49
22	600252	中恒集团	2,444,250.52	3.39
23	002055	得润电子	2,437,160.91	3.38
24	600728	佳都新太	2,396,839.17	3.33

25	002475	立讯精密	2,286,263.90	3.17
26	002005	德豪润达	2,286,085.00	3.17
27	300346	南大光电	2,279,975.15	3.16
28	300047	天源迪科	2,239,013.30	3.11
29	601231	环旭电子	2,216,469.04	3.08
30	300136	信维通信	2,192,079.00	3.04
31	002415	海康威视	2,169,497.49	3.01
32	600519	贵州茅台	2,048,669.75	2.84
33	000789	江西水泥	2,020,514.99	2.80
34	000963	华东医药	1,985,401.00	2.76
35	002294	信立泰	1,971,538.67	2.74
36	600703	三安光电	1,945,332.15	2.70
37	002236	大华股份	1,915,544.52	2.66
38	600741	华域汽车	1,863,140.08	2.59
39	002273	水晶光电	1,832,468.38	2.54
40	601333	广深铁路	1,818,552.71	2.52
41	600335	国机汽车	1,741,872.84	2.42
42	600720	祁连山	1,703,938.41	2.36
43	000050	深天马 A	1,690,765.05	2.35
44	601818	光大银行	1,671,725.31	2.32
45	000733	振华科技	1,621,015.86	2.25
46	300310	宜通世纪	1,616,299.98	2.24
47	601788	光大证券	1,575,200.00	2.19
48	600690	青岛海尔	1,561,305.00	2.17
49	601766	中国南车	1,527,770.05	2.12
50	002491	通鼎光电	1,517,728.40	2.11
51	601169	北京银行	1,513,399.66	2.10
52	300299	富春通信	1,465,361.71	2.03

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	000513	丽珠集团	7,466,653.62	10.36
2	600594	益佰制药	6,736,790.51	9.35



3	000568	泸州老窖	5,953,489.55	8.26
4	300026	红日药业	4,670,677.89	6.48
5	002294	信立泰	4,580,209.74	6.36
6	000063	中兴通讯	4,275,448.02	5.93
7	601169	北京银行	4,044,517.11	5.61
8	000963	华东医药	3,692,740.65	5.12
9	600079	人福医药	3,338,602.51	4.63
10	600498	烽火通信	3,329,620.42	4.62
11	601818	光大银行	3,321,578.82	4.61
12	300115	长盈精密	3,236,394.12	4.49
13	002106	莱宝高科	3,184,442.07	4.42
14	601766	中国南车	3,004,521.00	4.17
15	000999	华润三九	2,651,130.88	3.68
16	601299	中国北车	2,628,485.10	3.65
17	000625	长安汽车	2,588,578.65	3.59
18	601998	中信银行	2,565,500.00	3.56
19	601006	大秦铁路	2,559,573.87	3.55
20	601231	环旭电子	2,469,328.16	3.43
21	600690	青岛海尔	2,407,453.00	3.34
22	000776	广发证券	2,362,253.73	3.28
23	002241	歌尔声学	2,344,093.21	3.25
24	600585	海螺水泥	2,286,933.00	3.17
25	002475	立讯精密	2,227,856.31	3.09
26	600458	时代新材	2,193,606.00	3.04
27	300134	大富科技	2,187,033.75	3.03
28	600062	华润双鹤	2,080,635.28	2.89
29	002273	水晶光电	2,058,729.76	2.86
30	600276	恒瑞医药	2,052,190.17	2.85
31	000725	京东方A	1,957,000.00	2.72
32	002313	日海通讯	1,920,785.90	2.67
33	601668	中国建筑	1,910,000.00	2.65
34	601333	广深铁路	1,818,000.00	2.52
35	600261	阳光照明	1,808,676.42	2.51
36	000937	冀中能源	1,790,000.00	2.48
37	000049	德赛电池	1,775,135.13	2.46
38	601166	兴业银行	1,698,718.00	2.36
39	000789	江西水泥	1,689,872.00	2.34
40	000733	振华科技	1,683,927.12	2.34

41	600252	中恒集团	1,671,011.84	2.32
42	600123	兰花科创	1,664,223.00	2.31
43	000050	深天马 A	1,637,410.97	2.27
44	600741	华域汽车	1,632,660.00	2.27
45	002491	通鼎光电	1,621,069.55	2.25
46	600703	三安光电	1,617,757.41	2.24
47	000028	国药一致	1,610,150.00	2.23
48	600335	国机汽车	1,601,661.40	2.22
49	601628	中国人寿	1,564,698.00	2.17
50	002335	科华恒盛	1,489,666.36	2.07

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	190,689,979.96
卖出股票收入（成交）总额	186,306,098.69

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 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

注：本基金本报告期末投资股指期货，本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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 7.10 投资组合报告附注

### 7.10.1

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

### 7.10.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 7.10.3 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	55,369.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	18,472.37
4	应收利息	1,347.97
5	应收申购款	1,864,942.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	35,287.82
8	其他	-
9	合计	1,975,419.83

### 7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,538	40,190.58	7,556,634.00	12.22%	54,256,473.71	87.78%

### 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	15,432.86	0.0250%

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

②本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年4月20日）基金份额总额	523,254,064.01
本报告期期初基金份额总额	69,355,764.69
本报告期基金总申购份额	113,878,035.01
减：本报告期基金总赎回份额	121,420,691.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	61,813,107.71

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

本报告期，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
长江证券	1	105,365,470.08	27.95%	95,924.93	28.11%	-
国信证券	2	95,978,936.63	25.46%	85,556.24	25.07%	-
海通证券	1	56,767,129.44	15.06%	51,680.93	15.14%	-
东兴证券	1	36,168,420.13	9.59%	32,927.47	9.65%	-
中信证券	1	22,369,815.38	5.93%	20,365.38	5.97%	-
民生证券	1	21,812,905.10	5.79%	19,858.57	5.82%	-
中投证券	2	14,036,040.01	3.72%	12,778.38	3.74%	-
华创证券	1	10,903,944.08	2.89%	9,926.77	2.91%	-
西部证券	2	8,675,166.45	2.30%	7,897.94	2.31%	-
中金公司	1	4,918,251.35	1.30%	4,352.19	1.28%	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：本报告期内共新增西部证券 2 个交易日单元，减少第一创业及其 1 个交易日单元。截止本报告期末共计 37 个交易日单元。

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要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

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