

# 景顺长城新兴成长股票型证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 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：2014 年 3 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 2014 年 3 月 24 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（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 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

### 1.2

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	景顺长城新兴成长股票
基金主代码	260108
交易代码	260108
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 28 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	2,852,333,558.60 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以长期看好中国经济增长和资本市场发展为立足点，通过投资于具有合理值的高成长性上市公司股票，以获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金重点投资于成长型公司。根据不同类型成长型公司扩张起源的背景因素，本基金主要采取“自下而上”的投资策略，并结合估值因素最终确定投资标的。
业绩比较基准	富时中国 A600 成长指数×80%+同业存款利率×20%。
风险收益特征	本基金是风险程度较高的投资品种。

### 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

### 2.4 信息披露方式

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

## § 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	273,285,426.43	-979,136,436.26	-72,574,665.03
本期利润	394,617,673.73	-136,047,989.31	-1,111,212,698.93
加权平均基金份额本期利润	0.1294	-0.0410	-0.3156
本期基金份额净值增长率	20.10%	-6.47%	-32.56%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2533	-0.3778	-0.3348
期末基金资产净值	2,129,857,027.76	2,007,227,238.74	2,270,839,645.40
期末基金份额净值	0.747	0.622	0.665

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。

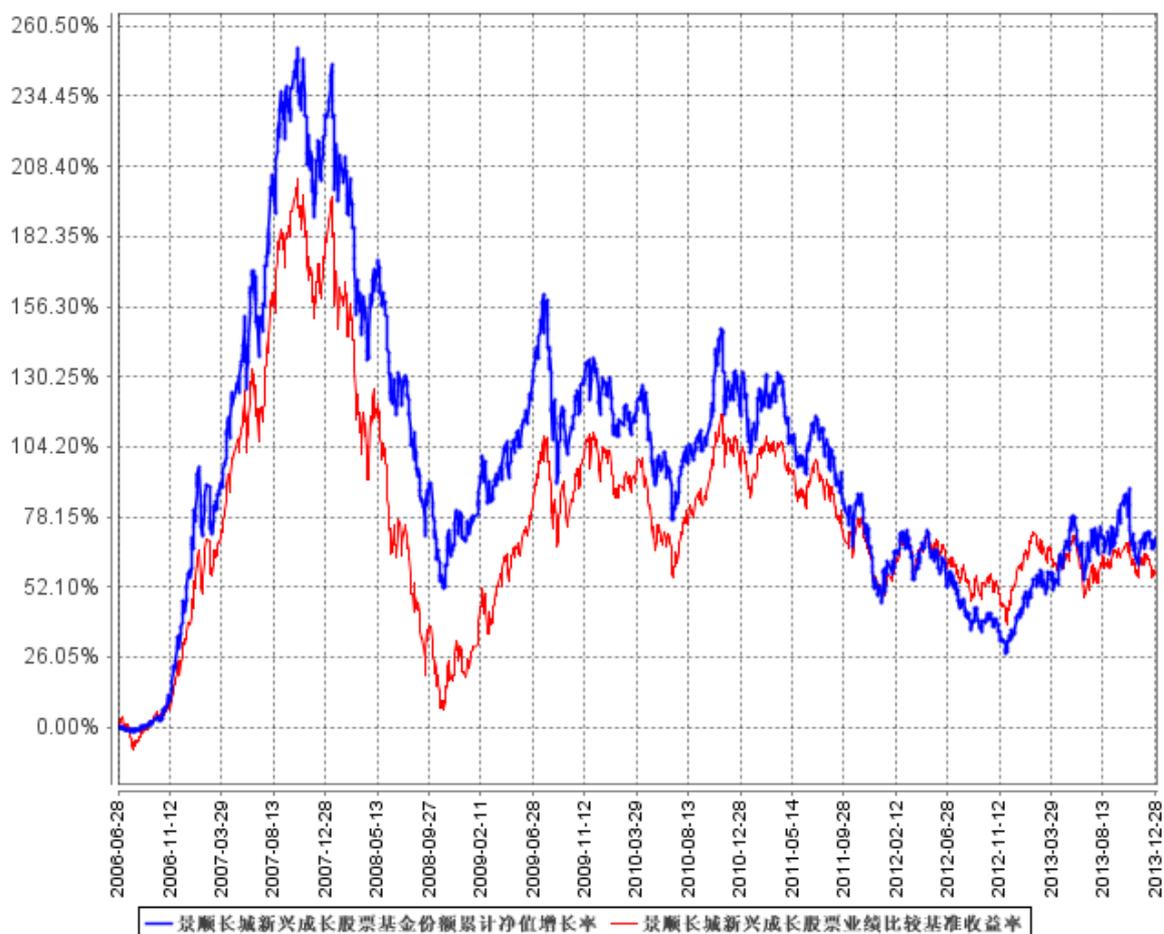
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

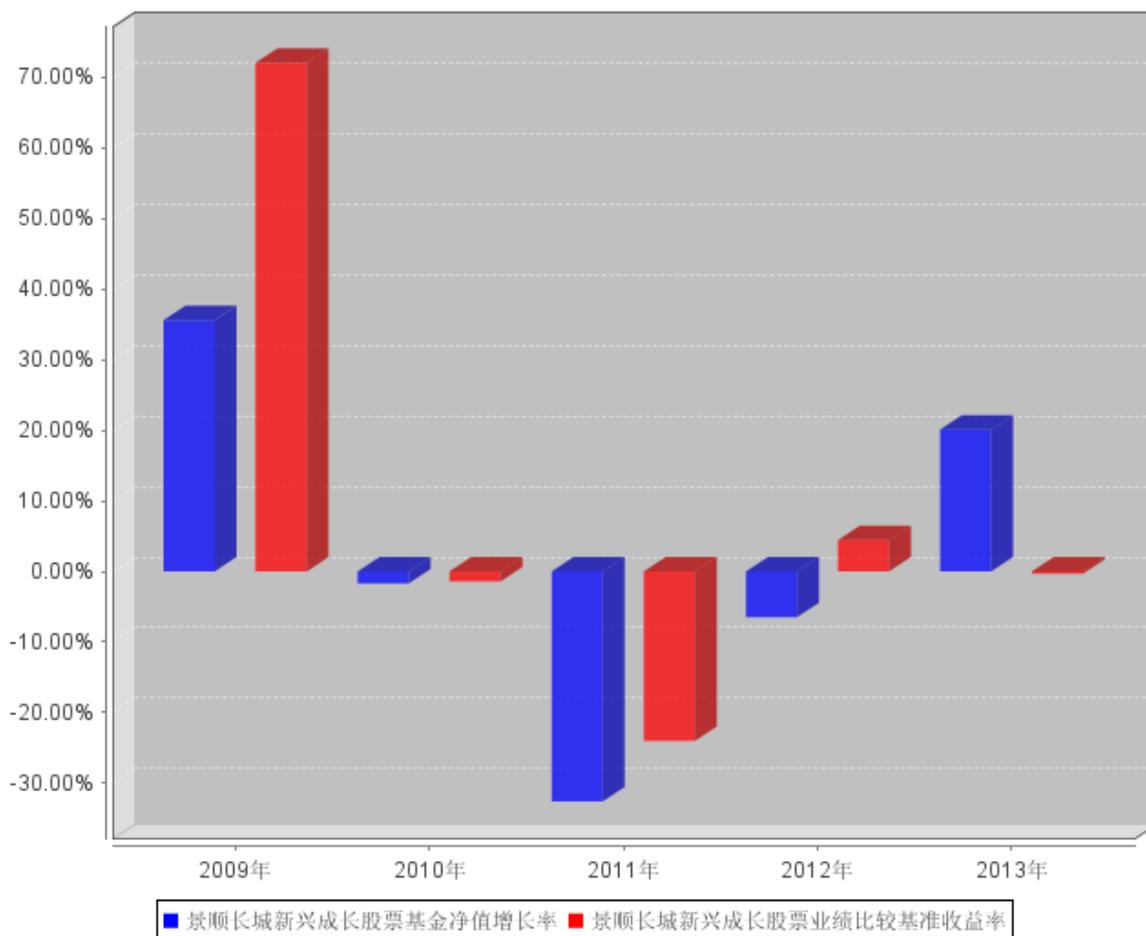
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.51%	1.49%	-3.12%	0.95%	-3.39%	0.54%
过去六个月	6.56%	1.49%	5.39%	1.02%	1.17%	0.47%
过去一年	20.10%	1.47%	-0.31%	1.09%	20.41%	0.38%
过去三年	-24.24%	1.41%	-20.89%	1.10%	-3.35%	0.31%
过去五年	0.99%	1.47%	34.20%	1.27%	-33.21%	0.20%
自基金合同生效起至今	70.84%	1.61%	59.17%	1.55%	11.67%	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：对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于成长型上市公司的股票比例高于非现金基金资产的 80%。本基金自 2006 年 6 月 28 日合同生效日起至 2006 年 12 月 27 日为建仓期。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 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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2013年12月31日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理29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、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（ETF）、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（ETF）。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		
邓春鸣	本基金基金经理，景顺长城公司治理股票型证券投资基金基金经理，股票投资部投资副总监	2010 年 5 月 29 日	-	12	经济学硕士，CFA。曾任职于招商证券证券投资部和资产管理部，也曾担任宝盈基金行业研究员、基金经理助理等职务。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。

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、《景顺长城新兴成长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

所有投资对象的投资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性解释，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。

### 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 年中国经济走势基本与市场预期一致，进入了缓慢下跌的阶段，初显稳定迹象。短周期的衰退同时叠加了中周期下滑，从尚属良好的就业情况来判断，经济的中周期增长中枢或者说潜在增速与目前的经济增速缺口不大。在这种背景下，宏观经济的总体是稳定的，但经济结构发生了较为明显的变化：不仅原投资高度相关的周期性行业不断深度调整，部分经历了长期的价格驱动的高端消费品也开始了漫长的回归之路。在金融领域，利率市场化以一种非典型的方式深入推进，导致了市场的无风险收益率高位徘徊或继续上升，这可能是沪深市场估值水平在 2013 年度持续下降的重要原因之一。

从市场的股价表现来看，周期性行业、金融地产行业和高端消费品超额收益明显，以医药

为代表的大众消费品、代表技术进步的高端制造业、以 TMT 为代表的新兴产业有明显超额收益。汽车、家电等业绩稳定的蓝筹股略有超额收益。

投资组合方面，2013 年本基金坚持投资于以医药为代表的大众消费品、代表技术进步的高端制造业、以 TMT 为代表的新兴产业，取得了一定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年度，本基金份额净值增长率为 20.10%，高于业绩比较基准收益率 20.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

改革与结构调整仍将是 2014 年宏观经济的主基调。尽管存在地方债务的清理、房地产投资放缓、高企的资金价格等负面因素，但健康的居民资产负债表、稳定复苏的全球经济、政府稳定经济的政策空间等积极因素也同时存在，这将决定 2014 年全年的背景是稳定，主基调是改革与结构调整。

我们仍然看好经济结构调整中的成长性公司，这些成长性公司将主要产生在一些新兴、消费类的行业中，包括以医药为代表的大众消费品、代表技术进步的高端制造业、以 TMT 为代表的新兴产业、现代农业、现代服务业等。我们看好这些行业中管理优秀、成长性较高、成长空间广阔的公司，并将坚持投资于这类个股，希望能够为投资者带来较好回报。

#### 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新兴成长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，景顺长城新兴成长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

司在景顺长城新兴成长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，景顺长城新兴成长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新兴成长股票型证券投资基金 2013 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

本报告期内，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城新兴成长股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		267,175,581.59	280,675,963.98
结算备付金		5,309,401.63	624,048.66
存出保证金		1,700,055.23	2,178,514.09
交易性金融资产		1,594,730,277.87	1,624,940,754.96
其中：股票投资		1,495,195,277.87	1,624,940,754.96
基金投资		-	-
债券投资		99,535,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	100,000,350.00
应收证券清算款		297,469,088.17	3,993,273.13
应收利息		2,593,102.32	155,118.25
应收股利		54,000.00	-
应收申购款		33,666.03	34,970.12

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,169,065,172.84	2,012,602,993.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31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		27,773,696.88	-
应付赎回款		3,796,726.33	822,207.25
应付管理人报酬		2,711,781.77	2,418,943.33
应付托管费		451,963.60	403,157.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,266,182.32	1,023,498.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		207,794.18	707,948.29
负债合计		39,208,145.08	5,375,754.45
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		2,852,333,558.60	3,225,859,384.32
未分配利润		-722,476,530.84	-1,218,632,145.58
所有者权益合计		2,129,857,027.76	2,007,227,238.74
负债和所有者权益总计		2,169,065,172.84	2,012,602,993.19

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.747 元，基金份额总额 2,852,333,558.60 份。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城新兴成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至 2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年12月31日
<b>一、收入</b>		453,247,172.50	-85,690,300.50
1. 利息收入		6,419,274.99	2,385,206.86
其中：存款利息收入		2,290,431.95	2,266,097.17
债券利息收入		1,739,373.87	4,544.52

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,389,469.17	114,565.17
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		325,344,602.02	-931,198,333.62
其中：股票投资收益		309,779,399.22	-960,622,083.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益		3,152,142.92	-30.92
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		12,413,059.88	29,423,780.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		121,332,247.30	843,088,446.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		151,048.19	34,379.31
<b>减：二、费用</b>		58,629,498.77	50,357,688.81
1. 管理人报酬		32,867,811.63	33,051,947.73
2. 托管费		5,477,968.57	5,508,658.01
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		19,845,224.93	11,369,432.69
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		438,493.64	427,650.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		394,617,673.73	-136,047,989.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		394,617,673.73	-136,047,989.31

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城新兴成长股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	3,225,859,384.32	-1,218,632,145.58	2,007,227,238.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	394,617,673.73	394,617,673.73



和《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,921,069,020.42 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 86 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 6 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,923,088,471.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,019,451.43 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金是一只较高持股的股票型基金，对于股票的投资不少于基金资产净值的 65%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：富时中国 A600 成长指数(原名为新华富时 600 成长指数)X80%+同业存款利率 X20%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2014 年 3 月 25 日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城新兴成长股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2013 年度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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 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。

#### **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**

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 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、注册登记机构、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、基金销售机构
长城证券有限责任公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	457,339,043.03	3.56%	208,169,541.24	2.84%

#### 7.4.8.1.2 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。

#### 7.4.8.1.3 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	413,527.31	3.54%	154,485.82	3.62%
关联方名称	上年度可比期间 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	172,428.87	2.74%	40,206.47	3.93%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 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等。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年
----	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	32,867,811.63	33,051,947.73
其中：支付销售机构的客户维护费	7,796,207.53	7,816,450.30

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.5%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,477,968.57	5,508,658.01

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.25%/当年天数。

#### 7.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本期末和上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	267,175,581.59	2,189,499.20	280,675,963.98	2,220,342.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期和上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
002456	欧菲光	2013 年 1 月 31 日	2014 年 2 月 7 日	非公开发行	37.00	45.48	369,600	13,675,200.00	16,809,408.00	-
002456	欧菲光	2013 年 4 月 16 日	2014 年 2 月 7 日	非公开发行-转增	-	45.48	369,600	-	16,809,408.00	-
合计								13,675,200.00	33,618,816.00	

注：基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

##### 7.4.9.2 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
000625	长安汽车	2013 年 12 月 31 日	澄清媒体公告	11.45	2014 年 1 月 3 日	11.72	3,714,103	43,272,630.98	42,526,479.35	-

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

## (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,419,049,982.52 元，属于第二层级的余额为 175,680,295.35 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 1,558,072,754.96 元，第二层级 66,868,000.00 元，无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

## (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,495,195,277.87	68.93
	其中：股票	1,495,195,277.87	68.93

2	固定收益投资	99,535,000.00	4.59
	其中：债券	99,535,000.00	4.59
	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	272,484,983.22	12.56
6	其他各项资产	301,849,911.75	13.92
7	合计	2,169,065,172.84	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	7,295,000.00	0.34
B	采矿业	55,594,486.15	2.61
C	制造业	1,221,805,218.26	57.37
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	78,172,427.55	3.67
G	交通运输、仓储和邮政业	132,002,257.47	6.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,930.94	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	262,957.50	0.01
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	1,495,195,277.87	70.20

### 8.3 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	000651	格力电器	2,904,493	94,860,741.38	4.45
2	002385	大北农	5,690,909	93,046,362.15	4.37
3	601006	大秦铁路	10,866,468	80,303,198.52	3.77
4	002023	海特高新	4,561,420	78,182,738.80	3.67
5	601877	正泰电器	3,050,898	75,906,342.24	3.56
6	000333	美的集团	1,348,945	67,447,250.00	3.17
7	000550	江铃汽车	2,429,080	61,722,922.80	2.90
8	002701	奥瑞金	1,591,600	60,910,532.00	2.86
9	600983	合肥三洋	3,781,168	56,830,955.04	2.67
10	600104	上汽集团	4,001,976	56,587,940.64	2.66

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年度报告正文。

### 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	300104	乐视网	123,658,089.04	6.16
2	000001	平安银行	88,599,770.08	4.41
3	600104	上汽集团	84,420,957.00	4.21
4	601877	正泰电器	84,382,139.95	4.20
5	000651	格力电器	84,166,090.37	4.19
6	601006	大秦铁路	83,812,404.83	4.18
7	300144	宋城股份	82,436,669.70	4.11
8	002024	苏宁云商	78,416,542.81	3.91
9	300002	神州泰岳	71,436,481.23	3.56
10	600037	歌华有线	70,846,681.54	3.53
11	600557	康缘药业	70,663,573.34	3.52
12	600804	鹏博士	70,055,656.60	3.49
13	002023	海特高新	69,678,656.15	3.47

14	000012	南 玻A	67,207,164.93	3.35
15	300050	世纪鼎利	65,664,394.15	3.27
16	002069	獐 子 岛	64,930,991.95	3.23
17	600418	江淮汽车	64,784,084.20	3.23
18	000333	美的集团	64,531,871.03	3.21
19	600436	片仔癀	63,857,669.24	3.18
20	000061	农 产 品	63,786,781.28	3.18
21	002309	中利科技	63,089,218.68	3.14
22	002081	金 螳 螂	62,342,734.60	3.11
23	300058	蓝色光标	61,311,798.55	3.05
24	002701	奥瑞金	59,953,990.49	2.99
25	300133	华策影视	59,821,937.23	2.98
26	000099	中信海直	59,770,846.74	2.98
27	600704	物产中大	59,442,808.68	2.96
28	002415	海康威视	59,294,281.25	2.95
29	600198	大唐电信	59,252,558.71	2.95
30	600000	浦发银行	59,024,996.45	2.94
31	300005	探路者	56,213,871.50	2.80
32	300207	欣旺达	56,110,129.98	2.80
33	600633	浙报传媒	55,678,405.19	2.77
34	300043	星辉车模	54,500,138.97	2.72
35	002049	同方国芯	53,272,727.62	2.65
36	002011	盾安环境	51,243,083.61	2.55
37	300197	铁汉生态	51,079,823.23	2.54
38	002305	南国置业	51,006,049.75	2.54
39	002230	科大讯飞	48,692,083.89	2.43
40	002663	普邦园林	48,455,991.79	2.41
41	002567	唐人神	47,466,912.65	2.36
42	000550	江铃汽车	47,174,037.52	2.35
43	002148	北纬通信	47,057,222.57	2.34
44	002594	比亚迪	45,849,105.78	2.28
45	601117	中国化学	45,633,501.83	2.27
46	600030	中信证券	44,542,937.62	2.22
47	000400	许继电气	44,323,669.80	2.21
48	600880	博瑞传播	44,300,567.60	2.21
49	600038	哈飞股份	44,297,329.66	2.21

50	600983	合肥三洋	43,745,041.57	2.18
51	000783	长江证券	43,692,771.59	2.18
52	600015	华夏银行	43,661,859.03	2.18
53	000625	长安汽车	43,272,630.98	2.16
54	000915	山大华特	43,109,461.38	2.15
55	600885	宏发股份	43,018,111.77	2.14
56	002416	爱施德	42,997,220.54	2.14
57	600309	万华化学	42,846,276.99	2.13
58	000970	中科三环	42,002,727.20	2.09
59	600859	王府井	41,411,470.68	2.06
60	300072	三聚环保	40,227,588.27	2.00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	300104	乐视网	116,509,976.41	5.80
2	300146	汤臣倍健	108,697,049.65	5.42
3	002024	苏宁云商	103,614,126.57	5.16
4	300133	华策影视	101,858,938.26	5.07
5	002415	海康威视	95,857,127.56	4.78
6	000001	平安银行	85,057,899.05	4.24
7	002429	兆驰股份	77,905,408.73	3.88
8	000661	长春高新	77,625,389.23	3.87
9	300144	宋城股份	75,613,110.04	3.77
10	600633	浙报传媒	72,502,190.82	3.61
11	300058	蓝色光标	70,265,703.09	3.50
12	300124	汇川技术	69,901,014.06	3.48
13	300002	神州泰岳	68,743,528.58	3.42
14	600637	百视通	67,228,112.66	3.35
15	002065	东华软件	66,261,954.78	3.30
16	300207	欣旺达	64,261,689.90	3.20
17	600804	鹏博士	63,946,201.13	3.19
18	300050	世纪鼎利	63,907,894.00	3.18
19	601117	中国化学	63,322,560.70	3.15
20	002309	中利科技	62,994,595.62	3.14

21	600037	歌华有线	62,119,468.79	3.09
22	600436	片仔癀	60,837,147.14	3.03
23	002565	上海绿新	59,957,291.87	2.99
24	601166	兴业银行	58,412,911.30	2.91
25	002230	科大讯飞	57,969,804.10	2.89
26	000826	桑德环境	57,924,591.10	2.89
27	600535	天士力	57,602,775.03	2.87
28	000061	农产品	57,104,262.45	2.84
29	000012	南玻A	56,924,927.55	2.84
30	002273	水晶光电	56,888,972.79	2.83
31	002456	欧菲光	56,860,696.46	2.83
32	002069	獐子岛	55,677,263.67	2.77
33	600418	江淮汽车	55,264,641.85	2.75
34	002148	北纬通信	54,208,764.09	2.70
35	300043	星辉车模	54,055,715.06	2.69
36	600000	浦发银行	53,559,821.57	2.67
37	600518	康美药业	51,596,274.88	2.57
38	002416	爱施德	50,814,548.73	2.53
39	002450	康得新	50,136,280.86	2.50
40	300070	碧水源	49,215,615.86	2.45
41	002081	金螳螂	48,704,227.38	2.43
42	300197	铁汉生态	48,372,942.40	2.41
43	002305	南国置业	46,901,712.25	2.34
44	002594	比亚迪	46,870,562.03	2.34
45	600048	保利地产	46,857,289.77	2.33
46	600030	中信证券	46,760,773.74	2.33
47	600880	博瑞传播	46,334,836.66	2.31
48	002049	同方国芯	44,646,240.75	2.22
49	300157	恒泰艾普	44,257,738.16	2.20
50	600198	大唐电信	44,235,969.17	2.20
51	002011	盾安环境	44,141,836.56	2.20
52	300005	探路者	43,934,170.79	2.19
53	600015	华夏银行	43,819,684.09	2.18
54	000915	山大华特	43,639,904.88	2.17
55	000400	许继电气	42,673,644.15	2.13
56	300020	银江股份	41,836,934.50	2.08
57	300291	华录百纳	41,416,857.95	2.06
58	600221	海南航空	41,352,880.00	2.06

59	601633	长城汽车	41,303,683.37	2.06
60	002570	贝因美	41,229,112.29	2.05
61	600038	哈飞股份	40,768,144.37	2.03

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

### 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	6,152,621,694.29
卖出股票收入（成交）总额	6,712,707,967.90

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。

### 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	-	-
3	金融债券	99,535,000.00	4.67
	其中：政策性金融债	99,535,000.00	4.67
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	99,535,000.00	4.67

### 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	130201	13 国开 01	500,000	49,995,000.00	2.35
2	130311	13 进出 11	500,000	49,540,000.00	2.33

### 8.7 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。

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

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。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 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	1,700,055.23
2	应收证券清算款	297,469,088.17
3	应收股利	54,000.00
4	应收利息	2,593,102.32
5	应收申购款	33,666.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	301,849,911.75
---	----	----------------

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### § 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
137,173	20,793.70	6,855,302.14	0.24%	2,845,478,256.46	99.76%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年6月28日）基金份额总额	5,923,088,471.85
本报告期期初基金份额总额	3,225,859,384.32
本报告期基金总申购份额	61,883,997.66
减：本报告期基金总赎回份额	435,409,823.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,852,333,558.60

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

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，并向中国证券投资基金业协会备案。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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 8 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 103,000.00 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	
中信证券股份有限公司		22,569,205,573.54	19.99%	2,339,001.93	20.04%	未变更
兴业证券股份		12,234,559,407.29	17.39%	2,034,348.18	17.43%	未变更

有限公司						
招商证券股份 有限公司	1	1,602,341,478.72	12.47%	1,441,766.82	12.35%	未变更
华创证券有限 责任公司	1	1,338,626,436.52	10.42%	1,215,506.46	10.42%	未变更
安信证券股份 有限公司	1	765,914,177.11	5.96%	691,248.31	5.92%	未变更
海通证券股份 有限公司	1	731,495,328.77	5.69%	665,954.12	5.71%	未变更
国金证券股份 有限公司	1	721,837,157.27	5.62%	657,156.76	5.63%	未变更
申银万国证券 股份有限公司	1	647,312,113.76	5.04%	589,308.53	5.05%	未变更
长城证券有限 责任公司	1	457,339,043.03	3.56%	413,527.31	3.54%	未变更
北京高华证券 有限责任公司	1	423,907,331.13	3.30%	385,921.17	3.31%	未变更
中国国际金融 有限公司	2	380,073,771.78	2.96%	346,020.08	2.96%	未变更
民生证券股份 有限公司	1	379,722,327.10	2.95%	345,697.08	2.96%	未变更
中国银河证券 股份有限公司	1	375,614,300.28	2.92%	341,959.97	2.93%	未变更
国泰君安证券 股份有限公司	1	155,682,570.39	1.21%	141,732.95	1.21%	未变更
中信建投证券 股份有限公司	2	65,115,230.38	0.51%	59,281.37	0.51%	未变更
第一创业证券 股份有限公司	1	2,478,171.06	0.02%	2,256.11	0.02%	未变更
方正证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	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
中信证券股份有限公司	-	-	650,000,000.00	20.31%	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	6,888,896.85	11.49%	-	-	-	-
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	-	-	1,750,000,000.00	54.69%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	53,066,885.70	88.51%	800,000,000.00	25.00%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

股份有限公司						
第一创业证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

景顺长城基金管理有限公司  
2014 年 3 月 26 日