

景顺长城大中华股票型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012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：2012年8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 2012 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	35
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	36
7.7 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.....	36
7.8 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.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	37
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细.....	37
7.11 投资组合报告附注.....	37

§8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
§9 开放式基金份额变动	38
§10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 备查文件目录	42
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城大中华股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城大中华股票(QDII)
基金主代码	262001
交易代码	262001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9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	51,741,625.07份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于除内地以外的大中华地区证券市场以及海外证券市场交易的大中华企业，追求长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的选股相结合的投资策略，在实际投资组合的构建上更偏重“自下而上”的部分，重点投资于处于合理价位的成长型股票(Growth at Reasonable Price, GARP)以及受惠于盈利周期加速且估值便宜的品质型股票(value + catalyst)。
业绩比较基准	摩根斯坦利金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)。
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于高预期风险、高预期收益的投资品种。

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	杨皞阳	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	北京市西城区复兴门内大街

	建设广场第一座 21 层	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Invesco Hong Kong Limited	Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited
	中文	景顺投资管理有限公司	渣打银行(香港)有限公司
注册地址		香港中环花园道 3 号花旗银行大厦 41 楼	香港中环德辅道中 4-4A 号渣打银行大厦 32 楼
办公地址		香港中环花园道 3 号花旗银行大厦 41 楼	香港中环德辅道中 4-4A 号渣打银行大厦 32 楼
邮政编码		-	-

2.5 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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2012 年 1 月 1 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,437,602.61
本期利润	2,761,028.62
加权平均基金份额本期利润	0.0567

本期加权平均净值利润率	5.41%
本期基金份额净值增长率	5.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	239,467.26
期末可供分配基金份额利润	0.0046
期末基金资产净值	51,981,092.33
期末基金份额净值	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	0.50%

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。

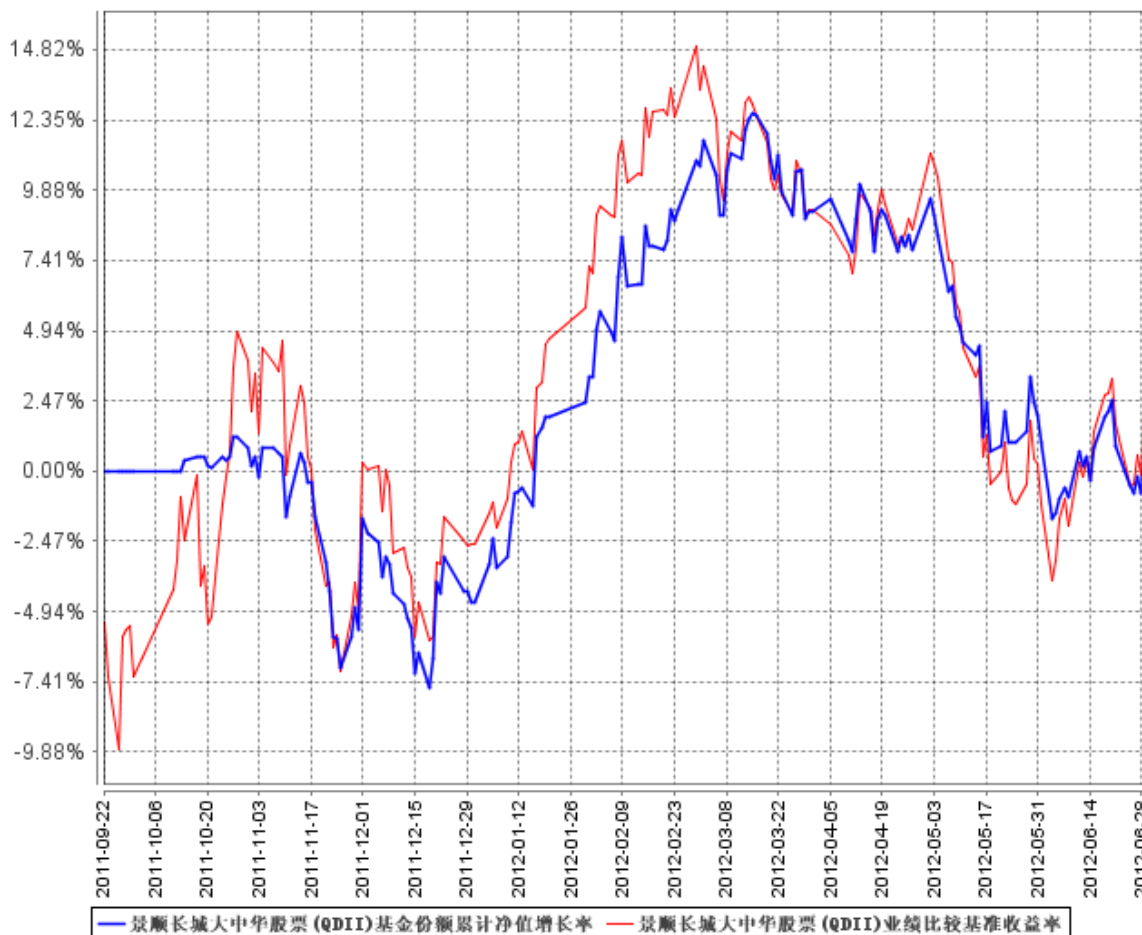
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-1.47%	1.04%	1.83%	1.38%	-3.30%	-0.34%
过去三个月	-7.88%	1.03%	-6.55%	1.25%	-1.33%	-0.22%
过去六个月	5.35%	0.98%	4.71%	1.16%	0.64%	-0.18%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.98%	2.05%	1.54%	-1.55%	-0.56%

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：股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%；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%。本基金的建仓期为自 2011 年 9 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。基金合同生效（2011 年 9 月 22 日）起至本报告期末不满一年。

§ 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 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司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、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。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		
谢天翎	景顺长城大中华股票型证券投资基金基金经理	2011年9月22日	-	11	台湾大学经济学学士、商学硕士，CFA。曾任台湾保诚证券投资信托股份有限公司股票投资暨研究部海外组副理和基金经理；2008年4月加入本公司。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
萧光一	投资总监	21	美国德雷塞尔大学金融硕士。历任 Grand Regent

(Mike Shiao)			Investment Ltd 项目经理；Overseas Credit and Securities Incorporated 台湾科技行业资深分析师；台湾国际投信负责科技行业的研究并管理柜买公募基金；景顺台湾的股票主管，负责台湾股票团队和流程，并管理一只台湾公募基金：景顺主流基金。2006 年入职香港景顺，担任投资总监，负责覆盖香港、大陆和台湾市场，并且是景顺大中华基金的主要基金经理。
--------------	--	--	---

4.3 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、《景顺长城大中华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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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》，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。

4.4.2 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年大中华市场先涨后跌，1 季度估值低吸引资金，2 季度宏观经济动能趋缓，市场情绪去风险造成估值下移，加上中国经济增长下移，企业盈余大幅修正，大中华市场面临调整，全球资本市场涨幅缩减，基准摩根斯坦利金龙指数年初以来仅上涨 3%。行业以业绩稳定增长的必选消费及医疗类股表现最佳，而大宗商品价格及油价下跌导致原物料及能源类股表现最差。大中华基金投资策略重选股，谨慎选择估值低的个股，但是部分电子个股出货情况低于预期，尽管估值低但是股价仍然出现明显下跌。另外，因为油价的大幅下跌也致使能源类股表现不佳。不过一直坚持消费类股及良好的个股选择有益于基金整体表现，年初至今基金表现仍好于基准，取得正收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

2012 年上半年，本基金份额净值增长率为 5.35%，高于业绩比较基准收益率 0.64%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观方面，美国新屋销售快于新开工，持续去库存，短期成长动能不大，不过美国产能利用率仍在提升，一旦投资提升未来成长力道大。欧盟高峰会取得共识，短期不确定暂时消除，不过欧债问题将费时多年，欧洲增长不容乐观。中国经济成长初露疲态，中国政府已降息因应，硬着陆的风险不大。在宏观不佳的情势下，市场估值已反映增长不佳的风险，预计下半年市场估值下移的风险不大，盈余增长也不易上移，所以市场表现震荡概率大。大中华基金投资策略仍以长期价值角度，选择具备核心技术、拥有品牌或行业地位稳固的公司，希望藉由持续盈利增长取得投资回报。

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。

截至本报告期末，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，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

§ 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 年上半年，本基金托管人在对景顺长城大中华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 年上半年，景顺长城大中华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大中华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，景顺长城大中华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大中华股票型证券投资基金 2012 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：景顺长城大中华股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,414,439.10	2,361,775.82
结算备付金		9,090.91	238,636.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	46,212,544.01	48,201,990.38
其中：股票投资		46,212,544.01	48,201,990.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	800.19	1,121.37
应收股利		228,765.26	50,587.68
应收申购款		3,469,099.76	14,779.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,334,739.23	52,868,890.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,052,974.19	1,905,170.01
应付管理人报酬		80,912.84	80,996.17

应付托管费		15,733.05	15,749.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	1,069.14
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	204,026.82	82,180.25
负债合计		5,353,646.90	2,085,164.82
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	51,741,625.07	53,220,334.33
未分配利润	6.4.7.10	239,467.26	-2,436,608.21
所有者权益合计		51,981,092.33	50,783,726.12
负债和所有者权益总计		57,334,739.23	52,868,890.94

注：报告截止日 2012 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 51,741,625.07 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城大中华股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		3,706,752.64
1.利息收入		24,744.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,060.92
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		10,683.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,376,687.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,786,336.34
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	590,351.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,323,426.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-99,850.64
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	81,745.01
减：二、费用		945,724.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	455,874.23

2. 托管费	6.4.10.2.2	88,642.16
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	214,113.53
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	187,094.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,761,028.62
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,761,028.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城大中华股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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）	53,220,334.33	-2,436,608.21	50,783,726.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,761,028.62	2,761,028.62
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）	-1,478,709.26	-84,953.15	-1,563,662.41
其中：1.基金申购款	60,329,917.44	3,501,223.65	63,831,141.09
2.基金赎回款	-61,808,626.70	-3,586,176.80	-65,394,803.50
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）	51,741,625.07	239,467.26	51,981,092.33

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
基金管理公司负责人

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

景顺长城大中华股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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]第 709 号《关于核准景顺长城大中华股票型证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华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 291,060,560.03 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(2011)第 367 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 291,092,562.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 32,002.52 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,境外资产托管人为渣打银行(香港)有限公司(Standard Chartered Bank (Hong Kong) Limited)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城大中华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股票及其他权益类证券、现金、债券、股指期货及中国证监会允许投资的其它金融工具。本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的 60%,其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的 80%;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:摩根斯坦利金龙净总收益指数。(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)

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 2012 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》和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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

无。

6.4.6 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	7,414,439.10
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,414,439.10

注：于 2012 年 6 月 30 日，银行存款中包含的外币余额为：港元 4,262,891.92 元(折合人民币 3,475,194.71 元)，美元 3.92 元(折合人民币 24.79 元)，新台币 1,181,604.00(折合人民币 250,185.14 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	47,151,285.22	46,212,544.01	-938,741.21
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,151,285.22	46,212,544.01	-938,741.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末的衍生金融资产/负债项目余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	796.10
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	4.09
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	800.19

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末应付交易费用为零。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19,043.84
预提费用	184,982.98
合计	204,026.82

6.4.7.9 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,220,334.33	53,220,334.33
本期申购	60,329,917.44	60,329,917.44
本期赎回(以“-”号填列)	-61,808,626.70	-61,808,626.70
- 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	51,741,625.07	51,741,625.07

6.4.7.10 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	-338,926.00	-2,097,682.21	-2,436,608.21
本期利润	1,437,602.61	1,323,426.01	2,761,028.62
本期基金份额交易产生的变动数	193,212.15	-278,165.30	-84,953.15
其中：基金申购款	1,114,191.38	2,387,032.27	3,501,223.65
基金赎回款	-920,979.23	-2,665,197.57	-3,586,176.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,291,888.76	-1,052,421.50	239,467.26

6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	13,273.56
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	191.97
其他	595.39
合计	14,060.92

6.4.7.12 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6月30日
卖出股票成交总额	36,082,317.93
减：卖出股票成本总额	34,295,981.59
买卖股票差价收入	1,786,336.34

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期的债券投资收益项目发生额为零。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期的衍生工具收益项目发生额为零。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	590,351.37
基金投资产生的股利收益	-
合计	590,351.37

6.4.7.16 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6月30日
1. 交易性金融资产	1,323,426.01

——股票投资	1,323,426.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
——外汇远期	-
——期权	-
——互换	-
3. 其他	-
合计	1,323,426.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	81,745.01
合计	81,745.01

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	214,113.53
银行间市场交易费用	-
合计	214,113.53

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	2,111.12
合计	187,094.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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、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、基金代销机构
渣打银行(香港)有限公司（“渣打银行”）	境外资产托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	455,874.23
其中：支付销售机构的客户维护费	166,980.49

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 1.8%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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.8\% / \text{当年天数}$ 。

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	88,642.16

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 0.35%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 X 0.35% / 当年天数。

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人于本期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.3.2 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及上年度末未投资本基金。

6.4.10.4 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6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	6,134,696.38	13,137.52
渣打银行	1,279,742.72	136.04

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人渣打银行保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标，并达到确保合法合规经营、防范和化解风险、提高经营效率及保护投资者和股东合法权益的目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、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层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行和境外次托管行渣打银行，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构(政府、国际金融组织除外)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的基金管理人管理的其他基金共同持有同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的 10%。同时本基金投资于中国证监会签订双边监管合作谅解备忘录的国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不超过基金资产净值的 3%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。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债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30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	7,164,253.96	-	-	-	-	250,185.14	7,414,439.10
结算备付金	9,090.91	-	-	-	-	-	9,090.91
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	46,212,544.01	46,212,544.01
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	-	-	-	-	-	800.19	800.19
应收股利	-	-	-	-	-	228,765.26	228,765.26
应收申购款	1,500,200.00	-	-	-	-	1,968,899.76	3,469,099.76
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	8,673,544.87	-	-	-	-	48,661,194.36	57,334,739.23
负债							
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	-	-	-	-	-	5,052,974.19	5,052,974.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	80,912.84	80,912.84
应付托管费	-	-	-	-	-	15,733.05	15,733.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	204,026.82	204,026.82
负债总计	-	-	-	-	-	5,353,646.90	5,353,646.90
利率敏感度缺口	8,673,544.87	-	-	-	-	-	-
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	1,348,815.40	-	-	-	-	1,012,960.42	2,361,775.82
结算备付金	238,636.36	-	-	-	-	-	238,636.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	48,201,990.38	48,201,990.38
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,121.37	1,121.37
应收股利	-	-	-	-	-	50,587.68	50,587.68
应收申购款	-	-	-	-	-	14,779.33	14,779.33
资产总计	3,587,451.76	-	-	-	-	49,281,439.18	52,868,890.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,905,170.01	1,905,170.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	80,996.17	80,996.17
应付托管费	-	-	-	-	-	15,749.25	15,749.25
应交税费	-	-	-	-	-	1,069.14	1,069.14
其他负债	-	-	-	-	-	82,180.25	82,180.25
负债总计	-	-	-	-	-	2,085,164.82	2,085,164.82
利率敏感度缺口	3,587,451.76	-	-	-	-	-	-

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	新台币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	24.79	3,475,194.71	250,185.14	-	3,725,404.64
交易性金融资产	3,151,416.64	29,934,768.45	13,126,358.92	-	46,212,544.01
应收利息	7.55	7.70	-	-	15.25
应收股利	-	228,765.26	-	-	228,765.26
资产合计	3,151,448.98	33,638,736.12	13,376,544.06	-	50,166,729.16
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	3,151,448.98	33,638,736.12	13,376,544.06	-	50,166,729.16
项目	上年度末 2011年12月31日				
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	新台币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产					
银行存款	183.74	380,158.55	1,012,960.42	-	1,393,302.71
交易性金融资产	1,934,143.17	27,481,056.05	18,786,791.16	-	48,201,990.38
应收股利	-	50,587.68	-	-	50,587.68
资产合计	1,934,326.91	27,911,802.28	19,799,751.58	-	49,645,880.77
以外币计价的负债					
负债合计	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,934,326.91	27,911,802.28	19,799,751.58	-	49,645,880.77

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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6月30日)	上年度末(2011年12月31日)
	所有外币均相对人民币升值5%	2,508,336.46	2,482,294.04
	所有外币均相对人民币下降5%	-2,508,336.46	-2,482,294.04

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金对于股票及其他权益类证券的投资不少于基金资产净值的60%，其中投资于除中国内地以外的大中华地区证券市场以及在其他证券市场交易的大中华企业的资产不低于基金股票及其他权益类资产的80%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30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	46,212,544.01	88.90	48,201,990.38	94.92
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,212,544.01	88.90	48,201,990.38	94.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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6月30日）	上年度末（2011年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	2,287,168.06	2,393,757.86
业绩比较基准下降 5%	-2,287,168.06	-2,393,757.86	

6.4.14 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) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 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 46,212,544.01 元，(2011 年 12 月 31 日：48,201,990.38) 无属于第二层级和第三层级的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间不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或第三层级。

(iv) 第三层次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。

§ 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	46,212,544.01	80.60
	其中：普通股	43,852,100.44	76.48
	存托凭证	2,360,443.57	4.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,423,530.01	12.95
8	其他各项资产	3,698,665.21	6.45
9	合计	57,334,739.23	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
香港特别行政区	29,934,768.45	57.59
台湾地区	13,126,358.92	25.25
美国	3,151,416.64	6.06
合计	46,212,544.01	88.90

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
基础材料	-	-
通讯	7,779,534.36	14.97
消费品, 周期性	12,424,409.80	23.90
消费品, 非周期性	5,316,615.86	10.23
综合经营	-	-
能源	4,373,899.93	8.41
金融	3,287,945.28	6.33
工业	11,216,642.25	21.58
科技	1,813,496.53	3.49
公用事业	-	-
合计	46,212,544.01	88.90

注: 以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位: 人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股有限公司	700 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	19,300	3,555,826.60	6.84
2	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	152,000	3,351,858.62	6.45
3	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	统一超商股份有限公司	2912 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	95,000	3,188,175.64	6.13
4	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	维达国际控股有限公司	3331 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	300,000	2,802,726.35	5.39
5	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	146,000	2,654,193.30	5.11
6	HON HAI	鸿海精密	2317 TT	台湾 - 台	台湾地	128,000	2,422,907.61	4.66

	PRECISION INDUSTRY	工业股份 有限公司		湾证券交 易所	区			
7	SHENZHO INTERNATIONAL GROUP	申洲国际 集团	2313 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	208,000	2,272,181.19	4.37
8	MINTH GROUP LTD	敏实集团 有限公司	425 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	330,000	2,240,958.25	4.31
9	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	海天国际 控股有限 公司	1882 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	281,000	1,754,728.45	3.38
10	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾积体 电路制造 股份有限 公司	2330 TT	台湾 - 台 湾证券交 易所	台湾地 区	100,000	1,721,392.51	3.31
11	HTC CORP	宏达国际 电子股份 有限公司	2498 TT	台湾 - 台 湾证券交 易所	台湾地 区	19,000	1,566,932.94	3.01
12	AU OPTRONICS CORP	友达光电 股份有限 公司	2409 TT	台湾 - 台 湾证券交 易所	台湾地 区	589,000	1,502,767.20	2.89
13	WUXI PHARMATECH INC-ADR	药明康德 新药开发 有限公司	WX US	美国 - 纽约证券 交易所	美国	15,800	1,411,059.90	2.71
14	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国建设 银行股份 有限公司	939 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	280,000	1,207,503.86	2.32
15	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光电 股份有限 公司	3008 TT	台湾 - 台 湾证券交 易所	台湾地 区	9,000	1,177,661.15	2.27
16	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	香港交易 及结算所 有限公司	388 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	12,600	1,129,894.92	2.17
17	ASIA CEMENT CHINA HOLDINGS	亚洲水泥 (中国)控 股公司	743 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	403,500	1,128,268.57	2.17
18	PETROCHINA CO LTD-H	中国石油 天然气有 限公司	857 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	126,000	1,022,041.31	1.97
19	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	统一企业 中国控股 有限公司	220 HK	香港 - 香港联合 交易所	香港特 别行政 区	170,000	997,829.28	1.92
20	SA SA INTERNATIONAL	莎莎国际 集团有限	178 HK	香港 - 香港联合	香港特 别行政	242,000	956,823.74	1.84

	HLDGS	公司		交易所	区			
21	HANG SENG BANK LTD	恒生银行有限公司	11 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	11,000	950,546.50	1.83
22	CTRP.COM INTERNATIONAL -ADR	携程旅行网有限公司	CTRP UW	美国 - 纳斯达克	美国	8,956	949,383.67	1.83
23	SANYANG INDUSTRIAL CO LTD	三阳工业股份有限公司	2206 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	207,000	845,896.10	1.63
24	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	佐丹奴国际有限公司	709 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	180,000	802,665.60	1.54
25	YAHOO! INC	雅虎公司	YHOO UW	美国 - 纳斯达克	美国	7,900	790,973.07	1.52
26	STELLA INTERNATIONAL	九兴控股有限公司	1836 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	48,500	755,179.06	1.45
27	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	味千(中国)控股有限公司	538 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	149,000	647,423.28	1.25
28	CHINA SHIPPING CONTAINER-H	中海集装箱运输有限公司	2866 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	382,000	576,115.97	1.11
29	TCL COMMUNICATION TECH HLDGS	TCL通讯科技控股有限公司	2618 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	261,000	527,675.60	1.02
30	WISTRON NEWEB CORP	启基科技股份有限公司	6285 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	30,000	388,742.48	0.75
31	CHINA DONGXIANG GROUP CO	中国动向(集团)有限公司	3818 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	600,000	342,392.40	0.66
32	MAKALOT INDUSTRIAL CO LTD	聚阳实业股份有限公司	1477 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	12,000	219,779.27	0.42
33	I. T LTD	I. T有限公司	999 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	56,000	152,935.27	0.29
34	SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	四环医药控股集团有限公司	460 HK	香港 - 香港联合交易所	香港特别行政区	46,000	105,000.33	0.20
35	INTERNATIONAL GAMES SYSTEM C	鈰象电子股份有限公司	3293 TT	台湾 - 台湾证券交易所	台湾地区	3,000	92,104.02	0.18

		公司		易所			
--	--	----	--	----	--	--	--

注：本基金对以上证券代码采用彭博代码即 BB Ticker。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	3,097,884.61	6.10
2	SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2313 HK	2,314,027.81	4.56
3	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	2,153,213.82	4.24
4	AU OPTRONICS CORP	2409 TT	2,129,533.59	4.19
5	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	1,667,216.30	3.28
6	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	388 HK	1,436,125.47	2.83
7	SA SA INTERNATIONAL HLDGS	178 HK	1,344,535.80	2.65
8	GIORDANO INTERNATIONAL LTD	709 HK	1,274,906.26	2.51
9	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,171,589.33	2.31
10	CTRP.COM INTERNATIONAL-ADR	CTRP UW	1,117,108.71	2.20
11	HON HAI PRECISION INDUSTRY	2317 TT	1,046,984.30	2.06
12	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	538 HK	1,010,077.49	1.99
13	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2912 TT	878,285.90	1.73
14	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1882 HK	857,932.01	1.69
15	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	814,022.40	1.60
16	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	792,344.02	1.56
17	STELLA INTERNATIONAL	1836 HK	783,176.95	1.54
18	HTC CORP	2498 TT	746,552.26	1.47
19	VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	3331 HK	741,337.73	1.46
20	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2885 TT	712,751.45	1.40

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。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	939 HK	3,235,170.55	6.37
2	SUN HUNG KAI PROPERTIES	16 HK	2,216,520.09	4.36
3	ASUSTEK COMPUTER INC	2357 TT	2,131,356.78	4.20
4	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2207 TT	2,096,399.17	4.13
5	HON HAI PRECISION INDUSTRY	2317 TT	1,650,248.73	3.25
6	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1088 HK	1,518,005.21	2.99
7	UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	220 HK	1,450,534.67	2.86
8	LI NING CO LTD	2331 HK	1,377,780.25	2.71
9	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2912 TT	1,293,481.89	2.55
10	SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	6121 TT	1,292,598.04	2.55
11	SANYANG INDUSTRIAL CO LTD	2206 TT	1,208,986.28	2.38
12	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	1,182,923.49	2.33
13	MINTH GROUP LTD	425 HK	1,111,797.79	2.19
14	AJISEN CHINA HOLDINGS LTD	538 HK	1,077,539.66	2.12
15	HANG SENG BANK LTD	11 HK	994,767.47	1.96
16	SILITECH TECHNOLOGY CORP	3311 TT	950,868.22	1.87
17	WISTRON NEWEB CORP	6285 TT	872,890.14	1.72
18	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	1882 HK	845,293.04	1.66
19	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC.	2018 HK	793,029.94	1.56
20	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	730,160.07	1.44

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。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	30,983,109.21
卖出收入（成交）总额	36,082,317.93

注：买入股票成本、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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金投资。

7.11 投资组合报告附注**7.11.1**

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。

7.11.2

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	228,765.26
4	应收利息	800.19
5	应收申购款	3,469,099.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,698,665.21

7.11.4 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。

7.11.5 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。

§ 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
1,058	48,905.13	24,198,396.41	46.77%	27,543,228.66	53.23%

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
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	475,530.80	0.92%

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9月22日）基金份额总额	291,092,562.55
本报告期期初基金份额总额	53,220,334.33
本报告期基金总申购份额	60,329,917.44
减：本报告期基金总赎回份额	61,808,626.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,741,625.07

§ 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

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。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。

3、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	
masterlink	-	9,493,078.90	14.15%	11,386.46	9.28%	-
摩根斯坦利	-	11,314,183.97	16.87%	24,795.67	20.22%	-
YUANTA	-	12,099,214.06	18.04%	18,150.57	14.80%	-
星展银行	-	16,580,503.90	24.72%	33,161.00	27.04%	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	17,578,446.31	26.21%	35,156.86	28.66%	-

注：本期本基金交易单元未变更。

基金专用交易单元的选择标准和程序:

1) 选择标准

券商的选择基于最佳执行、研究报告质量、财务健全度、交易执行速度、费用、信赖度及负责的回报等因素。选择标准包括但不限于:

- 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、交易券商必需是主要海外证券交易所的成员；
- d、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，有良好的执行能力，且其作业程序需尽责完善。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例
masterlink	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根斯坦利	-	-	-	-	-	-	-	-
YUANTA	-	-	-	-	-	-	-	-
星展银行	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	12,000,000.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	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

	惠活动的公告		
2	景顺长城大中华股票型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	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28日
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	景顺长城基金管理有限公司关于开通银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
9	景顺长城大中华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
10	景顺长城大中华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
11	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
12	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
13	景顺长城大中华股票型证券投资基金 2012 年第 1 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4月23日
14	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	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

	动的公告		
15	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
16	景顺长城大中华股票型证券投资基金境外主要市场节假日暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 2 月 24 日
17	关于景顺长城大中华股票型证券投资基金和景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金参加渤海银行个人网上银行基金申购与基金定期定额投资业务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 2 月 21 日
18	关于景顺长城大中华股票型证券投资基金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 2 月 16 日
19	关于景顺长城大中华股票型证券投资基金新增西部证券为代销机构的公告	中国证券报, 上海证券报, 证券时报, 基金管理人网站	2012 年 2 月 10 日
20	景顺长城大中华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
21	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
22	关于景顺长城大中华股票型证券投资基金 2011 年度最后一个市场交易日/自然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 4 日
23	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

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准景顺长城大中华股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《景顺长城大中华股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城大中华股票型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《景顺长城大中华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。

11.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

11.3 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
2012年8月28日