

景顺长城支柱产业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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	景顺长城支柱产业股票
基金主代码	260117
交易代码	260117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 11 月 20 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	68,189,666.70 份
基金合同存续期	无期限

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于具有投资价值的处于支柱产业地位的优质企业，分享其在中国经济增长的大背景下的可持续性增长，以实现基金资产的长期资本增值。
投资策略	资产配置:本基金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。 股票投资策略:本基金股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用我公司股票研究数据库（SRD）对企业进行深入细致的分析，挖掘出在制造业转型和升级过程中的优势企业。 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。 股指期货投资策略: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。
业绩比较基准	中证中游制造产业指数×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，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@invescogreatwall.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-63201816

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	10,205,604.71
本期利润	5,030,238.46
加权平均基金份额本期利润	0.0883
本期基金份额净值增长率	2.28%
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	0.0763
期末基金资产净值	73,394,649.76
期末基金份额净值	1.076

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。

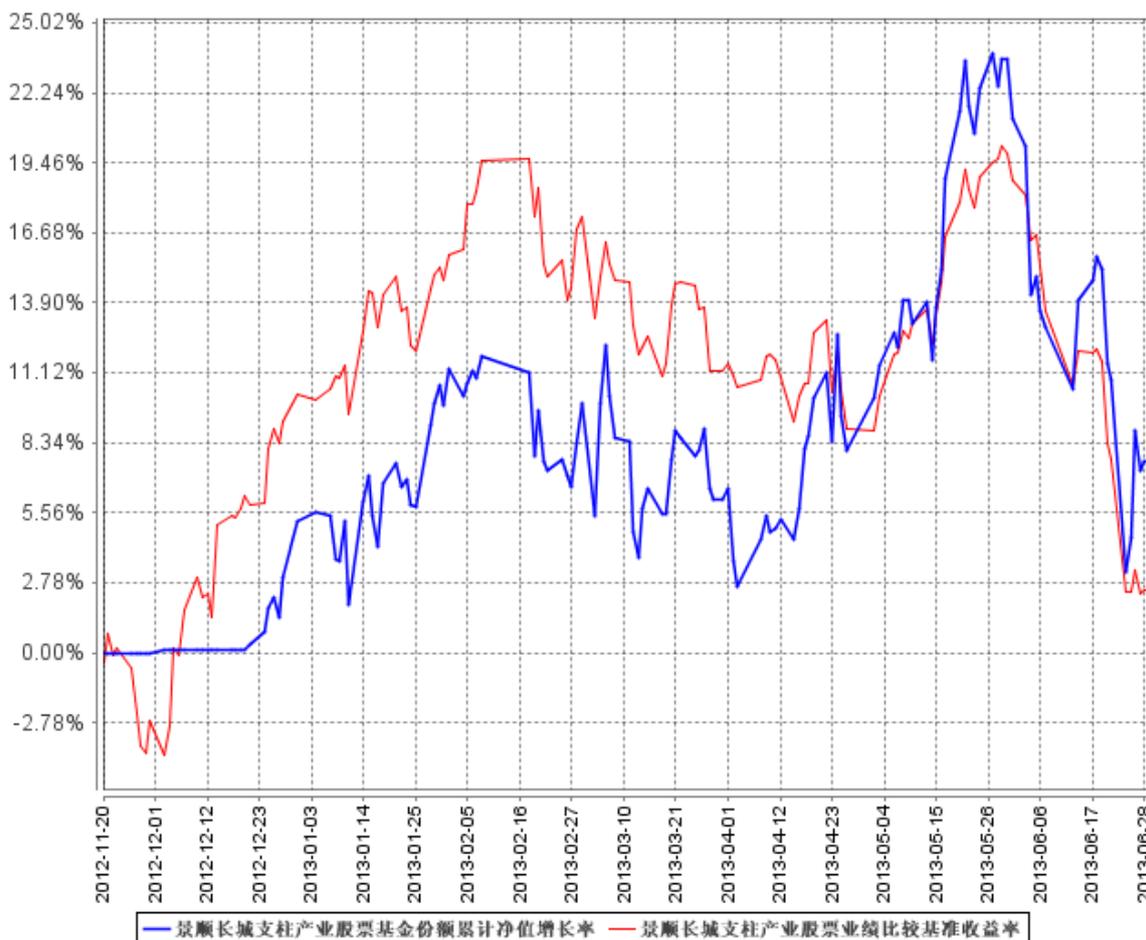
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-11.22%	2.59%	-13.70%	1.49%	2.48%	1.10%
过去三个月	1.41%	1.98%	-7.86%	1.23%	9.27%	0.75%
过去六个月	2.28%	1.82%	-7.04%	1.22%	9.32%	0.60%
自基金合同生效起至今	7.60%	1.64%	2.48%	1.23%	5.12%	0.41%

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：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 60%–95% 投资于股票类资产，其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%；将基金资产的 5%–40% 投资于债券和现金等固定收益类品种，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净

值的 5%；本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金的建仓期为自 2012 年 11 月 20 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。基金合同生效日（2012 年 11 月 20 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 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		

贾殿村	本基金基金经理，研究副总监	2012 年 11 月 20 日	-	11	<p>管理学博士。曾先后担任上海石油交易所交易员，北海国投深圳证券营业部分析师，北亚证券研发部分析师，第一创业证券研究所副所长，大成基金研究部高级研究员等职务。</p> <p>2010 年 3 月加入本公司，担任研究副总监职务；自 2012 年 11 月起担任基金经理。</p>
陈晖	本基金基金经理，景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）基金经理，投资副总监	2012 年 11 月 20 日	-	11	<p>工商管理硕士。曾任职于国信证券，担任理财部行业研究员、投资经理。</p> <p>2005 年 1 月加入本公司，历任研究员、助理基金经理等职务；</p>

					自 2006 年 12 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、《景顺长城支柱产业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

回顾 2013 年上半年国内经济情况，2013 年 1 季度的经济政策对市场影响极大，而且部分经济政策对市场的影响持续至今，如：2012 年 12 月中央军委下发的《中央军委加强自身作风建设十项规定》、2013 年 3 月银监会下发的《关于规范商业银行理财业务投资运作有关问题的通知》，以及抑制投机投资性购房政策的连续出台，持续对 A 股市场造成冲击。同时，2 季度末资金异常紧张，对 A 股市场带来极大的冲击。并导致 6 月份市场的持续下跌。上市公司中传统行业和周期性行业复苏依然非常放缓，盈利不佳，使得资金流向盈利相对稳定的医药股和增长较快的 TMT 板

块。

本基金在 2012 年 12 月底开始建仓，到 2013 年 1 月初逐步建仓完毕，保持相对较高的股票仓位，自下而上选择公司，适当考虑行业配置。在政策的影响下，本基金在 1 季度适当降低了金融、地产、煤炭、有色、工程机械、以及周期性行业配置，逐步加大对医药、消费、汽车、食品、以及电子等成长类股票的配置；2 季度本基金对组合略做调整，重点配置在电子、通信、传媒、电气设备、建筑装饰等行业。

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 2.28%，高于业绩比较基准收益率 9.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年宏观经济延续弱复苏的态势，各项经济数据波动较大，PMI 及出口数据回升幅度明显低于预期，周期性行业 and 传统行业开工率和生产状况显示至少 3 季度制造业情况仍不乐观。随着管理层对规范清理银行理财产品，市场预期社会融资总量增速将继续受到影响。因此，预计下半年经济仍可能维持较弱的复苏态势。经济基本面弱复苏，政策面中性，同时，IPO 可能在下半年开闸，A 股市场预计维持震荡整理的走势。

从上半年市场表现来看指数略微冲高后大幅度回落，以电子、传媒、通信等为代表的成长股表现优异涨幅较大，估值目前偏贵；地产和银行等行业股票随着政策的变化先后出现调整，估值回到底部区域。本基金操作上将保持合理仓位，行业和个股方面重点关注成长性好、符合产业升级、消费升级、具有竞争优势的中上游制造型企业。

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，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

在托管景顺长城支柱产业股票型证券投资基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有

限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《景顺长城支柱产业股票型证券投资基金基金合同》、《景顺长城支柱产业股票型证券投资基金托管协议》的约定，对景顺长城支柱产业股票型证券投资基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城支柱产业股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的景顺长城支柱产业股票型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：景顺长城支柱产业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
资产：			
银行存款		4,824,754.22	27,987,044.15
结算备付金		236,778.35	1,254,545.45
存出保证金		130,370.08	-
交易性金融资产		40,191,057.55	155,314,927.15
其中：股票投资		40,191,057.55	155,314,927.15
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		1,063.39	81,261.39
应收股利		-	-
应收申购款		31,649,452.52	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		77,033,476.11	184,637,778.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
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		2,586,281.46	-
应付赎回款		693,030.78	13,929,162.21
应付管理人报酬		55,863.91	1,045,843.20
应付托管费		9,310.64	174,307.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		113,739.84	145,808.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		180,599.72	52,496.50
负债合计		3,638,826.35	15,347,618.02
所有者权益:			
实收基金		68,189,666.70	160,920,601.70
未分配利润		5,204,983.06	8,369,558.42
所有者权益合计		73,394,649.76	169,290,160.12
负债和所有者权益总计		77,033,476.11	184,637,778.14

注：1、报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 68,189,666.70 份。

2、本基金基金合同生效日 2012 年 11 月 20 日。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城支柱产业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
-----	-----	---------------------------------------

一、收入		6,587,586.23
1.利息收入		33,137.55
其中：存款利息收入		33,137.55
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		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,450,176.84
其中：股票投资收益		11,119,914.33
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		330,262.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,175,366.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		279,638.09
减：二、费用		1,557,347.77
1. 管理人报酬		475,271.12
2. 托管费		79,211.83
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		816,826.55
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		186,038.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,030,238.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,030,238.46

注：本基金基金合同生效日 2012 年 11 月 20 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城支柱产业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	160,920,601.70	8,369,558.42	169,290,160.12

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,030,238.46	5,030,238.46
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)	-92,730,935.00	-8,194,813.82	-100,925,748.82
其中:1.基金申购款	111,814,495.88	10,966,807.95	122,781,303.83
2.基金赎回款	-204,545,430.88	-19,161,621.77	-223,707,052.65
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)	68,189,666.70	5,204,983.06	73,394,649.76

注:本基金基金合同生效日 2012 年 11 月 20 日。

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:

<u>许义明</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城支柱产业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[2012]1191号文《关于核准景顺长城支柱产业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于 2012 年 10 月 22 日至 2012 年 11 月 16 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 60467014_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 11 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 1,092,826,251.12 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 215,918.22 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,093,042,169.34 元,折合 1,093,042,169.34 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,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为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、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金

融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票类资产，其中投资于以制造业为主的支柱产业的股票的资产不低于基金股票资产的 80%；将基金资产的 5%-40%投资于债券和现金等固定收益类品种。其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于权证的比例不超过基金资产净值的 3%。本基金业绩比较基准为：中证中游制造产业指数×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 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

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

配股权证在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零；

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

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其

他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发

行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值。

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配利润的已实现部分占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配利润的未实现部分占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；
- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；
- (7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；
- (8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购证券支出，按融入资金应收或实际收到金额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金分红；
- (2) 每一基金份额享有同等分配权；
- (3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- (5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；
- (6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计需要披露。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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

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
中国农业银行股份有限公司（中国农业银行）	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人股东
大连实德集团有限公司	基金管理人股东

注：本期并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期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

本基金本期无应付关联方的佣金。

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
当期发生的基金应支付的管理费	475,271.12
其中：支付销售机构的客户维护费	171,773.21

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

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资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
当期发生的基金应支付的托管费	79,211.83

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

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

本基金基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

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

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均未投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	4,824,754.22	24,267.27

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期在承销期内未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**

本基金本期末未有因认购新发/增发证券而于期末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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，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	40,191,057.55	52.17
	其中：股票	40,191,057.55	52.17
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	5,061,532.57	6.57
6	其他各项资产	31,780,885.99	41.26
7	合计	77,033,476.11	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	23,993,922.02	32.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,135,827.53	8.36
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	3,803,900.00	5.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,026,350.00	2.76
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	-	-

0	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	4,231,058.00	5.76
S	综合	-	-
	合计	40,191,057.55	54.76

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	002482	广田股份	109,924	2,308,404.00	3.15
2	600885	宏发股份	182,000	2,285,920.00	3.11
3	002310	东方园林	54,957	2,104,303.53	2.87
4	600406	国电南瑞	136,000	2,030,480.00	2.77
5	000671	阳光城	171,000	2,026,350.00	2.76
6	600703	三安光电	100,000	1,964,000.00	2.68
7	300303	聚飞光电	119,916	1,912,660.20	2.61
8	600498	烽火通信	115,000	1,895,200.00	2.58
9	600880	博瑞传播	106,600	1,879,358.00	2.56
10	300026	红日药业	52,599	1,785,210.06	2.43

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	002482	广田股份	4,759,144.41	2.81
2	600739	辽宁成大	4,048,515.65	2.39
3	600062	华润双鹤	3,922,825.00	2.32
4	000826	桑德环境	3,837,351.62	2.27
5	600406	国电南瑞	3,720,151.00	2.20
6	002140	东华科技	3,402,199.34	2.01

7	300251	光线传媒	3,373,186.38	1.99
8	000001	平安银行	3,335,000.00	1.97
9	600067	冠城大通	3,112,038.00	1.84
10	002241	歌尔声学	3,055,599.00	1.80
11	600016	民生银行	3,047,760.00	1.80
12	601166	兴业银行	3,016,978.02	1.78
13	600196	复星医药	2,946,525.00	1.74
14	000049	德赛电池	2,925,666.00	1.73
15	002081	金螳螂	2,907,759.87	1.72
16	601117	中国化学	2,886,584.00	1.71
17	002294	信立泰	2,884,056.00	1.70
18	600801	华新水泥	2,816,127.12	1.66
19	000513	丽珠集团	2,793,653.40	1.65
20	002146	荣盛发展	2,749,207.20	1.62

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	600000	浦发银行	15,233,109.84	9.00
2	601169	北京银行	12,414,306.74	7.33
3	000024	招商地产	11,966,056.55	7.07
4	002146	荣盛发展	10,513,069.74	6.21
5	601328	交通银行	10,063,900.00	5.94
6	600805	悦达投资	9,547,131.69	5.64
7	000776	广发证券	8,905,717.22	5.26
8	600030	中信证券	8,371,523.04	4.95
9	601318	中国平安	7,552,912.13	4.46
10	600266	北京城建	7,054,393.60	4.17
11	000562	宏源证券	6,887,535.79	4.07
12	600348	阳泉煤业	6,572,112.35	3.88
13	000671	阳光城	6,454,951.50	3.81
14	600403	大有能源	5,754,076.00	3.40
15	000926	福星股份	5,477,595.29	3.24
16	300115	长盈精密	5,099,139.00	3.01
17	002244	滨江集团	4,763,636.76	2.81

18	000998	隆平高科	4,420,308.41	2.61
19	002065	东华软件	4,162,606.58	2.46
20	000826	桑德环境	4,069,793.69	2.40
21	000049	德赛电池	4,040,125.20	2.39
22	300251	光线传媒	3,973,893.21	2.35
23	600062	华润双鹤	3,892,437.72	2.30
24	600739	辽宁成大	3,796,866.43	2.24
25	002638	勤上光电	3,774,412.00	2.23
26	002241	歌尔声学	3,603,750.00	2.13
27	002294	信立泰	3,467,776.76	2.05
28	002140	东华科技	3,414,523.69	2.02

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	189,037,717.14
卖出股票收入（成交）总额	310,106,134.82

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

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

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

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

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。

7.10.2

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	130,370.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,063.39
5	应收申购款	31,649,452.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,780,885.99

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

本基金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
1,445	47,190.08	19,767,291.32	28.99%	48,422,375.38	71.01%

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	76,140.05	0.11%

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（2012年11月20日）基金份额总额	1,093,042,169.34
本报告期期初基金份额总额	160,920,601.70
本报告期基金总申购份额	111,814,495.88
减：本报告期基金总赎回份额	204,545,430.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	68,189,666.70

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	
海通证券股份有限公司	1	117,755,922.46	23.59%	107,205.34	23.84%	-
申银万国证券股份有限公司	1	73,126,563.45	14.65%	66,574.70	14.81%	-
平安证券有限责任公司	1	71,097,090.88	14.24%	64,726.88	14.40%	-
光大证券股份有限公司	2	64,791,372.54	12.98%	58,014.93	12.90%	-
中国中投证券	1	50,819,735.52	10.18%	45,154.45	10.04%	-

有限责任公司						
国信证券股份 有限公司	1	46,956,014.92	9.41%	41,551.32	9.24%	-
国盛证券有限 责任公司	1	31,870,251.85	6.38%	28,201.98	6.27%	-
中信证券股份 有限公司	1	26,774,201.14	5.36%	23,692.66	5.27%	-
中国国际金融 有限公司	2	15,952,699.20	3.20%	14,523.36	3.23%	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富里昂证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中邮证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

注：本基金与内需增长基金共用交易单元，本期交易单元无变更。

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
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富里昂证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

景顺长城基金管理有限公司
2013 年 8 月 26 日