## 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;2012年3月28日

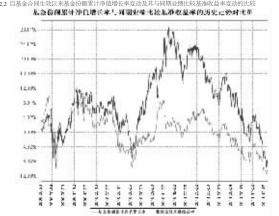
送出日期;2012年3月28日 基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈法或重大遗漏、并对其内容的真实性、准确性 不完整性承担个别及差带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意、并由董事长签处。 基金托官人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年03月22日复核了本报告中的财务指标、净值 表现、利润分层情况、财务会计报告、投资组合报告等内容。保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人求诏以读完信用、勤险尽劳的则则管理和应用基金资产但人作准基金一定组 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更 新

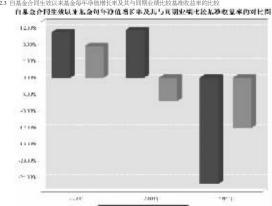
46.6.46.4.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.			§2 基金简介		
2.1 基金基本情况 基金简称			长城景气行业龙头混合		
基金主代码 交易代码			200011		
			200011		
基金运作方式			契约型开放式		
基金合同生效日			2009年6月30日		
基金管理人			长城基金管理有限公司	-	
基金托管人			中国建设银行股份有限公	司	
报告期末基金份额总	以答與		257,450,772.93 份		
基金合同存续期			不定期		
2.2 基金产品说明	j		ナ人 m ぬ次 水紅里 せつい	第34机次工具与在加速运输中与由产	
投资目标			在 古理的 致广配 直 基础上 的 行业中的 龙头上市公司	,通过投资于景气行业或预期景气度向 ,实现基金资产的持续稳定增值。	
投資策略			①大类资产配置额缐、本基金采用 自上而下"和 自下而上",般的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析该观经济、 境、流对性指标等因素。在此基础上综合考虑决定股票市场、 境、流对性指标等因素。在此基础上综合考虑决定股票市场、 场走间的关键因素。自下面上地根据可发股票的基本面和助现 况、对自上而下大类核产配置进行进一步修正。②则每行少处别。 金将结合宏观经济分析结果、运用长城基金融气产业评价体系》 关经济特益行定性知证是分析、以选择全口服务济环境, 全部结合宏观经济分析结果。运用长城基金融气产业评价体系》 关经济特益行定性知证是分析。以选择全口服务济环境, 较高的行动性为股票资产股密管面。。⑥个股投资策略。本基 80%以上的股票资产投资下最气行业或和服务上的原分所分, 发头企业。分享聚气行业成长收益。此外,以不高于 20%的股票行 头以外要需的超额收益。⑥情经投资策略。当股票市场投资研入 不确定性操力。本基金特料和图部分资产或无性,我取量市场投资研入 不确定性操力。本基金特料和图部分资产转换为情参资产。或 参与一级股票市场 佛学市场交易获取风险收益、以此降低基 合资产风险水平。⑤现金管理、本基金特和银行存款。因此降低基 等一级股票市场、佛学市场交易获取低风险收益、以此降低基 等一级股票市场、佛学市场交易获取低风险收益、以此降低基 等一级股票市场、佛学市场交易获取低风险收益,以此降低基 等一级股票市场、佛学市场交易获取低风险收益,以此降低基 少等一级股票市场、佛学市场交易获取取风险。 参与一级股票市场、佛学市场交易获取取风险。 参与一级股票市场、佛学市场交易获取取风险。 为是一级股票的,是一级股票的现金分量, 少少企业,是一级企业企业。如服发到期上在一年以内的股票的事情, 现金是一个人工作, 现金是一个人工作, 为是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个		
业绩比较基准			55%x沪深 300 指数收益率+45%x中债总财富指数收益率。		
风险收益特征				本基金为混合型基金,长期平均风险和预期收益率高于债券型基 货币市场基金,低干股票型基金,为中高风险,中高收益产品。	
风险收益特征			1		
风险収益特征 2.3 基金管理人和	基金托管人				
			基金管理人	基金托管人	
2.3 基金管理人和		长	基金管理人 成基金管理有限公司	基金托管人中国建设银行股份有限公司	
2.3 基金管理人和		枌			
2.3 基金管理人和	E	H	成基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
2.3 基金管理人和 项 名称	姓名		成基金管理有限公司 车君	中国建设银行股份有限公司 尹东	

田路 6009 号新世界商务中心 41 层 §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年6月30日-2009年 12月31日
本期已实现收益	-6,185,734.89	94,191,030.89	51,351,002.00
本期利润	-82,631,491.84	37,983,232.67	145,020,768.87
加权平均基金份额本期利润	-0.2997	0.0837	0.1041
本期基金份额净值增长率	-25.54%	11.53%	11.00%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0983	0.2376	0.0584
期末基金资产净值	232,152,475.49	374,363,509.14	709,165,505.20
期末基金份额净值	0.902	1.238	1.110

	3.2 基金伊恒: 3.2.1 基金份額	<sup>灰现</sup> 顺争值增长率及其	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
Ì	过去三个月	-7.68%	1.13%	-3.28%	0.77%	-4.40%	0.36
	过去六个月	-18.22%	1.08%	-11.30%	0.74%	-6.92%	0.34
	过去一年	-25.54%	1.02%	-12.02%	0.72%	-13.52%	0.30
	过去三年	-	-	-	-	-	
	过去五年	-	-	-	-	-	





注:合同生效当年校实际存续期计算、不按整个自然年度进行折算。 3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	0.250	5,446,953.46	1,462,163.15	6,909,116.61	
2010	-	-	-	-	
2009	-	-	-	-	
合计	0.250	5,446,953.46	1,462,163.15	6,909,116.61	

4.1.	2 基金经埋 (成基金%	台埋小组 )及3	5金经埋	助理简介	•	
加力	性名 职务 任本基金的理 助理 》		基金经 期限	证券从	说明	
XEAD	RV95	任职日期	离任 日期	业年限	19097	
蒋 劲	型证券投资基金基金经理		-	13年	男,中国籍、天港大学材料系工学学士、天港大学管理学院工学 商士、曾被即于深圳市华乡技术有股公司、海南富岛农产营 有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司,历任运行 保障部交易室交易员、交易主管、研究部行业研究员、机构理财 前投资经理。	
注:	<ul><li>①上述任职日期、离任</li></ul>				免日期填写。	
②证券从业年限的计算方式游从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。						

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会 任券业从业人员常格管理办法 約何程关规定。 ③自 2012 年 3 月 7 日 43 森勃刚不再相任吃城青费基金的基金经理。该事项已在中国证券业协会办理变更手续,并于 2012 年 3 月 8 日在中国证券税、上海证券税、证券时报予以披露。 4.2 管理人对报告期内本基金运价递规守信情况的论则 本报告期内、本基金管理人严极遵守了 他券投资基金法)、长城最气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金基金合同》 有人谋求最大的对益、未知规定设施反应保证是从基金合同分配产和关规定的信息、无因公司来则是不要规定与规律 基金财产损失的情况、不存任期苦基份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准 的指己、本基金管理人在规定的企理期限内进行了100条。有效他保护了基金持有人利益。 4.3 管理人对报告期内公平交易信息的专项说明 4.3 管理人对报告期内公平交易信息的专项说明

4.3 官址人別依台別仍公平交易同心的专项规则 4.3 1公平交易制度的执行信息 本报告期本基金管理上一格遵守了公平交易管理制度的规定。各基金在研究支持。投资决策上享有公平的机会。 公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序。保证各基金获得了公平的交易机会。 4.3. 本接资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本基金通过投资于最气行业或预期最气度向好的行业中的龙头上市公司,以实现基金资产的持续稳定增值,投资风格与 销量理的其他投资组合不相同。

## 长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金

## 2011 年度 报告摘要

我们。第一位值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 信值委员会来承基始特人利益至上的宗旨。在信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、不易辨别。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 本基金管理人尚未被没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。 4.7 管理人对报告期收基金和间分值指的说明 根据 使城堡气行业龙头灵活度置混合型证券投资基金基金合同)关于收益分配原则的规定。本基金每年收益分配次数 最多为6、农业收益分配比例不得依于截止收益分量基相目可供分配利润的10%。基金收益分配后基金份额净值不能低于 本基金于2011年4月27日进行了收益分配、收益分配万条为每10份基金份额派发红利。25元、共派发红利。5999。

服务为6次、强次败应为能比例,各限计一截止败运约虚基准日可供为他利润的10%。基金收益分配归基金份额净值、格能计面值。 本基金于2011年4月27日进行了收益分配、收益分配方案为每10份基金份额派处红利0.25元,共派发红利6.909。11661元。收益分配方案发来拖均符合基金合词关于收益分配的各项规定。 截至2011年12月31日、本基金可供分配利润为-25.298,297.41元,不进行平度收益分配。 55.1程告期内本基金托管人遗规守信辖尼声明 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 55.42条形成 56.42条形成 56.42系形成 56.42条形成 56.42系形成 56.42系形成

N存任虛擬に就、读等性除处配名 重大應編。 \$6 审计报告 安永年明会计师事务所为本基金出具了标准无保留度起的审计报告,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

		-1-det-1-	单位:人民
资产	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		71,242,730.37	91,914,218.0
结算备付金		318,285.49	562,490.
存出保证金		-	28,064.
交易性金融资产		161,122,574.07	283,360,430.
其中:股票投资		161,122,574.07	283,360,430.
基金投资		-	
债券投资		-	
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产		_	
应收证券清算款		_	
应收利息		15,954.79	21,026.
应收股利		_	
应收申购款		11,373.18	242,110.
递延所得税资产		_	
其他资产		_	
资产总计		232,710,917.90	376,128,341.
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010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		-	
应付赎回款		40,557.06	819,063.
应付管理人报酬		307,066.74	481,491.
应付托管费		51,177.83	80,248.
应付销售服务费		_	
应付交易费用		95,062.49	316,855.
应交税费		_	
应付利息		-	
应付利润		_	
递延所得税负债		_	
其他负债		64,578.29	67,172
负债合计		558,442.41	1,764,831.
所有者权益:			
实收基金	+ +	257,450,772.93	302,497,615.
未分配利润	+	-25,298,297.44	71,865,894
所有者权益合计	+	232,152,475.49	374,363,509.
负债和所有者权益总计	+	232,710,917.90	376,128,341.

会计主体:长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金 本报告期: 2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年 12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 12月31日
一、收人		-76,191,306.11	48,827,181.41
1.利息收入		627,523.00	953,627.45
其中:存款利息收入		573,873.67	953,627.45
债券利息收入		35.15	-
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收人		53,614.18	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益 假失以""填列)		-467,107.00	103,553,588.31
其中:股票投资收益		-2,179,153.91	100,492,272.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益		32,047.40	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,679,999.51	3,061,316.16
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)		-76,445,756.95	-56,207,798.22
4.汇兑收益 假失以""号填列)		-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)		94,034.84	527,763.87
减:二、费用		6,440,185.73	10,843,948.74
1.管理人报酬		4,561,502.99	7,404,899.55
2.托管费		760,250.42	1,234,149.98
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		736,902.80	1,821,433.70
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		381,529.52	383,465.51
三、利润总额		-82,631,491.84	37,983,232.67
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以""号填列)		-82,631,491.84	37,983,232.67

7.3 所有者权益 協並伸信 度切表 会计主体:长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日 至 20	, 12/131		单位:人民币:			
项目	本期 2011年1月1日至2011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 甚金净值)	302,497,615.06	71,865,894.08	374,363,509.14			
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期利润)	-	-82,631,491.84	-82,631,491.84			
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)	-45,046,842.13	-7,623,583.07	-52,670,425.20			
其中:1.基金申购款	53,298,279.59	8,300,234.56	61,598,514.15			
2.基金赎回款	-98,345,121.72	-15,923,817.63	-114,268,939.35			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动 停值 减少以""号填列)	-	-6,909,116.61	-6,909,116.61			
五、期末所有者权益 甚金净值)	257,450,772.93	-25,298,297.44	232,152,475.49			
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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 偡金净值)	639,147,835.12	70,017,670.08	709,165,505.20			
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期利润)	-	37,983,232.67	37,983,232.67			
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数 (浄值减少以 ""号填列)	-336,650,220.06	-36,135,008.67	-372,785,228.73			
其中:1.基金申购款	145,079,134.82	21,293,876.18	166,373,011.00			
2.基金赎回款	-481,729,354.88	-57,428,884.85	-539,158,239.73			
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 偡金净值)	302,497,615.06	71,865,894.08	374,363,509.14			
报表附注为财务报表的组成部分。						

\_\_\_\_桑煜\_\_\_ 会计机构负责人

7.4 甘浸附注
7.4 甘浸附注
7.4 甘浸酸基本情况
长坡层《行业文头灵活配置混合型证券投资基金(以下简称 本基金"原经中国证券监督管理委员会(以下简称 中国证实分)证监计中 2000 18.6 号文 统于核准长坡层《行业龙头灵活配置混合型证券投资基金聚集的批复 海线相。由长坡基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行容集。本基金的基金台目于2000 年 6 月 30 日正式生效。本基金首次设立募集的機为 1.644.61.72260 份基金份额。本基金的规划的基本分量一2000 年 6 月 30 日正式生效。本基金首次设立募集的规划为上线成金管理有限公司,基金任管人为中国建设银行股份有限公司(中国建设银行》,这一股市发生人成立。资产支持证券以及法律法建设中国证监会允许基金投资的其他金融工具。包括国内依据分下的股票,债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法建设中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基本为:55%公产家 300 指数收益率445%。中国他员民营业务公司

证券以及任何还规以"目即证益之"几十基定校议的具他觉施工单。李基室业即汇求处布也7;35%20"年 300 借款以益年·45%3年 (税)财富指数证益率。 7.42 会计报表的编制基础 本财务报表者按照中国的政策 2006 年 2 月颁布的 企业会计准则一基本准则为 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 "福制、同时,对于在具体会计核资和信息披露方面,也参考了中国证 参业协会制定的 免券校基金会计核源业务部分,中国证金金和定的 经产进一步规定证券投资基金值值业务的指导意 见》、经于证券投资基金估定规据的等与核工作则,估值业务及份额价值计价有关事项的通知》、征券投资基金值是股富管理办 2.5、征券投资基金信息规据和股则第 3 号 会计报基附注的编制及披露》、征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科关规定。

布的相关规定。 本财务报表以本基金持续经营为基础列报。 7.43 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经

以单边使叶色中间加强取双环增加超级取不大了对UII如《工产型取代代社》,是《加速的不可以知》 2 营业税,企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税学 2004 78 号文 佚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 假闭式证券投资基金,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,维续免证营业税和

根据财政部。国家民务运取财场产上9000月107分。 月13日品、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 1102 号文规定,扣缴又多人在代和口源了人所得税时,减按 50%计算应纳税所得额: 从所得税时,减按 50%计算应纳税所得额: 被撤财政部。国家税务总局财税学 2003 1103 号文 俟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 改革中非流通股投充通过对价方式间流通股股东支付的股份,现金等收入。曾免证改流通股股东应遗纳的个人所得税。 根据财政部、国家股务总局财税 2008 132 号 载政部国家股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。

关联方名称 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

金额单位:人民币元 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日 本期 2011年1月1日至2011年12月31日 占当期股票 成交总额的比例 成交金额 成交金额

12,137,558.80 31,266,163.57 6.66% 1.11%

74.8.1.2 债券交易 注: 本基金本朝及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易 注: 本基金本朝及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。 74.8.1.3 传说是一个人,但是一个人,但是一个人,但是一个人, 注: 本基金本朝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。 74.8.1.5 促进行联方的例象

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日					
A4A/J 4000	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额			
Let I have do						

	自知 佣金	量的比例	期末应付佣金余额	总额的比例 总额的比例
长城证券	26,576.04	6.77%		-
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010年 12 月 31 日				
大駅刀右你	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
东方证券	30,195.36	3.29%		-
长城证券	9,861.77	1.08%	-	-
注:上述佣金按市场佣金率计算.扣除券商需求担的费用.包括但不限于买.做. 羟手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买.使. 证管费等)。				

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.0.2.1 巫並日/王贝		单位:人民币元
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理 费	4,561,502.99	7,404,899.55
其中:支付销售机构的客户维护 费	912,968.42	1,447,281.60

1 | 肯,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-

		単位:人民市π
项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管 费	760,250.42	1,234,149.98
注 甘春红篇典控前二日的甘	今次立為体的 o see 的任弗索斗坦 斗管:	E → In T

注:基金托管教授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=500.25%当年天教 H 为每日应文付的基金统产净值 E 为前一日的基金统产净值 基金托管费但 计算。逐日 聚计至每月月底,按月支付;由基金托管 大于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 恰回购 改易 注:本基金本期及上年度可比例则以本与关联方进行银行间同业市场的债券 恰回购 )交易。 7.4.8.4 老关联方投资本基金的情况 7.4.8.4 报告期对基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金,于本期未及上年度末均未持有本基份额。

74.8.4.2 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 2 MANACOM LAM ATLAMENTALE TAMES FEET TO THE TO THE TENT TO THE T

7.4.8.5 由关	联方保管的银行存款	会额及当期产生的利息收入	( CANATHABEDING	单位:人民币元
关联方 名称		本期 至 2011 年 12 月 31 日	上年度可 2010年1月1日至 20	
石竹	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

全标 期末余額 当期利息收入 期末余額 当期利息收入 用末余額 当期利息收入 中国建设银行 7.1.24.7.70.37 第7.0.00.91 91.914.218.66 949.792.72 注:本基金价银行存款由基金柱管人中国建设银行保管,并按银行间原业利率计息。 7.4.8.6 本基金企业员上年度中代期间均未不涂割即内省接购人头联方承销的证券。 7.4.9 期末 (2011 年 12 月 31 日 本基金体有的流通受限证券 7.4.9 期末 (2011 年 12 月 31 日 本基金体有的流通受限证券 12.1.4 基金未有国认购新发给股业寿和于期末持有流通受限证券 12.1.4 基金未有国认购新发给股业寿和于期末持有流通受限的证券。 7.4.9.2 期末均均1291特别等为企业股票 12.1.4 基金从市团的设置分别未发现的企业股票。 7.4.9.3 期末债券证则收货为中价未完全股票。 7.4.9.3 期末债券正则收货为中价未完全股票。 7.4.9.3 期末债券正则收货为中价,对抵押的债券 7.4.9.3.2 交易所市场债券正则购 12.1 日 12 月 31 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 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 12.1 日 12 月 31 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

§8 投资组合报告

序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	161,122,574.07	69.24
	其中:股票	161,122,574.07	69.24
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
5	银行存款和结算备付金合计	71,561,015.86	30.75
6	其他各项资产	27,327.97	0.01
7	合计	232,710,917.90	100.00

A	农、林、牧、渔业	-	
В	采掘业	15,796,289.70	6.80
С	制造业	85,630,719.23	36.89
C0	食品、饮料	29,638,800.00	12.77
C1	纺织、服装、皮毛	1,776,000.00	0.77
C2	木材、家具	-	
C3	造纸、印刷	-	
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,004,000.00	1.72
C5	电子	8,150,900.00	3.51
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	28,149,894.73	12.13
C8	医药、生物制品	13,911,124.50	5.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	28,547,953.14	12.30
Н	批发和零售贸易	2,325,000.00	1.00
I	金融、保险业	15,358,664.00	6.62
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,921,100.00	1.26
L	传播与文化产业	10,542,848.00	4.54
M	综合类	-	-
П	合计	161,122,574.07	69.40

序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比例 %)
1	600519	贵州茅台	116,000	22,422,800.00	9.66
2	601169	北京银行	1,083,800	10,057,664.00	4.33
3	600288	大恒科技	1,350,000	7,965,000.00	3.43
4	000858	五粮液	220,000	7,216,000.00	3.11
5	002152	广电运通	300,585	6,988,601.25	3.01
6	002417	三元达	440,400	6,244,872.00	2.69
7	600880	博瑞传播	499,020	6,187,848.00	2.67
8	600557	康缘药业	395,950	5,824,424.50	2.51
9	000513	丽珠集团	270,000	5,524,200.00	2.38
10	600016	民生银行	900,000	5,301,000.00	2.28
注:投	资者欲了解本	设告期末基金投资	答的所有股票明细,应阅	读夸载于本基金管理人网站 (www.	ccfund.com.cn )的年度指

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

持中	序号	股票代码	股票名称	本期累计头人金额	(%)
÷	1	000400	许继电气	13,652,643.00	3.65
	2	601169	北京银行	13,352,243.89	3.57
用	3	002152	广电运通	10,013,711.30	2.67
HE.	4	002417	三元达	9,918,179.82	2.65
证意办号颁	5	600188	兖州煤业	9,019,569.29	2.41
新	6	600507	方大特钢	8,808,815.30	2.35
	7	600288	大恒科技	7,844,598.00	2.10
	8	600295	鄂尔多斯	7,396,012.36	1.98
经	9	600036	招商银行	7,172,680.91	1.92
	10	600761	安徽合力	6,651,432.70	1.78
	11	000780	平庄能源	6,593,484.75	1.76
	12	600169	太原重工	6,430,727.76	1.72
	13	601088	中国神华	5,877,377.19	1.57
	14	601601	中国太保	5,592,500.00	1.49
%о	15	600048	保利地产	5,442,404.00	1.45
繳	16	600360	华微电子	5,293,184.99	1.41
T	17	600271	航天信息	5,181,150.70	1.38
	18	601168	西部矿业	5,052,683.00	1.35
-1	19	000969	安泰科技	4,819,317.00	1.29
对 和	20	600016	民生银行	4,790,008.85	1.28

注:买人金额按买卖成交金额 钺交单价乘以成交数量 填列,不考虑相关交易费用。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

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	000568	泸州老窖	13,004,892.00	3.4
2	600517	置信电气	12,339,869.63	3.3
3	600741	华城汽车	12,160,958.36	3.2
4	600386	北巴传媒	10,216,232.99	2.7
5	600664	哈药股份	10,130,015.33	2.7
6	601168	西部矿业	9,981,123.87	2.6
7	600176	中国玻纤	9,789,508.88	2.6
8	601766	中国南车	9,773,585.96	2.6
9	000869	张裕A	9,153,248.00	2.4
10	002024	苏宁电器	8,934,153.40	2.3
11	600519	贵州茅台	8,698,683.02	2.3
12	002146	荣盛发展	7,575,149.74	2.0
13	000402	金融街	7,260,065.35	1.9
14	002123	荣信股份	7,082,035.11	1.8
15	600415	小商品城	7,040,057.00	1.8
16	600169	太原重工	6,448,503.00	1.7
17	601607	上海医药	6,327,969.80	1.6
18	600360	华微电子	6,038,377.00	1.6
19	600036	招商银行	5,983,000.00	1.6
20	600276	恒瑞医药	5,890,317.17	1.5

往: 实出金额按头卖成交金额 域交单扩架以成交 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额	
买人股票成本 绒交 )总额	212,961,336.98
赤山肌 两位 1 66次 1台鄉	256 574 392 22

及此票或水 饭交 起烟

21.7901.350.98

类出股票则及 截交 处照

25.574.282.33

注:某人股票原本和卖出股票收入均按买卖成交金额 使交单价乘以成交数量 填列,不考虑相关交易费用。
8.5 期末按债券品户分类的债券投资组合
注:基基金水程告期末未持有债势。
8.6 期末按公全价值占基金资产增租比例大小排半的前有资产支持证券投资明细
注:基基金水程告期末未持有债势。
8.7 期末按公全价值占基金资产增租比例大小排半的前有资产支持证券投资明细
注:基基金水程告期末未持有信贷。 为转证券。
8.8 期末按公全价值占基金资产增租比例大小排半的前有资产支持证券投资明细
注:本基金水程告期末未持有保证。
8.9 投资组合报告附注
8.9.1 本程告期本本特年联定。
8.9 投资组合报告附注
8.9.1 本程告期本本特定联定。
8.9 投资组合报告附注
8.9.1 本程序制本基金投资的前十名证券除五粮液发行主体外,其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在程告期末和是购本基金投资的前十名证券除五粮液发行主体外,其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在程告期本指数股份有限之可到12.011年5月28日发布 关于收到中国证监会 行政处罚决定书的公告"、监管机构认定公司在信息披露方面存在进法事实,并对公司和相关部营入员处以警告和训款。
本基金经型价记从五 在被是一条具有长期投资价值的优质公司,该处罚不影响公司的长期投资价值,而且公司估值水平相以具有一定的吸引力。本基金经型依据基金合同和公司投资管理制度,在投资投权范围内,经正常投资决策程序在较低价格区域无程粮被进行了投资。
8.9.2 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。
8.9.2 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。
8.9.3 期末其他各项资产构成

	7777034707777	单位:人民币
序号	名称	金額
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,954.79
5	应收申购款	11,373.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,327.97
904	<b>## 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 </b>	

894期末持有约处于持股期的可转换债券即拥注。本基金本报告期末持有处于持股期的可转换债券。
89.5期末前十名股票中存在流通受限信息的说明注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
89.6投货组长路附注的其他文字描述部分。
注:由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
91期末基金份额持有人广数及持有人结构

机构投资者 持有份额

项目	持有份额总数 (分)		占基金总份额比例	
基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	2,48	33.38	0.0010%	
	§10 开放式基金份额变动			
			单位:份	
基金合同生效日 (2009年6月30日)基金份额总额		1,964,631,732.69		
本报告期期初基金份额总额 302		302,497,615.06		
本报告期基金总申购份额 53.2		53,298,279.59		
减:本报告期基金总赎回份额		98,345,121.		
本报告期基金拆分变动份额				
本报告期期末基金份额总额			257,450,772.93	

§11 重大事件揭示

5、日间对李德盛证院中时成为约支柱可学习为7/2次小于7次的不力为7/2次。 持续至本报任期,管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。 本基金本报任期基金管理人,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。 11.7 基金相用证券公司交易单元的有关指放。 11.7 基金相用证券公司交易单元的有关指放。

	-A- H-A4 94	収力	(父勿	<b>应又</b> (1) (1) (2)	同的知识证	
券商名称	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
长江证券	1	94,899,767.51	20.21%	77,106.50	19.64%	-
中投证券	2	66,122,042.70	14.08%	56,203.53	14.32%	-
东兴证券	1	44,087,248.92	9.39%	37,473.71	9.55%	-
中信证券	1	40,668,637.50	8.66%	34,568.08	8.81%	-
国金证券	1	37,848,109.02	8.06%	30,751.92	7.83%	-
首创证券	1	37,813,273.75	8.05%	32,140.79	8.19%	-
渤海证券	1	32,125,418.08	6.84%	27,306.32	6.96%	-
长城证券	2	31,266,163.57	6.66%	26,576.04	6.77%	-
平安证券	2	27,406,362.16	5.84%	22,831.74	5.82%	-
安信证券	1	24,170,736.35	5.15%	20,544.90	5.23%	-
华融证券	1	21,248,997.29	4.53%	17,264.82	4.40%	-
银河证券	2	7,328,110.46	1.56%	5,954.41	1.52%	-
民生证券	1	4,550,752.00	0.97%	3,868.02	0.99%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中银万国	1	-	_	-	_	_

注:1.报告期内租用证券公司交易里元的变更情况: 报告期内共新增3个专用交易单元 陈兴证券、天源证券、华融证券各新增1个交易单元),截止本报告期末共计35个交

長元。

2、专用交易单元的选择标准和程序
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单元,选择的标准是:
0 漢方地學,信德提供,注册资本不少于3亿元人民币;
0 斯会於民县4、各项财务排除显示公司经营我况稳定;
0 影管方方規范,最近两年未发生重大违规行方而受到中国证监会处罚;
6 财富管理股产,作 具条配金的作物限,并能调足基金运作高度保密的要求;
6 J俱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与自服各。

6 ) 供商企业定江中所需的场景、支生的进口条件、公局设施付管气理平金速速行证券交易的需要、开能为平金速速供差回的信息服务。 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、收收分析报告及其他专门报告。 行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。 根据上选标准考察附后,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 构买卖证券的放交流。支付的佣金等气收整。 11.72 基金租用证券公司交易年元进行其他证券投资的情况

	债券	交易	债券回则	勾交易	权证3	2易
券商名称	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金額	占当期权证 成交总额的比 例
长江证券	137,582.55	100.00%	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	50,000,000.00	62.50%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	ı	-	-	-	-
海通证券	-	1	-	-	-	-
中信建投	-	1	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	1	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	1	30,000,000.00	37.50%	-	-