金额单位:人民币元

# 

### 基金管理人:长盛基金管理有限公司基金托管人:中国银行股份有限公司送出日期:2013年3月26日

### § 1 重要提示及目录

\$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度假记载,误导性陈达或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性整性生化引发走带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字间意,并由重事长签发。 
整整字程件引发走带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字间意,并由重事长签发。 
未金允管人中国银币股份有限公司银格本基金自制统正,于2013年3月25日夏核了本报告中的财务指标。净值表现、利润信成、别多会计报告,投资组合报告纳存等。保证复核内参不存在建假记载,误导性陈述或者重大遗漏。 
基金管理人家和以政实信用、勤助尽费的规则管理和应用基金资产,但不停证是一定盈利。 
基金管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计细阅读本基金的招募说明书及其更新。 
本年度报告财务营转已经审计,普华永道中天会计师事多所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。 
本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。 
\$2 基金简介

2.1 基金基本情况		32 至亚间月
基金简称		长盛环球行业股票 (QDII )
基金主代码		080006
交易代码		080006
基金运作方式		契约型开放式
基金合同生效日		2010年5月26日
基金管理人		长盛基金管理有限公司
基金托管人		中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额		57,417,671.25(f)
基金合同存续期		不定期
2.2 基金产品说明		
投资目标	于其中的优势公司	全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资 ,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上, 化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	用Black-Litterman	构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运 资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选 及资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大	盘股指数 MSCI World Large Cap Index )
	-Little A VI BB 300 WALLE	A REAGULATION OF A COMPANY AND A SHEAR FROM THE ANALYSIS

	资国家与	也区市场的分散,风险低于投资单一	市场的股票型基金。
2.3 基金管理人和	基金托管人		
项	∃	基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
	姓名	叶金松	唐州徽
信息披露负责人	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
<b>生</b> 害		010 92255099	010 66504042

专具	010-82233988		010-00394942
2.4 境:	外投资顾问	可和境外资产托管人	•
IJ	ijΗ	境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任合伙	中国银行(香港)有限公司
注册地址	•	200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中2号长江集团中心68 楼	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-
2.5 信.	息披露方式	5	
WARRANT A	Averaged Land Advance	re 1.64-Advers 1 result/ regions 1	

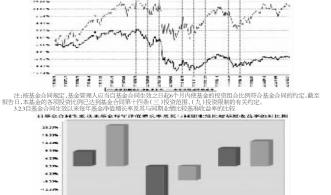
### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1.1期间数据和指标	2012年	2011年	2010年5月26日(基金合同 生效日)-2010年12月31日
本期已实现收益	-2,757,360.06	-5,494,859.86	4,801,704.21
本期利润	4,673,780.31	-12,998,244.05	10,129,599.50
加权平均基金份额本期利润	0.0781	-0.2035	0.0552
本期基金份额净值增长率	9.17%	-21.39%	7.60%
3.1.2期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1227	-0.1930	0.0582
期末基金资产净值	50,562,837.75	54,865,177.32	81,004,766.33
期末基金份额净值	0.881	0.807	1.076

注:1.所述基金业绩指标不包括特有人认购或交易基金的各项费用;计人费用后实际收益水平要低于所列数字。 2.本期已实现收益指基金本期利值收入,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。 3.期末可快分配利润,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。表中的"期末"均指本 报告期最后一日,即12月31日。 3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率	区及其与同期	业绩比较基准收益	监率的比较			
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	0.69%	0.45%	1.73%	0.72%	-1.04%	-0.27%
过去六个月	5.26%	0.52%	7.91%	0.77%	-2.65%	-0.25%
过去一年	9.17%	0.60%	12.98%	0.85%	-3.81%	-0.25%
自基金合同生效起至今	-7.66%	0.73%	26.72%	1.14%	-34.38%	-0.41%
注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:						

实理院文化选准=摩根與取利世界大震波中接受指数(MSCI World Large Cap IMI Index )x 100%(以)。同两MSCI世界 本基金为股票型基金,主要投资范围为全球主要发达地区股票市场、危速股票,在综合比较目前市场上各主要指数的编 海上将场本基金股票组合的投资标约之后运取上述指数 摩根斯坦利世界大震波中报资指数是波照目由流通市值调整方法编制的服务会取成熟市场的会球性投资指数,是MSCI 储化物发之,适合作为全球市政党建业销处资格的指数。全球超过500%的基金经理人,是以MSCIBARRA精制的指数件 投资额灾评估的标准。在全球范围内,MSCI世界指数已经成为全球市场发资工具的基本库下之一,并且由MSCIBARRA标 市市场发布,截至2010年12月,建模斯坦利世界大震使可投资情效能盖2个1四联和区的超过70只投票,代表了全球国家 约75%的总市值,与本基金上型投资方向比较购合。 MSCI世界指数件本覆盖了与国际会已经签定合作运解各忘录的主要国家,并为许多国际著名股票投资基金选用为投资 按基准,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性,市场代表性。用为简准本基金业额的基本比较合适。 本基金的股票价产出金资产的60%—59%。在工资的市场情况,基金的平均需要(已约为85%,所以、业绩基本中的这 资产低置比例可以反映本基金的风险优益特征。



150	示存续期计算	,未按整个自然年度	對行算。	金基金合同于2010年5	月26日生效,合同生	<b>上效当年净值增长率按照</b>
ĺ	3.3 过去: 年度	三年基金的利润分配 每10份基金份额	2情况 现金形式发放总额	再投资形式发放总	年度利润分配合	各注
	2012年	分红数 _	-	<b>2</b> 00	<b>计</b>	2012年度未分配收益
	2011年	0.500	3,423,031.64	261,335.34	3,684,366.98	2011年1月12日收益分配
	2010年	-	-	-	-	2010年度未分配收益
	合计	0.500	3,423,031.64	261,335.34	3,684,366.98	
	44 #A	Marcol A to the architecture	§. ao⊓	4 管理人报告		

\$4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1. 基金管理人及基金经理情况
4.1. 基金管理人及其管理基金的经验
本基金管理人及其管理基金的经验
本基金管理人及其管理基金的经验
本基金管理人及其管理基金的经验
东基金管理人及其管理基金的经验
统定及其出贸计例为。18万证券股份有限公司(以下简称"国元证券")占在册资本的41%。前加速是原银行有限公司(以下简称"国元证券")占在册资本的41%。前加速是原银行有限公司占法则依由33%。按量合理用保集的信息的是有限分司。
"金融"及第合服务的是一个企业,在19条件,全部企业,在19条件,19条件,19条件,在19条件,在19

姓名	职务	任本基金的基金	於经理期限	证券从业	说明
X±/c	85/35	任职日期	离任日期	年限	1909/1
吴达	本基金基金经理,长盛积极配筹 理,长盛积极配筹 置债券基金基金基 经理,国际业务 部总监。	2010年5月26日	_	10年	男,1979年8月出生,中国国籍《党敦武治经济学院金融经济学师、CFA 使调整符令通告符师》,历任新加坡星展营产管重有限公司研究员星展珊瑚、史敦、盆基金经理师里 星用将各金经里,专户投资组合经理,新加坡市临高家营产管理公司亚大专户投资组合经理,新加坡市临高家员会或员,建立金经理有限公司国际策略分析师,固定收益投资经理;2007年8月起加入该基金管理所及公司,现任同职业务部总统,长盛环晚降近前师务型证券投资基金基金经理,长盛环境等气行业大流精造股票型证券投资基金基金经理,长盛环境等气行业大流精造股票型证券投资基金基金经理,长盛环境等气行业大流精造股票型证券投资基金基金经理,长盛环境等气行业大流精造股票型证券投资基金基金经理,长盛环境等气行业大流精造股票型证券投资基金基金经理,长
					任日期和解聘日期;
2、"证券	从业年限"中"证	券从业"的含义进	纵行业协会	《证券业从	业人员资格管理办法》的相关规定等。

	Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。		算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯 巴尼·希尔森公司。1994年加入高盛 资产管理,曾负责美国国内及国际党 资组合的建立及风险分析,并实施不 同的交易策略。
--	-----------	--------------------------------------	--	--

4.3 管理人对报告期内本基金室作遵规守信情况的设用 本报告期内。本基金管理人严核按照《证券投资基金法》及其各项实施律则《长感环球景气行业大盘精选股票型基金基金合同》和证析有关法使法规,监管部门的特民规定,依附该实信用、勤勉定者的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上、为基金份额持有人谋求最大利益。没有损害基金份额持有人利益的行为。
4.4 管理人对指告期内公平之易情况的专项规则。
4.4 管理人对指告期内公平之易情况的专项规则。
4.4 (公平支易制度和控制方法
(张慎《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益。公司重新能订了《公公平交易制度指导的》,报告期内。公司根据该细则实际投行情况、对基在行了完善。该细则从研究、投资投权、投资决策、交易执行、投资组合信息網离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环下对公平交易的管理提出明高继定。

投資級、投資政策、交易抗行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息被离等外节对公平交易的宣單短凹的 需要,将支持、公司旅厂所有股份组合土等公司所分部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等较限。 特定支持、公司旅厂投资决塞自会编等。下的技管组合各型配合额,是约翰·各型理在公司研究平台上拥有同等较限。 按据权工法策、公司家厅提中发展的使用。 交易执行、公司家厅集中安島市度,所有收敛组合的投资协会。 安热析、公司家厅集中安島市度,所有收敛组合的投资协会,以各种企业,对符合公平交易条件的投资指令强制执行 公司家厅集中安島市度,所有收组。后将设组合的投资协会均由交易部位,执行责任公司。 多路依据《公司平文县》 细则的规定、对交易所公开爱价交易,公司开启恒至交易系统中的公平交易程序,对符合公平交易条件的投资指令强制执行 公平交易。具体加下。 一般价格会的执行原则,对于不同股价的国向指令。按照"价格优先、时间优先、国时均分"的原则执行;对于相同股价的同时或另位。。 题制成有证 是对是有限的人工工作价,是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是不是一个。 一定的价格会的执行原则,对于不同间交易指令,按照"访彻债务"的原则执行"包集"的。 各投资组合委托数量设置委托比例,被任例具体执行。 三部分股份指令一部分的指令,我们可以不是相关,使照,对于同时交易控制。强制执行但生交易系体中的公平交易程序,按照 保护资格令年初的市份令的执行所属,对于不同投资经理下运的不同类型的间向交易指令,在实现价格优先,以所依先生, 对债务一级市场中的,非公开发行提票等以公司名义进行的交易,公司依据价格优先、比例分配的原则对交易结果进行 分配。

集交易系统目动势杆交易程序执行指令。以确保公司版上投资组合在一幅发生的反同交易中保持公平、杜绝交易执行中可能发生的利益能差行为。
本报告期内、未发现, 4组合有可能导致不公平交易和利益输送的弊常交易行为。
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表更的设明
4.5.1报告期内基金的投资策略和企业资表更的设明
4.5.1报告期内基金投资策略和定任分析
就2012年上年来说、环境市场的走势给人一种保管相识的感觉,一季度展开春季攻势,二季度经济数据开始环化走软 提醒仍然是弱复苏。然而与2011年不同。2012年的市场上下的波动幅度有所加大。但美国在经济复苏的谐路上领先全球的概 企正在为更多的市场参与看所接受。反赖欧州、中初则原规则更加令人担心的后危间问题,更多的周边市场图。日括较大的 经济体西班牙也加入了要求败盟赦助的阵营、整个一季度市场都在围绕希腊、法国、西班牙等国传出的坏消息盘整,兼之美国

### 长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

## 2012 年度 报告摘要

本基金2013年将继续乘承控制仓(风险。),经济复苏的恋势校好的美国和香港市场为主要配置方向,执行稳健增值的投资策略。
47管理人对报告期外基金估值程序等事项的说明
根据中国证金有铁规定及本基金合同处定。本基金管理人严格按照《企业会计准则》,中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定。对基金阶梯较强品种进行结准。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值、未金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值、未金管理人制订的证券投资基金估值的效量与估值程序,设立基金估值,本金管理人制订的证券投资基金估值的效量与相关的工作。
本基金管理人制订的证券投资基金估值的策与结值程序,预定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、优值方法以及估度转处理。即将估值和特殊特处理等事项。本基金管理公司不值目的、估值日、估值对象、估值程序、优值方法以及估度转处理、现价值值和转处理等事项。本基金等还是可证自任估值,必须组长、公司投资部、金融工程与量化投资部。研究部、监察器核率。业务全营第等部门负责人组成的基金估值以组、负责的实、指导中执行关键。合适组则制力法的设计。但不参与估值原则和方法的设计,是全是要多与估值则剩和方法的讨论。但不参与估值原则和方法的讨论。但不参与估值原则和方法的对法。是是是多与信息规则和方法的讨论。但不参与估值原则和方法的对法。是不参与估值原则和方法的对法。但是多少有用分法的现实。

实题和明分配。 本基金戴至2012年12月31日期末可供分配收益为-7,047,172.49元,其中,未分配收益已实现部分为-7,047,172.49元,未分配收益未实现部分为192,338.99。

本基金館至2012年12月31日 別水平) FF (2012年2012年2月31日 別水平) FF (2012年2月31日 別次平) FF (2012年2月31日 別次平

7.1 资产负债表 会计主体: 长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金 报告截止日: 2012年12月31日

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
眼行存款	14,165,384.44	16,387,068.93
结算备付金	-	
存出保证金	-	
交易性金融资产	35,667,205.60	38,764,186.69
其中:股票投资	35,667,205.60	37,227,612.3
基金投资	-	1,536,574.3
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	1,323,080.34	
应收利息	359.78	2,760.1
应收股利	7,621.17	30,385.9
应收申购款	534,004.38	139,916.0
递延所得税资产	_	
其他资产	-	
资产总计	51,697,655.71	55,324,317.7
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:		
短期借款	-	
交易性金融负债	-	
汀生金融负债	-	
卖出回购金融资产款	-	
立付证券清算款	672,780.08	
立付赎回款	52,898.45	34,691.7
立付管理人报酬	76,289.30	80,863.3
立付托管费	12,714.87	13,477.2
立付销售服务费	-	
立付交易费用	-	
立交税费	-	
立付利息	-	
立付利润	-	
<b>递延所得税负债</b>	-	
其他负债	320,135.26	330,108.1
负债合计	1,134,817.96	459,140.4
所有者权益:		
实收基金	57,417,671.25	67,990,591.9
	-6,854,833.50	-13,125,414.6
未分配利润		
未分配利润 所有者权益合计	50,562,837.75	54,865,177.3

坝 日	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	6,215,730.10	-11,050,397.27
1.利息收入	23,253.00	38,005.20
其中:存款利息收入	23,253.00	38,005.20
债券利息收入	-	_
资产支持证券利息收入	-	_
买人返售金融资产收入	_	_
其他利息收入	_	_
2.投资收益 惯失以""填列)	-1,161,054.45	-3,352,501.48
其中:股票投资收益	-1,150,178.22	-4,024,250.35
基金投资收益	-622,776.10	_
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	611,899.87	671,748.87
3.公允价值变动收益(损失以""填列)	7,431,140.37	-7,503,384.19
4.汇兑收益 假失以""填列)	-100,564.35	-283,318.41
5.其他收入 假失以""填列)	22,955.53	50,801.61
减:二、费用	1,541,949.79	1,947,846.78
1.管理人报酬	924,636.35	1,084,545.32
2.托管费	154,106.12	180,757.61
3.销售服务费	-	_
4.交易费用	148,435.61	345,463.63
5.利息支出	-	1.46
其中:卖出回购金融资产支出	-	_
6.其他费用	314,771.71	337,078.76
三、利润总额(亏损总额以""号填列)	4,673,780.31	-12,998,244.05
减:所得税费用	-	-
四、净利润 停亏损以 ""号填列) 7.3 所有者权益(基金净值)变动表	4,673,780.31	-12,998,244.05

			十四二人いつい	
項 目	本期 2012年1月1日 至2012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)	67,990,591.98	-13,125,414.66	54,865,177.32	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,673,780.31	4,673,780.31	
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)	-10,572,920.73	1,596,800.85	-8,976,119.88	
其中:1.基金申购款	14,333,401.39	-2,064,168.67	12,269,232.72	
2.基金赎回款	-24,906,322.12	3,660,969.52	-21,245,352.60	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (峥 值减少以""号填列)	-	-	-	
五、期末所有者权益 甚金净值)	57,417,671.25	-6,854,833.50	50,562,837.75	
項 目	上年度可比期间 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 偡金净值)	75,304,253.96	5,700,512.37	81,004,766.33	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-12,998,244.05	-12,998,244.05	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (等值减少以 "" 号填列)	-7,313,661.98	-2,143,316.00	-9,456,977.98	
其中:1.基金申购款	36,629,599.41	-3,514,189.43	33,115,409.98	
2.基金赎回款	-43,943,261.39	1,370,873.43	-42,572,387.96	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (峥 值减少以""号填列)	-	-3,684,366.98	-3,684,366.98	
五、期末所有者权益 供命净值)	67 990 591 98	-13.125.414.66	54.865.177.32	

注:报表附注为本会计报表的组成部分。 本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署: 周兵

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。 7.4.5.3 差错更正的说明

7-4. 经项 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效问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业 1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. 以投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. 自前基金规律的源的遗物分差价收入,其涉及的境外所得税税收效策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 战"暂免征营业税和企业所得税。 3. 目前基金规律的源的遗境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收效策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 战内暂不征收个人所得税和企业所得税。 7-17 半路下去年。

基金管理人的股东 基金托管人控制的公 600.DIMAN SACHS INTERNATIONAL 境外投资瞬间控制的公司 注:1.根据长磁基金公司2012年8月2日(关于公司股东名称变更及公司策程能改的公告)。长盛基金公司的股东安徽省 发展指挥器并任公司更名为安徽省投资集团控制有限公司。相关工商变更登记手续已办理完毕。 2.下连关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 7.48 年报告期及上年度用比期间的关联方交易 7.48 年报告期及上年度用比期间的关联方交易 7.48 1 迪辽关联方交易率元进行的交易

关联方名称	2012年	本期 F1月1日至 F12月31日
	成交金額	占当期股票 成交总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	_
国元证券经纪 香港 )有限公司	-	-
中银国际证券有限公司	-	-
关联方名称	2011年	受可比期间 F1月1日至 F12月31日
	成交金額	占当期股票 成交总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	10,954,366.80	4.21%
国元证券经纪 香港 )有限公司	5,374,993.23	2.06%
中银国际证券有限公司	_	_

7.4.8.1.2 权证交易 本基金本期未通过关联方交易单元发生权证交易。 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 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 总額	占期末应付佣金总额的 比例		
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	-	-	-		
国元证券经纪 香港 )有限公司	-	-	-	-		
中银国际证券有限公司	-	-	-	-		
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月日至 2011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 总额	占期末应付佣金总额的 比例		
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	15,254.72	6.88%	-	-		
国元证券经纪 香港 )有限公司	5,374.99	2.43%	-	-		
中银国际证券有限公司	_	_		_		

项目	2012年1月1日至 2012年12月31日	2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	924,636.35	1,084,545.32
其中:支付销售机构的客户维护费	293,939.05	335,976.57
注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬 付。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80% 7.4.8.2.2 基金托管费		年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	154,106.12	180,757.6

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
基金合同生效日(2010年5月26日)持有的基金份额	-	_
期初持有的基金份额	18,003,410.00	18,003,410.00
期间申购/买人总份额	_	_
期间因拆分变动份额	_	_
减:期间赎回/卖出总份额	_	_
期末持有的基金份额	18,003,410.00	18,003,410.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.36%	26.48%

除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。	
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:		
	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	关联方 名称
当期利息收入	期末余額	
23,131.01	1,480,085.01	中国银行
-	12,685,299.43	中银香港
23,131.01	14,165,384.44	合计
	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日	关联方 名称
当期利息收入	期末余額	
37,269.99	11,179,368.99	中国银行
-	5,207,699.94	中银香港
37,269.99	16,387,068.93	合计

	.,							金	额单位:人民币5
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 段)	期末 成本总额	期末 估值总额
923 HK	FOOK WOO GROUP	2011/11/ 28	公司内部整改 接受审计调查	1.11	未知	未知	200,000	245,037.99	222,172.90
合计								245,037.99	222,172.90
公布事项	的重大影响	前除后,经	31日止持有以上 交易所批准复牌	P	大事项中	能产生重	1大影响而被	百时停牌的股票	,该类股票将在原

、国。 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)。 ②各层次金融工具公允价值

②各层次金融工具公允价值 于2012年12月3日,本途均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35,445,03270元,属于第二层级的 余额为222,172.90元属于第三层级的余额。(2011年12月31日,第一层级8.764,186.60元、元第二、三层级)。 ②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。在15组重大事项停牌。交易不适跃包括涨跌停时的交易不活跃,或属于非公开发行等情 云。本基金个条子停阱日至交易恢复活跃日期间。交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值刘人第一层级;并根据 估值调整中采用的今市观聚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三层级还是第三层级, 4年层层次公允价值余额和本期变金金融。

元。 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

占基金总资产的比例 %)	金额	项目	序号
68.9	35,667,205.60	权益投资	1
66.4	34,374,592.52	其中:普通股	
1.5	795,775.73	存托凭证	
0.9	496,837.35	房地产信托凭证	
	-	基金投资	2
	-	固定收益投资	3
	-	其中:债券	
	-	资产支持证券	
	-	金融衍生品投资	4
	-	买人返售金融资产	5
	-	其中:买断式回购的买人返售金融资产	
		货币市场工具	6
27.4	14,165,384.44	银行存款和结算备付金合计	7
3.6	1,865,065.67	其他各项资产	8
100.0	51,697,655.71	合计	9

金額单位:人民币:	COMES / MESS TO SOME STANDING SECOND TO	0.2 IKI 7/170EH   ESK (
占基金资产净值比例 %)	公允价值	国家 他区)
51.24	25,910,179.26	美国
17.18	8,685,455.45	香港
1.10	554,883.73	法国
1.02	516,687.16	加拿大
金額单位:人民币:	的权益投资组合	8.3 报告期末按行业分类的

	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(%)
信息技术	8,649,174.45	17.11
金融	6,133,480.99	12.13
医疗	5,101,427.65	10.09
工业	4,989,768.51	9.87
能源	3,085,615.01	6.10
必需消费品	2,812,864.48	5.56
非必需消费品	2,679,856.49	5.30
公用事业	1,214,977.64	2.40
电信服务	554,883.73	1.10
材料	445,156.65	0.88
合计	35,667,205.60	70.54
	C分(cree) 学年年出八米	

8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

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	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克 证券交易所	美国	500	1,675,180.03	3.31
2	CHINA RES LAND	华润置地	1109 HK	香港 证券交易所	中国香港	70,000	1,197,625.45	2.37
3	PRICELINE.COM	-	PCLN US	纳斯达克 证券交易所	美国	300	1,171,365.78	2.32
4	VISA INC-CLASS A SHA	-	V US	纽约 证券交易所	美国	1,200	1,143,307.31	2.26
5	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约 证券交易所	美国	3,000	1,054,078.35	2.08
6	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克 证券交易所	美国	6,000	1,008,068.49	1.99
7	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约 证券交易所	美国	1,450	985,585.26	1.95
8	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克 证券交易所	美国	3,000	962,058.63	1.90
9	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克 证券交易所	美国	2,000	923,339.95	1.83
10	IND & COMM BK OF CHI	工商银行	1398 HK	香港 证券交易所	中国香港	200,000	891,935.00	1.76
注	::投资者欲了解本	设告期末基:	金投资的所	有股票明细,应	☑阅读登载于I	nttp://www.c	sfunds.com.cn网站的	り年度报告正文。

0.3.1	系订头人亚视超出别初基亚贸严律恒2	705QH0207EH71XII	ETX N de 1800	金额单位:人民币:
序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买人金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	WEICHAI POWER-H	2338 HK	1,707,680.47	3.11
2	COCA-COLA CO/THE	KO US	1,327,798.99	2.42
3	ANADARKO PETROLE	APC US	1,269,375.12	2.31
4	IND & COMM BK-H	1398 HK	1,220,479.06	2.22
5	BAIDU INC-SP ADR	BIDU US	1,186,235.06	2.16
6	CHINA MINSHENG-H	1988 HK	1,163,058.60	2.12
7	POLY PROPERTY	119 HK	1,087,987.38	1.98
8	CHINA RES LAND	1109 HK	1,063,421.12	1.94
9	PING AN INSURA-H	2318 HK	987,349.10	1.80
10	POTASH CORP SAS	POT US	913,820.21	1.67
11	CHINA TAIPING IN	966 HK	877,069.10	1.60
12	NEW CHINA LIFE-H	1336 HK	846,325.40	1.54
13	TRIUMPH GROUP	TGI US	812,911.93	1.48
14	CAPITAL ONE FINA	COF US	749,349.68	1.37
15	ZHAOJIN MINING-H	1818 HK	740,028.04	1.35
16	KBR INC	KBR US	736,827.54	1.34
17	KRAFT FOODS INC	KFT US	724,998.89	1.32
18	CVS CAREMARK COR	CVS US	719,279.73	1.31
19	CHECK POINT SOFT	CHKP US	696,770.93	1.27
20	SANDS CHINA LTD	1928 HK	695,017.38	1.27

	以计卖出金额超出期初基金资产净值			金额单位:人民币
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 MINSHENG-H	1988 HK	1,621,044.89	2.9
2	WEICHAI POWER-H	2338 HK	1,525,618.68	2.7
3	POTASH CORP SAS	POT US	1,464,077.69	2.6
4	KUNLUN ENERGY CO	135 HK	1,258,033.38	2.2
5	SIMON PROPERTY	SPG US	1,170,663.08	2.1
6	IND & COMM BK-H	1398 HK	1,157,496.19	2.1
7	BAIDU INC-SP ADR	BIDU US	1,084,116.43	1.9
8	CHINA PACIFIC-H	2601 HK	1,074,157.25	1.9
9	ZHAOJIN MINING-H	1818 HK	1,023,926.70	1.8
10	SANY HEAVY EQUIP	631 HK	1,016,634.97	1.8
11	APACHE CORP	APA US	980,328.96	1.7
12	SHANGHAI ELECT-H	2727 HK	977,629.71	1.7
13	PING AN INSURA-H	2318 HK	935,020.62	1.7
14	LONGFOR PROPERTI	960 HK	898,200.14	1.6
15	CIE FINANCI-BR A	CFR VX	836,929.72	1.5
16	PHILIP MORRIS IN	PM US	830,992.66	1.5
17	APPLE INC	AAPL US	812,752.83	1.4
18	ARM HOLDINGS	ARM LN	810,282.89	1.4
19	PROCTER & GAMBLE	PG US	797,452.79	1.4
20	BOMBARDIER INC-B	BBD/B CN	794,296.20	1.4
8.5.3	权益投资的买人成本总额及卖出收	人总额		

金额(成文单价率以成文数量)域列、不多虑相关交易费用。
8.6期末被称号信用等级分类的债券投资组合
本基金本期末未持有债券。
8.7 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行生产品投资明细
本基金本期末共持有金融行产品。
8.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细
本基金本报告期未对特百基金。
8.11 投资组合股市损生
8.11 用于基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开
发处罚的情况

,处罚的情形。 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处 。 8.112声明基金投资的前十只股票是否超出基金合同规定的备选股票库。 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。 8.113 期末其他各项资产构成

0.11	W WINDERSON 1994	单位:人民币
序	号名称	金额
	I 存出保证金	-
	2 应收证券清算款	1,323,080.34
	3 应收股利	7,621.17
	4 应收利息	359.78
	5 应收申购款	534,004.38
-	6 其他应收款	-
	7 待摊费用	-
	8 其他	
	9 合计	1,865,065,6

9 | 台口 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 本基金本期末前十名股票不存在流通受限情况。 4.00%的人程度据达到推广交换推广的人

9.1 期末基金件	分额持有人户数及持有	3.5 基重加銀寸 5人结約	有人信念				
2.1 3/1/16/05/05 D	JUNE 10 17 17 17 17 17 17 17 17 17 17 17 17 17	370019			份额单位:		
持有人户数(户)		持有人结构					
	户均持有的基金份 额	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 (%)		
6,713	8,553.21	18,369,179.44	31.99	39,048,491.81	68.01		
9.2 期末基金管	5理人的从业人员持4	有本开放式基金的情况			In death In I		

457,874.02

基金合同生效日 2010年5月26日 )基金份额总额	340,041,384.63
本报告期期初基金份额总额	67,990,591.98
本报告期基金总申购份额	14,333,401.39
减:本报告期基金总赎回份额	24,906,322.12
本报告期基金拆分变动份额(分额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	57,417,671.25
§ 11 重大事件揭示	

11.1 基金价额持有人大会款以 3.11 基本价额持有人大会。 11.2 基金管理人、基金托官人的专门基金托管部门的重大人事变动 11.2.1 基金管理人的基金接管型人的重大人事变动情况 本基金管理人的高数管理人员重大人事变动情况 未基金管理人为12年3月16日发布关于公司高级管理人员变动的公告,朱剑彪因个人原因辞职,经董事会决议解聘其 引起这些职场,并已按规定的中国证益会和北京证益局报告。 11.2.2 基金还理的变效情况

1122 基金界图的变对情况。

1123 本经产期的变对情况
本报告期本基金差型用光管变动。

1123 本基金界图的变对情况
本报告期本基金法管人的专门基金社管部门重大人事变动情况
本报告期本基金社管人的专门基金社管部门无重大人事变动。
2013年3月17日 根据图形象金融上作需要,同物先生辞差中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于
2015年3月17日公告上述事项。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金社管业务的诉讼
本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金社管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略设有改变。

11.5 基金进行审计的经计师事务所持置、
在股份资本报告期本金投资策略设有改变。

11.5 基金进行审计的00元、该审计划机产提供审计服务的选续年限为3年。

11.6 管理人、托管人及其系级管理人员全餐查或处罚等情况
基金管理人、托管人及其系级管理人员会餐查或处罚等情况

11.6 管理人、托管人及其系级管理人员会餐查或处罚等情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

		股票交易		应支付该券商的佣金		T	
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	备注	
MERRILL LYNCH	1	70,388,142.66	59.34%	41,825.56	46.44%	-	
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO.LTD.	1	48,230,222.02	40.66%	48,230.23	53.56%	-	
CLSA LTD.	1	-	-	-	-	-	
SHENYIN WANGUO SECURITIES (HK) LTD	1	-	-	-	-	-	
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1	-	-	-	-	T-	
KIM ENG SECURITIES (HONG KONG) LTD	1	-	-	-	-	-	
CITIC SECURITIES BROKERAGE (HK) LTD.	1	-	-	-	-	-	
GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LTD.	1	-	-	-	-	-	
YUANTA SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LTD.	1	-	-	-	-	-	

	数画	成交金额	成交总额的 比例	佣金	总量的比 例	7.1
MERRILL LYNCH	1	70,388,142.66	59.34%	41,825.56	46.44%	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO.LTD.	1	48,230,222.02	40.66%	48,230.23	53.56%	-
CLSA LTD.	1	-	-	-	-	Τ-
SHENYIN WANGUO SECURITIES (HK) LTD	1	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1	-	-	_	-	-
KIM ENG SECURITIES (HONG KONG) LTD	1	-	-	-	-	-
CITIC SECURITIES BROKERAGE (HK) LTD.	1	-	-	-	-	-
GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LTD.	1	-	-	-	-	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LTD.	1	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITES LTD.	1	-	-	_	-	-
TAIFOOK SECURIIES COMPANY LTD.	1	-	-	_	-	-
THE ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC (HONG KONG) BRANCH	1	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL PLC	1	-	-	-	-	-
BOCI INTERNATIONAL LTD.	1	-	-	_	-	-
UBS SECURITIES ASIA LTD.	1	-	-	-	-	Τ-
PHILLIP SECURITIES (HONG KONG)COMPANY LTD.	1	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	1	-	-	-	-	T-
KGI ASIA LTD.	1	_	-	-	-	T-

11.7 2基金租用证券公司及易年元进行其他证券投资的情况 于本报告期本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。 注:1.本公司选择境外交易券商的标准 (1)在评估交易券商的过程中应当场起以下方面,包括但不限于,财务状况,例如股本金、净资产、总资产等;国际评级机 构约如标管、强速等发布的信用评级; (2)前台业务评估、包括交易执行、客户服务、交易价格、交易量、投资研究、市场信息等; (3)后台业务评估、包括交易执行、客户服务、交易价格、交易量、投资研究、市场信息等; (3)后台业务评估、包括交易确认的及时也事确性、交割的质量(信息反馈的质量评估; (4)经营行为规范。最近明年未因重大违规行为而受到所在国家/地区证券监管机构处罚; (5)内密管理规范。严格、具各健全的价格制度,并能测生在国家/地区证券监管和规处罚; (6)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。 2.本公司租用券商交易单元的程序。 (2)研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定; (3)针对新交易券商机构,一律先由投资部门根据试用期评价结果提请公司领导核准后完成开户并列人常用券商机构

(3) 打不对數文必分同數以例。一件完出区資訊》,把來版出出明實行指來施置公司领导核產出元成打广升的人品出分詞的以 列表; (4) 常用券商机构定期由基金经理、研究员、交易员、运营及清算人员根据券商研究服务品质、交易执行能力进行评分进 行综合评价; 行综合评价; (5)本公司每半年对开户券商机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为开户券商的服务不能满足要求,或开户券商违规受到相关市场有关部门的效罚,予以停用该券商的服务并终止开户协议。 3.基金租用证券公司交易单元变更情况 (1)本基金根告期内新增租用交易单元。无 (2)本基金报告期内两世租用交易单元。无。