长城久恒平衡型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
送出日期:2013年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年03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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长城久恒平衡混合
基金主代码	200001
前端交易代码	200001
后端交易代码	201001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月31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额	147,317,620.05份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本着安全性、流动性原则,控制投资风险,谋求基金资产长期稳定增长。
投资策略	本基金以资产配置作为控制风险、获得超额收益的核心手段,通过资产的动态配置、股票资产的风格调整以及证券选择三个层次进行投资管理。
业绩比较基准	70%×中信综指+30%×中信国债指数。
风险收益特征	本基金的风险水平力求控制在市场风险的50%-60%左右。

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		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路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 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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-7,064,128.75	-23,571,344.20	-8,400,620.86
本期利润	18,535,973.98	-45,936,380.84	-17,410,432.71
加权平均基金份额本期利润	0.1210	-0.2827	-0.0975
本期基金份额净值增长率	10.73%	-20.29%	-6.25%
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	0.2088	0.1004	0.3796
期末基金资产净值	179,398,666.98	188,481,763.59	229,150,626.44
期末基金份额净值	1.218	1.100	1.380

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.01%	0.74%	5.30%	0.92%	-3.29%	-0.18%
过去六个月	2.70%	0.78%	0.47%	0.90%	2.23%	-0.12%
过去一年	10.73%	0.87%	5.27%	0.93%	5.46%	-0.06%
过去三年	-17.26%	0.96%	-15.88%	0.99%	-1.38%	-0.03%
过去五年	-25.83%	1.12%	-25.96%	1.38%	0.13%	-0.26%
自基金合同生效起至今	200.25%	1.15%	123.64%	1.29%	76.61%	-0.14%

注:从D1到Dn时间区间业绩比较基准的收益率由D0到D1区间内每个交易日收益率的合成计算而来,计算公式如下:

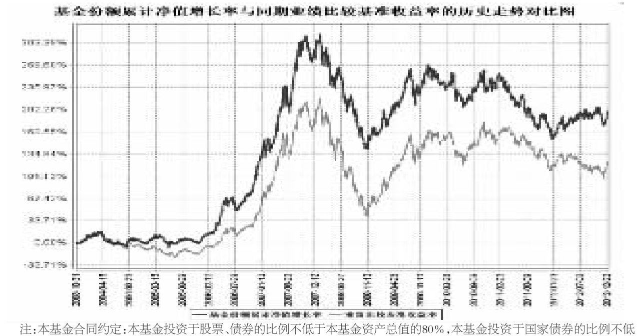
从D1到Dn时间区间业绩比较基准收益率= (1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×……×(1+ Dn日业绩比较基准收益率)-1

这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下:

长城久恒业绩比较基准每日收益率=中信标普A股综合指数日收益率×70%+中信标普国债指数日收益率×30%

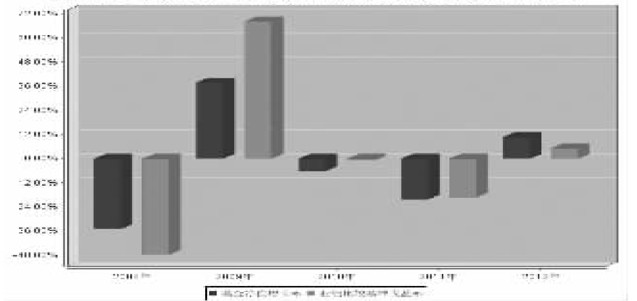
指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成。

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:本基金合同约定:本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的25%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

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
2012	-	-	-	-	
2011	-	-	-	-	
2010	0.500	3,305,321.93	5,588,152.02	8,893,473.95	
合计	0.500	3,305,321.93	5,588,152.02	8,893,473.95	

§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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券有限责任公司(47.059%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司管理的基金有封闭式基金:久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金。

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		
王文祥	长城双动力基金、长城久恒基金的基金经理	2011年10月19日	-	5年	男,中国籍,清华大学工学硕士。2007年进入长城基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员,"长城中小盘成长股票型证券投资基金"基金经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法,严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节,本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施,保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节,本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度,按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则,保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节,本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

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

A股2012年市场波动激烈,主要板块也是剧烈波动。在十八大胜利召开后,新一届政府的改革新政谈话,加之四季度末宏观经济数据的好转,点燃了市场热情和信心,上证指数在市场跌至1949点后,12月份市场迎来了报复性迅速反弹,其中以银行地产为龙头和标志的连续涨停式反弹,实属几年罕见。

本基金一季度对机械(煤机、油气装备)、地产、白酒进行了重仓,但组合仍有较多小股票继续下跌,一季末业绩表现中等;二季度重仓配置医药进入前1/3;三季度大盘下跌,持仓医药个股、旅游等表现抢眼,业绩进步至1/10,年末本基金重仓的白酒,因塑化剂事件发生后连续暴跌,以此同时地产银行等强势拉涨停等叠加影响,年末排名下滑较快。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金业绩在同类可比的基金中排名位于中等偏上水平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

其实,改变A股中长期走势的许多因素并没有发生根本性变化。经济层面,经济运行效益并未转变、经济结构转型尚需时间、对政府低效投资拉动经济存在深度担忧、A股大权重板块产能过剩、地方政府融资平台债务问题解决也尚需时间;市场制度层面,大小非的减持压力、新股IPO重启压力。在11月份地产投资数据好转后,市场反映热烈。我们应该看到,地产价格等涨幅虽然回落但绝对价格仍处高位,国家不会轻易大幅连续的降息降准来放松楼市,行政上的房地产限购政策也难以退出。

在国内外经济动荡等诸多不确定下,保持宏观经济增速在一定合理水平仍是我国政府的非常重要的目标之一。虽然推动过去中国经济高速增长的核心因素有所减弱,但经济的根本动力并未完全枯竭。展望2013年,经济数据最有可能在二季度去库存后反复波动,对固定投资链条的行业和个股会造成较大波动。长期看,中国经济若要保持可持续性发展,GDP增速没必要、也没有能力保持8%以上更高的水平。市场化去产能、地方政府去杠杆、真心实意的市场化改革是未来中国根本希望所在,也是下一波牛市的根本基础。

具体来讲,我们仍会以确定性成长的医药、家电等大消费作为核心持仓,此外,我们对低估值确定性成长的银行、汽车等板块也会增加配置;对金融制度改革走势保持密切跟踪;对白酒低估值和股价底部随时准备增加配置。本基金仍会坚守具有核心竞争力的价值型行业作为本基金核心持仓,同时选择受益于经济转型并具备持续成长能力的行业作为进攻组合,中长线布局,保持耐心,控制仓位,规避风险,力争为持有人作出更好业绩回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则,进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程,认真执行了各项管理制度,有效实施了三层风险防范和控制措施,建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定,认真履行了工作职责,结合公司实际运作需要,进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作,实时监察关键业务风险点,每季进行定期稽核,监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中,认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见,督促各部门及时进行了整改,防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规,保障基金份额持有人的利益,建立健全投资监控体系和风险评价体系,加强投资决策流程的内部控制和风险管理,严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易,严格防范基金销售业务中的违规行为,严格履行信息披露义务,保证履行基金合同的承诺。本报告期内,本基金运作合法合规,无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为,维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持"诚信、稳健、规范、创新"的经营理念,继续完善法人治理结构和内部控制制度,不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识,加强实时监督和控制,完善电子监控手段,使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着"取信于市场,取信于社会"的宗旨,诚实信用,勤勉尽责,为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

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

公司成立了基金估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司分管估值业务副总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席基金估值委员会。

基金估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握,对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究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,对没有市价的投资品种综合宏观经济、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委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据基金估值委员会提出的多种估值方法预案,利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具,针对不同的估值方法及估值模型进行演算,为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查,对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

基金估值委员会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;基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格,精通基金估值政策、流程和标准,具有五年以上基金估值和会计核算工作经验;基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验,精通投资、研究理论知识和工具方法。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员,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,向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会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

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久恒平衡型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定,如果基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。本基金本期净亏损 ,不进行收益分配。

本基金2012年度期末可供分配利润30,766,902.53元,已于2013年1月18日对本报告期内本基金进行了收益分配。分配金额为4,399,710.91元,符合基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:长城久恒平衡型证券投资基金
报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		17,439,442.78	16,954,712.41
结算备付金		145,001.52	93,030.02
存出保证金		750,000.00	890,741.00
交易性金融资产		162,572,139.91	172,108,550.68
其中:股票投资		116,956,519.91	101,961,833.68
基金投资		-	-
债券投资		45,615,620.00	70,146,717.00
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		1,128,071.30	1,298,220.47
应收股利		-	-
应收申购款		32,121.02	49,791.58
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		182,066,776.53	191,395,046.16
负债和所有者权益	附注号	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		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,163,430.17	1,592,500.01
应付赎回款		214,219.34	30,947.28
应付管理人报酬		218,385.22	247,814.33
应付托管费		36,397.55	41,302.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		64,452.52	120,079.18
应交税费		75,913.00	75,913.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		895,311.75	804,726.40
负债合计		2,668,109.55	2,913,282.57
所有者权益:			
实收基金		147,317,620.05	171,291,912.70
未分配利润		32,081,046.93	17,189,850.89
所有者权益合计		179,398,666.98	188,481,763.59
负债和所有者权益总计		182,066,776.53	191,395,046.16

注:截至2012年12月31日,基金份额净值1.218元,基金份额总额147,317,620.05份。

7.2 利润表

会计主体:长城久恒平衡型证券投资基金
本报告期: 2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	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
一、收入		22,622,105.71	-40,378,221.46
1.利息收入		1,892,484.49	1,865,251.72
其中:存款利息收入		131,743.23	159,484.56
债券利息收入		1,760,741.26	1,705,767.16
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)		-4,927,509.78	-19,921,596.84
其中:股票投资收益		-6,199,306.72	-19,688,106.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-8,674.16	-880,985.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,280,471.10	647,494.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		25,600,102.73	-22,365,036.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		57,028.27	43,160.30
减:二、费用		4,086,131.73	5,558,159.38
1. 管理人报酬		2,672,450.74	3,088,777.70
2. 托管费		445,408.47	514,796.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		608,148.52	1,581,783.82
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		360,124.00	372,801.64
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		18,535,973.98	-45,936,380.84
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		18,535,973.98	-45,936,380.84

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久恒平衡型证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	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(基金净值)	171,291,912.70	17,189,850.89	188,481,763.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,535,973.98	18,535,973.98
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)	-23,974,292.65	-3,644,777.94	-27,619,070.59
其中:1.基金申购款	13,471,778.99	2,289,988.66	15,761,767.65
2.基金赎回款	-37,446,071.64	-5,934,766.60	-43,380,838.24
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)	147,317,620.05	32,081,046.93	179,398,666.98
项目	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(基金净值)	166,098,741.22	63,051,885.22	229,150,626.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-45,936,380.84	-45,936,380.84
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)	5,193,171.48	74,346.51	5,267,517.99
其中:1.基金申购款	31,648,946.10	8,145,366.42	39,794,312.52
2.基金赎回款	-26,455,774.62	-8,071,019.91	-34,526,794.53
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)	171,291,912.70	17,189,850.89	188,481,763.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

杨光裕	熊科金	彭洪波
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城久恒平衡型证券投资基金(以下简称"本基金")系由长城基金管理有限公司发起,经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2003]97号文《关于同意长城久恒平衡型证券投资基金募集的批复》的核准,由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2003年10月31日正式生效,首次设立募集规模为1,284,133,805.81份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")。

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:70%×中信综指+30%×中信国债指数。

7.4.2 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。

7.4.3 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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国建设银行	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
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东

注:于本期,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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易-

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	2,554,196.78	0.64%	-	-
东方证券	-	-	130,900,779.04	12.58%

7.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东方证券	-	-	8,137,871.20	5.24%

7.4.8.1.3债券回购交易

注:本基金于本期及上年度可比期间,均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间,均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	2,171.07	0.64%	-	-
东方证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	-	-	-	-
东方证券	111,266.32	12.87%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 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管理费	2,672,450.74	3,088,777.70
其中:支付销售机构的客户维护费	449,092.84	517,715.59

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×1.5%/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五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2)本期末本基金未支付的管理费余额人民币218,385.22元。(2011年12月31日:人民币247,814.33元)

7.4.8.2.2 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	445,408.47	514,796.22

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×0.25%/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五个工作日内从基金资产中一次性支取。

2)本期末本基金未支付的托管费余额人民币36,397.55元。(2011年12月31日:人民币41,302.37元)

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于本期及上年度可比期间,均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金的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份额,于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	17,439,442.78	128,256.43	16,954,712.41	148,087.60

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年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

截至本报告期末2012年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

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	116,956,519.91	64.24
	其中:股票	116,956,519.91	64.24
2	固定收益投资	45,615,620.00	25.05
	其中:债券	45,615,620.00	25.05
	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	17,584,444.30	9.66
6	其他各项资产	1,910,192.32	1.05
7	合计	182,066,776.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	6,297,447.00	3.51
C	制造业	82,780,672.91	46.14
C0	食品、饮料	17,654,140.00	9.84
C1	纺织、服装、皮毛	323,600.00	0.18
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,906,900.00	2.18
C5	电子	2,829,940.65	1.58
C6	金属、非金属	1,978,000.00	1.10
C7	机械、设备、仪表	16,843,292.77	9.39
C8	医药、生物制品	39,244,799.49	21.88
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	2,337,900.00	1.30
H	批发和零售贸易	11,467,500.00	6.39
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	2,106,000.00	1.17
K	社会服务业	4,113,000.00	2.29
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	7,854,000.00	4.38
	合计	116,956,519.91	65.19

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600062	华润双鹤	434,763	9,869,120.10	5.50
2	000513	丽珠集团	278,000	9,674,400.00	5.39
3	600594	益佰制药	404,939	8,102,829.39	4.52
4	600805	悦达投资	660,000	7,854,000.00	4.38
5	600519	贵州茅台	37,000	7,733,740.00	4.31
6	000028	国药一致	165,000	5,824,500.00	3.25
7	002508	老板电器	314,893	5,778,286.55	3.22
8	300005	探路者	330,000	5,643,000.00	3.15
9	300164	通源石油	347,055	5,344,647.00	2.98
10	000568	泸州老窖	150,000	5,310,000.00	2.96

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002508	老板电器	11,381,998.92	6.04
2	600594	益佰制药	9,048,201.73	4.80
3	600383	金地集团	8,603,080.00	4.56
4	002294	信立泰	8,517,914.17	4.52
5	000513	丽珠集团	8,341,265.15	4.43
6	600062	华润双鹤	8,307,155.81	4.41
7	002353	杰瑞股份	7,641,096.44	4.05
8	600805	悦达投资	7,434,899.34	3.94
9	000651	格力电器	6,759,325.85	3.59
10	600582	天地科技	6,543,703.29	3.47
11	600079	人福医药	6,293,311.63	3.34
12	000568	泸州老窖	6,163,476.28	3.27
13	600835	上海机电	5,946,205.88	3.15
14	000999	华润三九	5,337,883.00	2.83
15	002470	金正大	5,331,982.64	2.83
16	600535	天士力	5,324,151.34	2.82
17	000028	国药一致	5,281,548.87	2.80
18	601398	工商银行	4,581,000.00	2.43
19	000002	万 科A	3,801,724.58	2.02
20	002534	杭锅股份	3,697,328.11	1.96

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002294	信立泰	9,739,165.65	5.17
2	000858	五 粮 液	9,188,960.51	4.88
3	002353	杰瑞股份	7,960,630.00	4.22
4	300027	华谊兄弟	7,581,624.75	4.02
5	600582	天地科技	7,094,842.42	3.76
6	601798	蓝科高新	7,033,151.92	3.73
7	600535	天士力	6,829,902.50	3.62
8	600383	金地集团	6,259,850.64	3.32
9	601369	陕鼓动力	6,221,183.90	3.30
10	600199	金种子酒	6,215,687.63	3.30
11	002508	老板电器	6,038,778.00	3.20
12	002583	海能达	5,876,113.33	3.12
13	600835	上海机电	5,798,378.60	3.08
14	000028	国药一致	5,592,009.00	2.97
15	002277	友阿股份	5,077,011.26	2.69
16	002304	洋河股份	4,944,026.00	2.62
17	000568	泸州老窖	4,525,362.75	2.40
18	601398	工商银行	4,466,674.83	2.37
19	000002	万 科A	4,188,057.01	2.22
20	000998	隆平高科	4,177,843.50	2.22

注:卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	197,144,496.11
卖出股票收入(成交)总额	201,553,746.48

注:买入股票成本和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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,336,620.00	8.55
2	央行票据	30,279,000.00	16.88
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	45,615,620.00	25.43

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1101032	11央行票据32	300,000	30,279,000.00	16.88
2	019107	11国债07	82,800	8,333,820.00	4.65
3	019202	12国债02	70,000	7,002,800.00	3.90

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,128,071.30
5	应收申购款	32,121.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,910,192.32

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
13,157	11,196.90	7,098,718.16	4.82%	140,218,901.89	95.18%

9.2 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	616.90	0.0004%

注:①本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。

②本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2003年10月31日)基金份额总额	1,284,133,805.81
本报告期期初基金份额总额	171,291,912.70
本报告期基金总申购份额	13,471,778.99
减:本报告期基金总赎回份额	37,446,071.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	147,317,620.05

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

经公司第四届董事会第十二次会议审议并决议,并经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】881号文核准批复,聘任彭洪波先生和桑煜先生为公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2012年11月15日,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2012〕961号)。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2012〕1036号)。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币肆万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),为本基金提供审计服务4年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、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基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中投证券	2	100,010,562.35	25.11%	81,909.64	24.00%	-
东兴证券	1	78,139,784.35	19.62%	66,786.10	19.56%	-
国金证券	2	76,990,164.01	19.33%	66,859.61	19.59%	-
平安证券	2	55,017,102.12	13.81%	48,263.26	14.14%	-
民生证券	1	30,534,238.78	7.67%	26,291.65	7.70%	-
海通证券	1	24,540,888.82	6.16%	22,342.08	6.55%	-
兴业证券	1	10,069,953.57	2.53%	8,911.09	2.61%	-
银河证券	2	9,952,563.87	2.50%	8,886.56	2.60%	-
中金公司	1	7,562,510.04	1.90%	6,409.16	1.88%	-
华创证券	1	2,894,877.90	0.73%	2,527.29	0.74%	-
长城证券	3	2,554,196.78	0.64%	2,171.07	0.64%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

注:1、报告期内租用证券公司席位的变更情况:

本报告期内共新增三个交易单元,(国金证券、长城证券、华西证券),减少广发证券及二个交易单元,截止本报告期末共计三十六个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 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席位,选择的标准是:

(1)实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3)经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚;

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(5)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基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(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、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后,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成交量、支付的佣金等予以披露。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中投证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	49,773,107.14	58.72%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	17,050,498.00	20.11%	-	-	-	-
民生证券	7,952,333.95	9.38%	-	-	-	-
海通证券	9,992,900.00	11.79%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。