

7.1 资产负债表

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 重要提示及目录

重要揭示 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 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细立董事定等问意,并由董事长姿发。 托雷人田镇建销行股价捐股公司相报本基金自伺规定,于2013年6月22日复数(万本报告中的财务指标、净值表 海情况见,财务会计报告,投资组合报告新价客,保证复核内容不存在整度记载,误导性陈述或者重大遗漏。 曾重从末诏总域实信用,勤勉定所规则管理报证用基金股产。但不保证基金一定盈利。 的过程业绩并不代表其未来表现,投资有风险。投资者在作由投资决策前应计和阅读本基金的招赛说明书及其更新。 度优弱被禁锢台中度报告定。从资省有风险。投资者在作制投资决策前应计和阅读本基金的招赛说明书及其更新。 度优弱被禁锢台中度报告定。从资省有《解动内客》问阅读中度报告定。

客户服务电话	·		400-8868-666	010-67595096		
	电子邮箱	che	ejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com		
信息披露负责人	联系电话		0755-23982338	010-67595096		
	姓名		车君	田青		
名称		长坂	基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司		
Ŋ	題		基金管理人	基金托管人		
2.3 基金管理人						
风险收益特征	本基金的长期平均及金,属于较高风险、转			5于混合型基金、债券型基金、货币市场		
业绩比较基准	80%×沪深300指数收	(益率+20%>	中债综合财富指数收益率	0		
投资策略	本基金分股票型证券投资基金。将依据市场情况进行基金的大类资产配置。本基金采用 自上市 和 自下而上"相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流过 标等因素、在此基础上综合为底块还投票市场,债券市场定申的关键因素,如对股票市场等和信务。 市场流过性水平和市场运动水平等。对债券市场运势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券。 来等。自下面上地根据中投资股票的基本面和股础情况、对自己市下大类资产危置进行进一步,在安东市场深入分析的基础上。本基金将参考基金流动性要求。以使基金资产的风险和收益在储券货期金融工具生实现最佳印配。					
投资目标	本基金在合理的资产配置基础上,积极寻找受益于我国经济结构优化升级而实现成长的企业的价值,力争实现基金资产的持续增值。					
2.2 基金产品说	明	<u> </u>				
基金合同存续期			不定期			
报告期末基金份额	总额		69.355.764.69(2)	*		
基金托管人			中国建设银行股份有限公司			
基金管理人			长城基金管理有限公司			
基金合同生效日			2012年4月20日			
交易代码 基金运作方式			200015 契约型开放式			
基金主代码			200015			
			,			
2.1 基金基本情况 基金简称	/L		长城优化升级股票			

07	55-23982328	010-66275865
证券时报、中国证券报、上海证券报		设、中国证券报、上海证券报
	www.ccfund.com.cn	
	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心4	

	金額单位:人民币
3.1.1 期间数据和指标	2012年4月20日(基金合同生效日)-2012年12月31日
本期已实现收益	2,685,103.45
本期利润	6,797,286.42
加权平均基金份额本期利润	0.0576
本期基金份额净值增长率	8.00%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0042
期末基金资产净值	72,063,053.11
期末基金份额净值	1.039

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特有人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。 ③上述基金业绩指标不包括特有人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。

3.2 基金净值	」2012年4万201 表現 70争值増长率及1		《口勿不·巫亚口 较基准收益率的			
阶段	份額净值增长 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	6.94%	0.97%	8.18%	1.02%	-1.24%	-0.05%
过去六个月	6.09%	0.96%	2.26%	0.99%	3.83%	-0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	8.00%	0.83%	-1.54%	0.95%	9.54%	-0.12%
注:从D1到Dn 从D1到Dn时间 × (1+Dn日业绩比	时间区间业绩比较 I区间业绩比较A	5准的收益率=	№由D1到Dn区间 (1+D1日业绩比	内每个交易日收益率 :较基准收益率)×(的合成计算而来, 1+D2日业绩比较	计算公式如下: 基准收益率)×…

1+D由止動性权基准收益率)-1 这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下; 长城能化使量比较基准每日收益率 80% > 为深30指数日收益率 +20% × 中债综合财富指数日收益率 指数收益率以当日收益的相对于上一个交易日收益价计算而成。

100%		
7.00%	_	
1 00%	_	
5.00% -		
4 00%		
J 00/90	_	
3.00% -	_	
00%		
1.00%		
- 00%		
2.00%		

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	0.400	2,246,990.74	166,475.03	2,413,465.77	
合计	0.400	2,246,990.74	166,475.03	2,413,465.77	
	里人及基金经理情况		理人报告		

1.11 基金管理人及具管理基础的空源 长城基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%),东方证券 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 股份利限公司(15%),PUSTALD等利限的比公司(15%),A.D.自linjial上投资股份利限公司(15%),PUSTALL投资利股公司 (15%)。PSOLD(15%),PUSTALD等利限的投资。当时上海海水外海流火、风行。2007年5月21日,经中国证金批准、公司完成股权 结构调整。现有整度为产业证证等利限的工程。可以16%。2007年1月1日,生产时间证金完准,将于进营分量的企业区域上的不同人公司 (17-47%)。和中国销售台程设公司(16-47%)。2007年1月2日上,全时间证金完准。将于进营分量的企业区域上的方式人民公司 (16-47%)。和中国销售台程设公司(16-47%)。2007年1月2日上,当时间证金完准。将于进营分量的企业公司(17-47%)从中国企业公司(16-47%)从中国企业公司(16-47%),在国际公司(

44 Ar	姓名 职务		理(助理)期限		说明
处治	R7.93	任职日 期	离任日 期	从业 年限	19094
刘颖芳	本基金的基金 经理、长城消 费基金的基金 经理	2012年4 月20日	-	8年	女,中国籍。特许金融分析师 €FA).湘潭大学工学学士、清华大学 MBA。曾就职于四风信息科技产业集团 德维森实业 僚圳)有限公司,2004年进入长城基金管理有限公司,任长城基金管理有限公司 研究部行业研究员。
于雷	经理助理	2012年4 月20日	_	5年	男,中国籍中国人民士学财政金融学院经济学学士、硕士、香港大学金融学博士、特许金融学博士、特许金融学博士、特许金融学博士、特许金融学博士、任政、任政、、政策研究人员、设定、政策研究人员、设资决策委员会秘书、长城九化升级股票增证券投资基金。基金经理助理。
注:①1					任免日期填写。 业从业人员资格管理办法》的相关规定。

《加芬尔亚十四时》对几人或公证分证公证人证人证人以负责目,是分次了的加予人处定。 《刘刘颢芳女士自2012年10月15日至2013年1月11日休产假、在此期间、由本公司航下大坡交心回报混合型证券投资基金的 基金经理徐九龙先生代为履行基金经理职责。该事项已于2012年10月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报上进行了披

的迪账比力。 在这种经济环境下、关注国家产业政策的引导尤为重要,我们需要关注节能环保、医药生物、新型家电、计算机技术和传 维等产业的机造。市场经历了快速上涨后,有限的机会更加畅越、特别是比重企业的估值已经处于较高的水平。行业估值的分 化加大、对化中令中面临时学来将任,是以长元对联制的舰队分降着有市场状况。从市场中基件能顺面市场发生有较高的 品牌或技术整定、具备足够市场空间的技术品种,并耐心坚守。 为官位和图书、地国下加工中发企适的技资机会,合理市局、避免重大个股投资风险、减少投资损耗,竭力给持有人带来长期 特官的国籍

现17。3、参与估值滤程各方之间存在的任何重大利益冲突。估值委员会承承基金持有人利益至一的党官。在估量比的选择上 3、参与估值滤程各方之间存在的任何重大利益冲突。估值委员会承承基金持有人利益至一的党官。在估量比的选择上 力求客观。公允、在数值的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易模拟。本基金管理人旗下管理的基金。其参与估值流 程各方之间不存任何而生人和经址应

7.7. 公本令來、公元,在5項間別未來万面力求公开,获取方便、操作性強、不易換級。本基金管理人賦下管理的基金,其参与估值就程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超级 本基金管理人而未改没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。
4. 7. 管理人对按注则从基金种调价或指码的设明。
根据《长成沈化子级股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定。本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配的承帐,也会必要让仍不帐户或会分配是有单位基金的额收益分配金额一不能恢丁面值。
本基金本年度已分配利润2.413.465.77元,每10份基金的额分红0.400元。截止本报告期末,本基金可供分配利润为288,817.70元。

817.70元。

5. 托警人报告

1. 报告期内本基金托管人遵照守信情况间明

4. 报告期,中国建设银介政价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》、基金台同、托管协议和
其他有关规定、不存在销售基金价额持有人利益的行为。完全尽职尽开地履行了基金托管人应尽的文券。

5. 托信人对报告期内未基金投资运行编译可信,净值计算、利润价值等情况的规则

并发告期,本托官人按照临家有关规定、基金台间、托管协议和集份有关规定。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数。对本基金的投资运行方通查行工监督,表现是基金管理人有前债基金份额持有人利益的行

为。 报告期内,本基金实施利润分配的金额为2,413,465.77元。 53. 社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 本社管人政律查了本程中财务指标、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,保证复核内 容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 56. 弗比提供 等 6 审计报告 家 6 审计报告 家 6 事计报告 实水华明会计师事务所(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 审计报告会父 **2012** 年度 报告摘要

长城优化升级股票型证券投资基金

会计主体:长城优化升级股票型报告截止日: 2012年12月31日		单位:人民
资产	附注号	本期末 2012年12月31日
资产:		
银行存款		23,830,494.9
结算备付金		77,366.9
存出保证金		
交易性金融资产		51,902,975.
其中:股票投资		51,902,975.
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		4,805.
应收股利		
应收申购款		2,463.
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计		75,818,106.
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		
应付赎回款		2,120,950.
应付管理人报酬		78,214.
应付托管费		13,035.
应付销售服务费		
应付交易费用		42,743
应交税费		
应付利息		
		1,387,115.
应付利润 递延所得税负债		
递延所得税负债		112,993.
递延所得税负债 其他负债 负债合计		112,993. 3,755,053.i
递延所得税负债 其他负债 负债合计 所有者权益:		
递延所得税负债 其他负债 负债合计		
遊延所得税负债 其他负债 负债合计 所有者权益:		3,755,053.0

§ 7 年度财务报表

1)报告截止日2012年12月31日,基金份额产值1.039元,基金份额总额69.355,764.69份。 本基金合同于2012年4月20日生吃,本基金本朝财务报表的实际编制期间系目2012年4月20日(基金合同生效日)起 12月31日上。战化、尤上年度四比期间财务数据

会计主体:长城优化升级股票型证券投资基金 本报告期:2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

项目	附注号	本期 2012年4月20日(基金合同生效日)至 2012年12月31日
一、收入		8,707,774.73
1.利息收入		1,036,056.64
其中:存款利息收入		273,428.34
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		762,628.30
其他利息收入		-
2.投资收益 假失以 ""填列)		2,913,548.18
其中:股票投资收益		2,367,976.43
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		545,571.75
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)		4,112,182.97
4.汇兑收益 假失以""号填列)		-
5.其他收入 假失以 ""号填列)		645,986.94
减:二、费用		1,910,488.31
1.管理人报酬		1,267,784.82
2.托管费		211,297.50
3.销售服务费		=
4.交易费用		193,514.55
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		237,891.44
三、利润总额 (亏损总额以 ""号填列)		6,797,286.42
减:所得税费用		-
四、净利润(争亏损以""号填列)		6,797,286.42
注:本基金合同于2012年4月20日生效。本基金本期	财务报表的实际编制期间系	目2012年4月20日(基金合同生效日)起:
2012年12月31日止。因此,无上年度可比期间数据。		

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:长城优化升级股票型证券投资基金 本报告期;2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

项目	本期 2012年4月20日(基金合同生效日)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)	523,254,064.01	-	523,254,064.01	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,797,286.42	6,797,286.42	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (争值减少以""号填列)	-453,898,299.32	-1,676,532.23	-455,574,831.55	
其中:1.基金申购款	46,969,470.17	844,350.32	47,813,820.49	
2.基金赎回款	-500,867,769.49	-2,520,882.55	-503,388,652.04	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(争值减少以""号填列)	-	-2,413,465.77	-2,413,465.77	
五、期末所有者权益 健金净值)	69,355,764.69	2,707,288.42	72,063,053.11	

7-4. 遵循企业会计准则发其他有关规定的声明 本财务报复符合企业会计准则数要水,衰灾、完整地反映了本基金于2012年12月31日的财务状况以及自2012年4月20日 (基金合同生改日)至2012年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。 7-4.4 重要会计政策和设计估计

(4-4 無公益可取)來科於中區计 本基金財务投表所數數各信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所属定 的主要会计收棄和会计估计编制。 ·英文学》,从基础的新加工。1980年 · 本基金会计年度、用场开度,即每年1月1日起至12月31日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自2012年4月20日(基 · 国生效日)起至2012年12月31日止。

同生效日 1 局至2012年12月31日11。 7.442 记账本位币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。 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。 7.443 金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。 公金融企工会 ()金融资产分类 本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,贷款和应收款项。 本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具(主要系 权证投资);

权政投资);
②金融负债分类
本基金的金融负债于郊始确认时归类为以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前各的金融负债例分为其他金融负债。
14.44 金融资产的金融负债的初始确认。后续计量和终止确认
本基金计划金融,互信目的一方时确从一项金融资产应融负债。
为为4.44 金融资产的金融负债的初始确认。后续计量和终止确认
本基金计划金统计会员的一方时确认。可能会融资产的股票,债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得的公允价值计量且其变动计、当期损益的金融资产。2000年,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得的公允价值计量且其变动计、兰期损益的金融资产。2000年的自己成为企业和人当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计、兰期损益的金融资产业金融价价价值。安加,公司输入当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计、台期损益的金融资产业金融价价的企业计人当期损益。

918.91 栗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人账; 上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;

終致 終于成交日确认为儒券投资。儒券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用人账,其中所包含的儒券 经纯核源,不构成儒券投资成本, 复儒券类刚司制一次性还本付息的附息儒券,根据其次行价,到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,

安人令岛顺为环间共和国 按上述会计处理方法依算; 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 关人权证: 1或之日确认为权证投资。权证投资成本按成文日应支付的全部价款和除交易费用后人账; 卖出权证于成交日确认疗生工具投资收益。类出权证的成本按移动加权平均法于成交日结构。 (4)分离交易可转债 申聘朋友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计

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;

参与者对资产或负债定价申折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般果我变。 (1)上市流通的股票的估值 上市流通的股票的估值 上市流通的股票的估值 上市流通的股票的估值 上市流通的股票的估值 发现了。 (2)上市流通的股票的估值 上市流通的股票的估值 (2)上市流通的股票的标题, (2)上市流通的股票的标题, (3)上市流通的股票的标题, (3)上市流频率的标题, (3)上市流频率的标题, (3)上市流频率的标题, (4)上市流频率的标题, (4)上市流频率的标图, (5)上市流频率的标图, (5)上市流频率的标图, (5)上市流频率的标图, (6)上市流频率的标图, (6)上市流频率的形置, (6)上市流频率的形面, (6)上市流频率的, (6)上于流域的, (6)上于流域的 (6)上于

二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。 . 估值日在证券交易所止的支给的间一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,采用在证券交易所的同一 均市价价据值日该非公开发行股票的价值 . 估值日在证券交易所上的交易的同一股票的市价离于非公开发行股票的初始取得成本时,按中国证监会相关规定处

b. 管团口住证好来参加上中人。
2) 债券投资
3) 债券投资
(1) 债券投资
(1) 债券投资
(1) 证券交易所市场实产等价户交易的债券按估值口收盘价估值,估值日天交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化业务交易的有效。
(1) 证券交易所市场实产等等加工券价格的重大事件的。投资证文易目的收盘价估值,如最近交易日后经济环境发生了重大变速度分析的。
(2) 证券交易所市场未支证指款等增加支身局市、需要实现实人允许值、调整规定公易市价、确定公公允许值、证券总额、公司、证券交易所市场未实行的价交易的债券按估信日收益价值,通额处理公务市价、确定处理利息得约的价户进行估值自无交易的的最近交易目后经济环境发生了重大变化效应等发行机构发生了影响证券价格的重大事件。可参考按资品种的现代价值、但数据交易目后经济环境发生了主大变化效应等发行机构发生了影响证券价格的重大事件。可参考按公司未按公司未存在证据表明最近交易市价、确定公公允价值、和否定证据表明最近交易市价、确定公公价值。
(6) 未上市债券、交易所以大速交易方式转让设备产资油证券价格。采用估值技术确定公允价值,在估值技术单位可靠计量公价值的情况下,按成本进行回旋计量。
(6) 企会经报门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;
(6) 在全经保证券价值,每市场交易的债券。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;
(6) 在全经保证券价值。

3) 校正投资 (以上市流通等权证按估值日该权证在证券交易所的收金价估值。价值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大 且证券发行机场未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的收金价估值,如最近交易日后经济环境未发生重大 或证券发行机场发生了影响证明表明最近交易市价不能逐年支延公允价值,则是最近交易市后经济环境未发生了影响 顺定公元价值。如有充足证明表明最近交易市价不能逐年支延公允价值,则整最近交易市价、确定公允价值。 (公末上市流通的权证,采用价值技术确定公允价值,但有值技术规划,简计重公允价值的信息下,按放本计量; 4分割交易可称他,上旬日间,采用价值技术确定公允价值进行价值; 4分割交易可称他,上旬日间,采用价值技术分别对债券和权证进行估值; 由上市充通的债券和权证分别按上述 中的相关原则进行估值;

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,并于期末全额转人"未分配利润/累计亏损)"。
7-4.9 收入/保决/的商人取计量
(1)存款利息收入依存款的本金与适用的利率逐日计量的金额人账、若提前支取定期存款、按协议规定的利率及持有期重
新计算存款/包收入,并供抵益前支取为实动较到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入
(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排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。在债券头或持有期况逐日计划。
(2)债券为息息收入按债券等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 (2)货产发证。并足限人就证券等面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券收存企业代扣代缴的人人所

7.4.1.0 实际的测点。1日上海各产净值的,50%的年费率还目针是。
(2) 选点任管教授前一日基金资产净值的。50%的年费率还目计是。
(3) 卖出回购金融资产文出,按卖出回购金融资产的摊金成本及实际利率(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以该目针提。
(4) 其他费用系根据有关注规及相应协议规定,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,则来用停槽或预制的方法。
7.4.4.11 基金的设金分配政策
"本基金收益分配应通常"的原则。
(6) 本基金分配企业公司企业,在1000年,100

77亿税 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 。。 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 、受计方不再征收,税率不变;

所得稅注。 根据財政部。国家稅多总局財稅字(2005)103号文(关于股权分置试点改革有关稅收政策问题的通知)的規定。股权分置 改革中非流通股投充通过对价方式问流通股股东支付的股份。现金等收入。哲全的收流通股股东边缴纳的企业所得稅。 根据財政部。国家稅多总局财稅(2008)1号文(关于企业所得稅苦丁伐惠政策的通知)的规定、对证券稅资基金从证券市 场中取得的收入。包括买卖稅票、债券的差价收入。股权的股惠、红利收入、债券的利息收入及其他收入、暂在股企业所得

关联方名称

		金額甲位:人民市			
关联方名称	本期 2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日				
大峽万名你	成交金额	占当期股票 成交总额的比例			
长城证券	221,600.00	0.16%			
7.4.10.1.4权证交易	, 发方交易单元进行债券交易。 发方交易单元进行债券回购交易。				

关联方名称	2012 [£]	本期 2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日						
大块刀石桥	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	193.45	0.16%	-					
所买(卖)证管费等 管理人因此 7.4.8.2 关联	筝。 从关联方获取的其他服务主要包括		不限于买(卖)经手费、证券结算风险基 的证券投资研究成果和市场信息服务。					

本期 2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日

H为每日应支付的基金管理费 E为前一日的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 基金管理费日订提。按月支付、经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基 的产年一次性支付给基金管理人。 2.本期本本基金未支付的管理费余额人民币78.214.80元。 7.48.22 基金托管费

EXU.5% 可干C家则 前一日的基金资产净值 前一日的基金资产净值 好好的工作,可以是一个工作,但是一个工作,但是一个工作的人基金代替人于次月首日起5个工作日内从基 平一次性支付给基金行行。 本期末本基金本文付的托首党资金额人民币13,035,80元。

条期末本基金本文付別行告實宗網人於由13.0580元。 3 与吴族方诺代射行同型市场的债券含回购交易。 基金于本期未与吴族方进行银行间间域市场的债券含回购交易。 4 吴族方按设本基金的情况。 4.1 报告期内基金管理人不用压用菌有验金投资市基金的情况。 基金的基金管理人于本期未可服有资金投资市基金,于本期末亦未持有本基金份额。 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

关联方名称	本期末 2012年12月31日	
大阪万石州	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
长城证券	1,943,407.96	2.80%
东方证券	1,799,000.00	2.59%
7.4.8.5 由关联方	R管的银行存款余额及当期产生的利息收入	

关联方 名称	2012年4月20日(基金合同生效日)至2012年12月31日					
石怀	期末余額	当期利息收入				
中国建设银行	23,830,494.99	264,960.09				
7.4.8.6 本基金在承销期内参	№托管人中国建设银行保管,按银行间同则 与关联方承销证券的情况 明内直接购人关联方承销证券。	业利率计息。				

		除息日		每10份	现金形式	再投资形式	本期利润分	
序号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 红数	发放总额	发放总额	配 合计	备注
1	2012年12 月28日	2012年12 月31日	2012年12 月31日	0.200	1,303,137.14	83,978.05	1,387,115.19	
2	2012年10 月19日	2012年10 月22日	2012年10 月22日	0.200	943,853.60	82,496.98	1,026,350.58	
合计	-	-	-	0.400	2,246,990.74	166,475.03	2,413,465.77	

1	2012年12 月28日	2012年12 月31日	2012年12 月31日	0.200	1,303,137.14	83,978.05	1,387,115.19		
2	2012年10 月19日	2012年10 月22日	2012年10 月22日	0.200	943,853.60	82,496.98	1,026,350.58		
合计	-	-		0.400	2,246,990.74	166,475.03	2,413,465.77		
注:本基金丁资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的本间分配情况、请参阅本财务报表7.48.2资产负债表日后事 7.4.10 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券									
7.4.10	0.1 因认购第	·发/增发证券	新干期末持	有的流涌受阻	扩発				

7-4101 因认购新发增货证券而于期末特有的流通受限证券 注:本基金产本期末未持有团队的新发增货业等而流通受限的证券。 7-4102 期末持有的暂时停懈等流通受限股票 注:本基金产本期末未持有管时停懈等流通受限股票。 7-4103 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7-4103 1報行间市场债券正回 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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

	13.35,7593	23,7001104	F19975 34) (4-199-01) 4 or)
A	农、林、牧、渔业	456,800.00	0.63
В	采掘业	4,092,520.00	5.68
C	制造业	26,645,677.75	36.98
C0	食品、饮料	4,103,020.00	5.69
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,088,000.00	2.90
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	_
C7	机械、设备、仪表	6,287,300.00	8.72
C8	医药、生物制品	14,167,357.75	19.66
C99	其他制造业	-	_
D	电力、煤气及水的生产和供应业	_	-
E	建筑业	2,476,200.00	3.44
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,122,100.00	1.56
Н	批发和零售贸易	2,986,648.00	4.14
I	金融、保险业	13,210,430.00	18.33
J	房地产业	912,600.00	1.27
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	51,902,975.75	72.02

音	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	000568	泸州老窖	110,000	3,894,000.00	5.40
	2	601169	北京银行	280,000	2,604,000.00	3.61
6结 外,	3	600594	益佰制药	117,175	2,344,671.75	3.25
/r,	4	000513	丽珠集团	65,000	2,262,000.00	3.14
_	5	000999	华润三九	94,900	2,249,130.00	3.12
(日)。	6	600276	恒瑞医药	70,000	2,107,000.00	2.92
	7	600458	时代新材	160,000	2,088,000.00	2.90
]款	8	600690	青岛海尔	150,000	2,010,000.00	2.79
付, 回	9	601668	中国建筑	500,000	1,950,000.00	2.71
(1)	10	600062	华润双鹤	85,100	1,931,770.00	2.68

金额单位:人民币元

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.con 报告正义。_____ 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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

2,772,485.2

人股票成本 (成交)总额

注: 实人股票成本和卖出股票收入的按买卖或交金额(成交单价乘以成交数量)填 注: 本基金本报告期末未持有债券 注: 本基金本报告期末未持有债券 注: 本基金本报告期末未持有债券 注: 本基金本报告期末未持有债券 若: 期末被办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 注: 本基金本报告期末未持有债券 提: 本基金本报告期末未持有债产支持证券。 器. 期末校办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价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。 8.9.1 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

单位:人民币 2,463.0

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 持有人户数(户) 27,920,770.63 41,434,994.06 59.74% 9.2 期末基金管理人的从业人

523,254,064.01 500,867,769.4

11.2 基金管理人、基金管性人的专用基础工程的。由此人中采购 1.基金管理人基本人事态的 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 彭供政先生和承绍先生分公司副总经理。 2.基金件管人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 资格已经中国证监会审核批准(证信许可 [2012]1036号)。 职政格已经中国证监会审核批准(证信许可 [2012]1036号)。

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.目前分本基金提供审计服务的会计师事务所的报酬为人民币肆万元。 3.目前分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, 韩殊普通合伙), 为本基金提供审计服务自基金会同生效日持续至本报告期。

成交金額 占当别权示 成交总额的比例 佣金

东兴证券	1	23,050,825.06	16.17%	19,645.94	15.99%	-
中信建投	1	21,857,293.66	15.34%	17,759.34	14.46%	-
民生证券	1	16,970,579.68	11.91%	15,449.94	12.58%	-
银河证券	2	16,800,890.65	11.79%	14,673.12	11.95%	-
中投证券	2	12,636,829.27	8.87%	10,408.64	8.47%	-
渤海证券	1	11,713,103.99	8.22%	10,663.74	8.68%	-
兴业证券	1	7,984,341.18	5.60%	7,065.29	5.75%	-
中信证券	1	1,223,000.00	0.86%	1,113.43	0.91%	-
中金公司	1	993,100.00	0.70%	841.65	0.69%	-
长城证券	3	221,600.00	0.16%	193.45	0.16%	-
平安证券	2	-	-	-	_	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	_	-	-	_	-
华西证券	1	-	-	-	_	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	_	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	_	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

本报告期內共新確全个交易单元。截止本报告期末共计36个交易单元。
2、专用交易单元的选择他和程序
本基金管理人员进退标记即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;
(1)实力堆原,信曹技术上进附在水平分74亿元人民币;
(2)财务状况良好。各项协分指标显示公司经营技况稳定;
(3)经营行为规范。基础可非未发生重大生量所分布受到中国证监会处罚;
(4)内部管理规范。严格、具备能全约内控制度,并能满足基金定任命度保密的要求;
(5)具备基金运作所需的高效 安全的抽作来及,并能满足基金定任命度保密的要求;
(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、指报上资本业务解创定。是金管型人和股市。
据报上资本业务解创定,是金管型人和废止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交少发进券的成交量、支付的服金等人投源。
据为工资和成交量、支付的服金等人投源。
11.7.2 基金相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	成交金額	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
国金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	940,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	_	-	-	-
民生证券	-	-	_	-	-	-
银河证券		-	-	-	-	-
中投证券		-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	_	-	-	-
兴业证券	-	-	_	-	-	-
中信证券	-	-	_	-	-	_
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
平安证券		-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国		-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方证券		-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	_
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	- 交表注意的目佈書	-	-	-

\$12 影响投资者决策的异他重要信息 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。