# 景顺长城中小盘股票型证券投资基金

## 2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

基金管理人:景顺长城基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2014 年 3 月 24 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。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 2013 年 12 月 31 日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 景顺长城中小盘股票 |
| 基金主代码 | 260115 |
| 交易代码 | 260115 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年 3 月 22 日 |
| 基金管理人 | 景顺长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,013,271,407.21 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过投资于具有高成长潜力的中小型优势企业,充分把握其高成长特性和市值高速扩张所带来的投资机会,追求基金资产的长期资本增值,以超过业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 资产配置:基金经理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。<br>股票投资策略:本基金股票投资遵循"自下而上"的个股选择策略,制定相应的投资策略,本基金在对投资标的进行研究筛选时,将从定性及定量两个方面加以考察分析。<br>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。 |
| 业绩比较基准 | 中证 700 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,其预期风险收益水平高于债券型基金与混合型基金。本基金主要投资于中小盘股票,在股票型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 杨皞阳 | 赵会军 |
| | 联系电话 | 0755-82370388 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | investor@invescogreatwall.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4008888606 | 95588 |
| 传真 | | 0755-22381339 | 010-66105798 |

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.invescogreatwall.com |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人的办公场所 |

### §3 主要财务指标、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 | 2013年 | 2012年 | 2011年 3 月 22 日(基金合同生效日)-2011 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 286,973,007.43 | -91,129,810.56 | -250,430,012.40 |
| 本期利润 | 337,485,288.20 | 5,730,811.32 | -362,178,520.82 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3235 | 0.0040 | -0.2047 |
| 本期基金份额净值增长率 | 39.40% | 0.75% | -20.40% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2013年末 | 2012年末 | 2011年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0784 | -0.2158 | -0.2044 |
| 期末基金资产净值 | 1,132,936,783.23 | 1,029,702,942.18 | 1,247,510,078.84 |
| 期末基金份额净值 | 1.118 | 0.802 | 0.796 |

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。

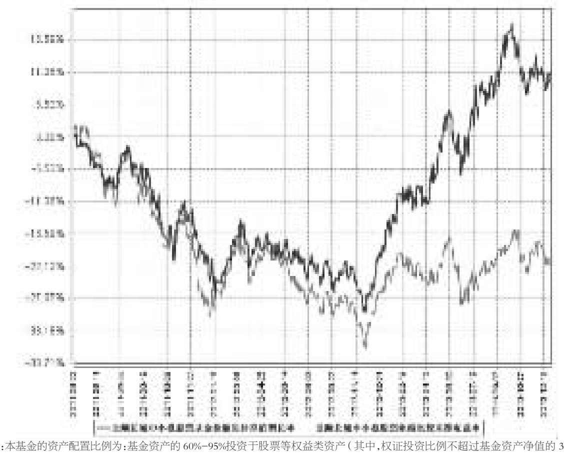
4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

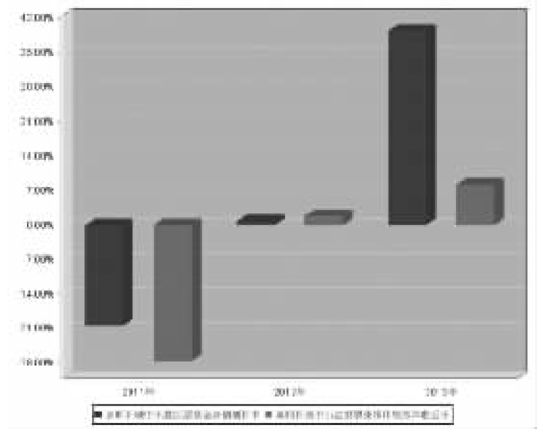
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -5.01% | 1.01% | -1.68% | 1.07% | -3.33% | -0.06% |
| 过去六个月 | 16.82% | 1.22% | 10.89% | 1.09% | 5.93% | 0.13% |
| 过去一年 | 39.40% | 1.30% | 8.17% | 1.13% | 31.23% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.80% | 1.18% | -20.33% | 1.16% | 32.13% | 0.02% |

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:本基金的资产配置比例为:基金资产的 60%-95%投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),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%)。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。本基金的建仓期为自 2011 年 3 月 22 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。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:2011 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2011 年 3 月 22 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

基金合同生效日(2011 年 3 月 22 日)至本报告期末期间,本基金未进行利润分配。

### §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 12 月 31 日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 29 只开放式基金,包括管理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(ETF)、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(ETF)、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(ETF)。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 | | |
| 杨鹏 | 本基金基金经理,景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理 | 2011年 3 月 22 日 | - | 9 | 经济学硕士。曾任职于融通基金研究策划部,担任宏观研究员、债券研究员和货币基金基金经理助理职务。2008 年 3 月加入本公司,担任研究员等职务;自 2010 年 8 月起担任基金经理。 |
| 王鹏辉 | 本基金基金经理,景顺长城内需增长开放式证券投资基金基金经理,景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金基金经理,景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理,股票投资部投资总监 | 2011年 3 月 22 日 | 2013年 9 月 16 日 | 12 | 经济学硕士。曾先后担任深圳市农村商业银行资金部债券交易员、长城证券研究部研究员、融通基金研究策划部行业研究员。2007 年 3 月加入本公司,担任研究员等职务;自 2007 年 9 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。

3、王鹏辉先生于 2014 年 1 月 23 日起担任本公司副总经理职务。

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《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、《景顺长城中小盘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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人(以下简称"本公司")投资和交易管理,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》等法律法规,本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》,该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下:

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和权限划分;建立客观的研究方法,任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持,避免主观臆断,严禁利用内幕信息作为投资依据;确保所有投资组合平等地享有研究成果;根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等,建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库,投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度,将投资管理职能和交易执行职能相隔离;建立公平的交易分配机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时,需根据价格优先、比例分配的原则,经过公平性审核,公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控,风险管理与绩效评估岗于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗内(如 1 日内、3 日、5 日内)公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析,对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释,由投资组合经理、督察长、总经理签署后,妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内,公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况,应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制,针对潜在问题完善公平交易制度,并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011 年修订)》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现异常交易情况。

4.3.3 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

2013 年的 A 股市场,走出了反差鲜明的结构性行情。风格对比和行业差异非常明显,代表大盘蓝筹的中证 100 指数跌幅超过 10%,而代表小型成长股的创业板指数涨幅超过 80%,中证 700 指数全年上涨 10.09%;周期性行业的代表煤炭行业全年下跌超过 40%,而传媒行业借移动互联东风、弄收购兼并大潮,演绎了波澜壮阔的翻番行情。

本基金重点配置了受益移动互联网的传媒、信息行业和经济转型相关受益的医药、环保等行业,有幸分享了新兴行业带来的超额收益,而规避化工、有色、煤炭等周期性行业也为组合贡献了超额收益。

但下半年的操作略显保守,降低了股票仓位,为规避风险,降低了传媒等高估值行业配置,增加了低估值的房地产行业配置,为组合带来较大的负贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013 年度,本基金份额净值增长率为 39.40%,高于业绩比较基准收益率 31.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济

2013 年的经济形势,正如我们在 2012 年年报中展望的,受制于信贷、房价、环保、劳动力人口等多重因素,复杂严峻。新一届政府不再单纯追求 GDP 数字,运用刺激政策更加理性节制,年初的盲目乐观者逐季下调预期。展望 2014 年的宏观形势,我们仍不乐观,一方面资金供应者的期望收益率在快速抬高,淘宝余额宝、百度、网易、微信等理财新渠道唤醒了全民的活期理财意识,人人贷等曾经陌生的字眼变成了普通居民的日常投资工具,银行的资金成本在明显走高,发放较低利率贷款包括住房按揭贷款的意愿和能力都显著下降;另一方面市场利率高企,而前期的大规模融资也陆续进入兑付和风险暴露窗口,期限利差缩窄、信用利差扩大,短期融资成本陡升,地方融资平台等对于中小企业的融资挤出效应愈加明显,小微借款人被迫承受远高于贷款利率的资金成本,实业经营的困难显著增加、吸引力下降,实业投资带动经济增长的前景并不乐观。

但另一方面,结构转型的趋势更加明朗,2013 年堪比全民理财的另一热点现象是全民游戏,微信 5.0 一度带动数亿用户尝试手机游戏,服务体验和平台粘性超越了成本毛利和销量规模,成为企业判断的新"关键词"。或许制造业面临暂时的困难不可避免,但我们期盼已久的产业升级、结构调整、服务业占比提升等由此展开。

证券市场

我们认为 A 股市场整体仍处在相对底部区域,长期来看 A 股已经能为投资者提供优于其他资产和地区的良好投资价值,但转型和成长仍将是市场的主题。

行业走势

展望未来,我们仍然坚信中国经济的转型终将成功,产业结构升级和消费升级的趋势不可逆转,成长型中小市值公司将成为改革红利释放的最大受益者,民营经济的活力必将得到释放,会有一大批中小市值公司成长起来。我们将更加重视自下而上的精选个股,估值与成长性并重,重点关注新兴产业和消费行业,从中发掘良好的投资机会。

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

本报告期内,本基金托管人在对景顺长城中小盘股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,景顺长城中小盘股票型证券投资基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在景顺长城中小盘股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,景顺长城中小盘股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的景顺长城中小盘股票型证券投资基金 2013 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

本报告期内,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)对本基金出具了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:景顺长城中小盘股票型证券投资基金
报告截止日:2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2013年 12 月 31 日 | 上年度末 2012年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | | 38,123,323.44 | 72,805,671.42 |
| 结算备付金 | | 908,780.98 | 926,485.75 |
| 存出保证金 | | 381,349.52 | 1,173,630.99 |
| 交易性金融资产 | | 1,018,545,685.13 | 957,536,528.16 |
| 其中:股票投资 | | 799,353,685.13 | 887,596,528.16 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 219,192,000.00 | 69,940,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 63,200,000.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 1,014,972.22 | - |
| 应收利息 | | 5,531,494.84 | 1,062,871.67 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 10,184,738.66 | 46,494.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 1,137,890,344.79 | 1,033,551,682.04 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013年 12 月 31 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 2,170,945.64 | 1,246,628.46 |
| 应付管理人报酬 | | 1,436,260.40 | 1,276,369.73 |
| 应付托管费 | | 239,376.73 | 212,728.32 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 910,567.15 | 666,157.01 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 196,411.64 | 446,856.34 |
| 负债合计 | | 4,953,561.56 | 3,848,739.86 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 1,013,271,407.21 | 1,284,426,880.37 |
| 未分配利润 | | 119,665,376.02 | -254,723,938.19 |
| 所有者权益合计 | | 1,132,936,783.23 | 1,029,702,942.18 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,137,890,344.79 | 1,033,551,682.04 |

注:报告截止日 2013 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.118 元,基金份额总额 1,013,271,407.21 份。

7.2 利润表

会计主体:景顺长城中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 361,183,815.31 | 30,130,505.03 |
| 1.利息收入 | | 5,251,018.41 | 3,363,683.98 |
| 其中:存款利息收入 | | 953,093.44 | 751,884.92 |
| 债券利息收入 | | 3,901,743.39 | 2,537,977.64 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 396,181.58 | 73,821.42 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 304,777,177.21 | -70,330,258.95 |
| 其中:股票投资收益 | | 298,720,701.88 | -82,850,786.99 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 268,850.00 | 350,620.00 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 5,787,625.33 | 12,169,908.04 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | 50,512,280.77 | 96,860,621.88 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | | 643,338.92 | 236,458.12 |
| 减:二、费用 | | 23,698,527.11 | 24,399,693.71 |
| 1. 管理人报酬 | | 15,595,681.23 | 16,781,704.60 |
| 2. 托管费 | | 2,599,280.22 | 2,796,950.75 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 5,075,598.62 | 4,404,760.27 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 427,967.04 | 416,278.09 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 337,485,288.20 | 5,730,811.32 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 337,485,288.20 | 5,730,811.32 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:景顺长城中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年 1 月 1 日至 2013 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) | 1,284,426,880.37 | -254,723,938.19 | 1,029,702,942.18 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 337,485,288.20 | 337,485,288.20 |
| 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) | -271,155,473.16 | 36,904,026.01 | -234,251,447.15 |
| 其中:1.基金申购款 | 902,063,313.09 | 113,655,978.92 | 1,015,719,292.01 |
| 2.基金赎回款 | -1,173,218,786.25 | -76,751,952.91 | -1,249,970,739.16 |
| 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) | 1,013,271,407.21 | 119,665,376.02 | 1,132,936,783.23 |

| 项目 | 上年度可比期间 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) | 1,567,965,375.28 | -320,455,296.44 | 1,247,510,078.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 5,730,811.32 | 5,730,811.32 |
| 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) | -283,538,494.91 | 60,000,546.93 | -223,537,947.98 |
| 其中:1.基金申购款 | 56,998,593.98 | -13,373,045.49 | 43,625,548.49 |
| 2.基金赎回款 | -340,537,088.89 | 73,373,592.42 | -267,163,496.47 |
| 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) | 1,284,426,880.37 | -254,723,938.19 | 1,029,702,942.18 |

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:

| | | |
|---|---|---|
| 许义明 | 吴建军 | 邵媛媛 |
| 基金管理人负责人 | 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

景顺长城中小盘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【2011】41 号文《关于核准景顺长城中小盘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向社会公开募集,基金合同于 2011 年 3 月 22 日生效。首次设立募集规模为 2,062,589,600.71 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。(以下简称"中国工商银行")

本基金主要投资范围限于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(包括在中小板、创业板上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 60%-95%投资于股票等权益类资产(其中,权证投资比例不超过基金资产净值的 3%),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%)。本基金投资于中小盘股票的资产不低于基金股票资产的 80%。本基金业绩比较基准为:中证 700 指数×80%+中证全债指数×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制。同时,在具体会计估值核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他相关规定。

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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对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)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 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、注册登记人、基金销售机构 |
| 中国工商银行 | 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 |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注: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 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 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 | - | - | 11,519,754.50 | 0.39% |

7.4.8.1.2 权证交易

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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年 1 月 1 日至 2013 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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 9,359.89 | 0.37% | - | - |

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方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 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 15,595,681.23 | 16,781,704.60 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 5,013,576.94 | 4,760,199.81 |

注:1)基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/ 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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2)基金管理费于 2013 年末尚未支付的金额为 1,436,260.40 元,于 2012 年末尚未支付的金额为 1,276,369.73 元。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,599,280.22 | 2,796,950.75 |

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,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2)基金托管费于 2013 年末尚未支付的金额为 239,376.73 元,于 2012 年末尚未支付的金额为 212,728.32 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

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

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本基金。

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

本基金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 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2012年 1 月 1 日至 2012 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 |
| 中国工商银行 | 38,123,323.44 | 926,317.50 | 72,805,671.42 | 730,542.75 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,并按银行间同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2013 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.9.2 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。

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,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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2014 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

### §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 | 799,353,685.13 | 70.25 |
| | 其中:股票 | 799,353,685.13 | 70.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 219,192,000.00 | 19.26 |
| | 其中:债券 | 219,192,000.00 | 19.26 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 63,200,000.00 | 5.55 |
| | 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 | 39,032,104.42 | 3.43 |
| 6 | 其他各项资产 | 17,112,555.24 | 1.50 |
| 7 | 合计 | 1,137,890,344.79 | 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 | 6,647,389.54 | 0.59 |
| B | 采矿业 | 10,909,008.00 | 0.96 |
| C | 制造业 | 592,134,618.47 | 52.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | 56,162,437.19 | 4.96 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 67,726,936.61 | 5.98 |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,626,925.00 | 1.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 42,641,812.12 | 3.76 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,504,558.20 | 0.49 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 799,353,685.13 | 70.56 |

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 | 300124 | 汇川技术 | 1,332,730 | 77,951,377.70 | 6.88 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 1,562,126 | 37,959,661.80 | 3.35 |
| 3 | 601299 | 中国北车 | 7,676,205 | 37,766,928.60 | 3.33 |
| 4 | 002292 | 奥飞动漫 | 1,131,352 | 36,949,956.32 | 3.26 |
| 5 | 000069 | 华侨城 A | 6,579,346 | 34,870,533.80 | 3.08 |
| 6 | 002376 | 新北洋 | 2,931,118 | 32,242,298.00 | 2.85 |
| 7 | 000024 | 招商地产 | 1,496,206 | 31,091,160.68 | 2.74 |
| 8 | 600867 | 通化东宝 | 1,975,755 | 30,248,809.05 | 2.67 |
| 9 | 002185 | 华天科技 | 2,589,418 | 28,509,492.18 | 2.52 |
| 10 | 300026 | 红日药业 | 755,212 | 28,214,720.32 | 2.49 |

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 | 600804 | 鹏博士 | 48,497,376.86 | 4.71 |
| 2 | 300039 | 上海凯宝 | 46,291,534.85 | 4.50 |
| 3 | 000069 | 华侨城 A | 40,951,219.77 | 3.98 |
| 4 | 002038 | 双鹭药业 | 39,665,602.33 | 3.85 |
| 5 | 000024 | 招商地产 | 39,273,198.85 | 3.81 |
| 6 | 002292 | 奥飞动漫 | 38,157,301.64 | 3.71 |
| 7 | 600583 | 海油工程 | 36,145,750.16 | 3.51 |
| 8 | 600699 | 均胜电子 | 32,138,833.75 | 3.12 |
| 9 | 002376 | 新北洋 | 31,261,537.82 | 3.04 |
| 10 | 002185 | 华天科技 | 28,664,916.22 | 2.78 |
| 11 | 000671 | 阳 光 城 | 28,397,711.18 | 2.76 |
| 12 | 601766 | 中国南车 | 27,834,597.89 | 2.70 |
| 13 | 300050 | 世纪鼎利 | 26,853,086.45 | 2.61 |
| 14 | 000100 | TCL 集团 | 26,148,177.00 | 2.54 |
| 15 | 300170 | 汉得信息 | 25,884,764.52 | 2.51 |
| 16 | 600867 | 通化东宝 | 25,852,987.93 | 2.51 |
| 17 | 300332 | 天壕节能 | 25,243,160.02 | 2.45 |
| 18 | 002011 | 盾安环境 | 24,668,677.02 | 2.40 |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 23,827,804.73 | 2.31 |
| 20 | 002450 | 康得新 | 23,364,051.80 | 2.27 |
| 21 | 300124 | 汇川技术 | 22,385,474.60 | 2.17 |
| 22 | 601238 | 广汽集团 | 22,194,736.65 | 2.16 |
| 23 | 600104 | 上汽集团 | 21,589,035.60 | 2.10 |
| 24 | 300146 | 汤臣倍健 | 21,497,724.74 | 2.09 |

注:买入金额按成交金额(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 | 600637 | 百视通 | 109,511,242.94 | 10.64 |
| 2 | 300027 | 华谊兄弟 | 93,074,455.39 | 9.04 |
| 3 | 300133 | 华策影视 | 91,693,367.56 | 8.90 |
| 4 | 000887 | 中鼎股份 | 62,690,993.89 | 6.09 |
| 5 | 000661 | 长春高新 | 57,474,874.09 | 5.58 |
| 6 | 300182 | 捷成股份 | 53,010,151.83 | 5.15 |
| 7 | 300124 | 汇川技术 | 52,968,555.66 | 5.14 |
| 8 | 000826 | 桑德环境 | 52,431,735.25 | 5.09 |
| 9 | 000423 | 东阿阿胶 | 50,480,636.31 | 4.90 |
| 10 | 300039 | 上海凯宝 | 47,931,266.40 | 4.65 |
| 11 | 002422 | 科伦药业 | 47,645,717.22 | 4.63 |
| 12 | 002038 | 双鹭药业 | 42,371,263.30 | 4.11 |
| 13 | 300026 | 红日药业 | 40,969,861.71 | 3.98 |
| 14 | 000024 | 招商地产 | 39,569,758.72 | 3.84 |
| 15 | 002450 | 康得新 | 39,116,218.87 | 3.80 |
| 16 | 000430 | 张家界 | 36,498,595.40 | 3.54 |
| 17 | 002011 | 盾安环境 | 36,447,653.05 | 3.54 |
| 18 | 600804 | 鹏博士 | 32,256,205.78 | 3.13 |
| 19 | 300132 | 青松股份 | 30,976,017.16 | 3.01 |
| 20 | 000538 | 云南白药 | 28,871,952.04 | 2.80 |
| 21 | 600583 | 海油工程 | 26,003,344.27 | 2.53 |
| 22 | 300332 | 天壕节能 | 25,745,808.47 | 2.50 |
| 23 | 300251 | 光线传媒 | 25,128,435.97 | 2.44 |
| 24 | 300050 | 世纪鼎利 | 23,463,078.60 | 2.28 |
| 25 | 300146 | 汤臣倍健 | 23,352,239.25 | 2.27 |
| 26 | 300170 | 汉得信息 | 23,215,635.59 | 2.25 |
| 27 | 600104 | 上汽集团 | 21,951,883.68 | 2.13 |
| 28 | 000400 | 许继电气 | 21,854,938.79 | 2.12 |
| 29 | 000100 | TCL 集团 | 21,845,842.79 | 2.12 |

注:卖出金额按成交金额(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 | 1,377,435,424.41 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 1,814,808,060.09 |

注:买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均按买卖股票成交金额(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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 219,192,000.00 | 19.35 |
| | 其中:政策性金融债 | 219,192,000.00 | 19.35 |
| 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 | 219,192,000.00 | 19.35 |

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 | 130201 | 13国开 01 | 1,000,000 | 99,990,000.00 | 8.83 |
| 2 | 130236 | 13国开 36 | 700,000 | 69,517,000.00 | 6.14 |
| 3 | 130218 | 13国开 18 | 500,000 | 49,685,000.00 | 4.39 |

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定,本基金投资范围不包括国债期货。

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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 | 381,349.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,014,972.22 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,531,494.84 |
| 5 | 应收申购款 | 10,184,738.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 17,112,555.24 |

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处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### §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 |
| 16,501 | 61,406.67 | 123,776,199.99 | 12.22% | 889,495,207.22 | 87.78% |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2011 年 3 月 22 日)基金份额总额 | 2,062,589,600.71 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,284,426,880.37 |
| 本报告期基金总申购份额 | 902,063,313.09 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,173,218,786.25 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,013,271,407.21 |

注:总申购份额含转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §11 重大事件揭示

11.1 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。

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

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,并向中国证券投资基金业协会备案。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。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 3 年为本基金提供审计服务,本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 90,000.00 元。

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。

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 | |
| 华创证券有限责任公司 | 1 | 807,777,726.03 | 25.32% | 728,226.61 | 25.19% | 未变更 |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 503,873,334.81 | 15.80% | 458,725.64 | 15.87% | 未变更 |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | 436,598,211.66 | 13.69% | 397,129.63 | 13.74% | 未变更 |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 315,627,946.52 | 9.89% | 285,295.29 | 9.87% | 未变更 |
| 兴业证券股份有限公司 | 1 | 296,757,920.73 | 9.30% | 266,773.70 | 9.23% | 未变更 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 1 | 268,480,581.48 | 8.42% | 243,790.12 | 8.43% | 未变更 |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | 229,994,766.87 | 7.21% | 209,387.63 | 7.24% | 未变更 |
| 国金证券股份有限公司 | 1 | 158,168,991.48 | 4.96% | 143,996.65 | 4.98% | 未变更 |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 120,092,293.84 | 3.76% | 109,331.36 | 3.78% | 未变更 |
| 民生证券股份有限公司 | 1 | 32,430,407.96 | 1.02% | 29,524.78 | 1.02% | 未变更 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 14,681,629.16 | 0.46% | 13,365.87 | 0.46% | 未变更 |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | 5,303,945.96 | 0.17% | 4,828.43 | 0.17% | 未变更 |
| 长城证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 方正证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | 未变更 |
| 中国国际金融有限公司 | 2 | - | - | - | - | 未变更 |

注: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。

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 |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | 381,800,000.00 | 68.84% | - | - |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | 120,900,000.00 | 21.80% | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | - | - | 20,000,000.00 | 3.61% | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | 31,900,000.00 | 5.75% | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | - | - | - | - | - | - |

景顺长城基金管理有限公司
2014 年 3 月 26 日