# 

### § 1 重要提示

是示 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、推确性 个别及连帮的连维责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事客写同意,并由董事长至发。 人中国及业银开股份有限公司继承基金合同规定于 2015年 60 月 26 日复校了本报告中的财务指标。净值表 设定,财务分计报告,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。 人术诺以诚实信用,遗物尽量的原则管理斯应用基金资产。但不保证基金一定通 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

本年度报告擴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2014年01月01日起至12月31日止。

基金简称		长城久嘉封闭			
场内简称		基金久嘉	基金久嘉		
基金主代码		184722	184722		
交易代码		184722	184722		
基金运作方式		契约型封闭式			
基金合同生效日		2002年7月5	H		
基金管理人		长城基金管理	有限公司		
基金托管人		中国农业银行	股份有限公司		
报告期末基金份额总额		2,000,000,000.	00 份		
基金合同存续期		15年			
基金份额上市的证券?	と 易所	深圳证券交易	所		
上市日期		2002年8月27	· H		
2.2 基金产品说明					
投资目标		为投资者减少	>和分散投资风险	2,确保基金资产的安全并谋求长期稳定的收益	
投资策略		投资的市场时	根据中国证券市场的特点,本基金将极其注重对市场整体趋势的把握,重视对 投资的市场市场选择。本金将注重评判与把握不同类别投资市场的整体风 险与收益,在不同阶段合理配置基金资产在股票,债券,现金的分配比例		
业绩比较基准		上证 A 股指數	X.		
风险收益特征		中性的风险值 于比较基准数	好,力争实现年 幅的 60%,在市	度内基金单位资产净值在市场下跌时跌幅不 汤上涨时增幅不低于比较基准的 70%。	
2.3 基金管理人和					
珂	İB	基金管理/		基金托管人	
名称		长城基金管理有	限公司	中国农业银行股份有限公司	
	姓名	车君		林葛	
信息披露负责人	联系电话	0755-23982	338	010-66060069	
	电子邮箱	chejun@ccfund.o	om.cn	tgxxpl@abchina.com	
客户服务电话		400-8868-6	666	95599	
传真		0755-23982	328	010-68121816	
2.4信息披露方式	文的管理人互联网网址			www.ccfund.com.cn	
			New English and present of		
基金年度报告备置地点			深川市福田区3	益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	

3.1 主要会计数据和财务指标 3.1.1 期间数据和指标

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金工产等驱业项目的小区台市行币人义勿需要的各类项用。1人页用用来的收益水下安顷1 用为64年。 3.2 基金份额邻值增长率及其与同期业绩比较基制收益率的比较						
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	6.64%	1.50%	36.97%	3.56%	-30.33%	-2.06%
过去六个月	17.86%	1.40%	58.03%	2.77%	-40.17%	-1.37%
过去一年	15.02%	1.54%	53.06%	2.49%	-38.04%	-0.95%
过去三年	23.88%	1.78%	47.10%	2.40%	-23.22%	-0.62%
过去五年	0.34%	1.91%	-1.40%	2.50%	1.74%	-0.59%
自基金合同生效 日起至今	362.44%	2.77%	88.61%	3.37%	273.83%	-0.60%
3 2 2 白基全台	・同生効以来其合	8份經界计净值	曾长率亦动及甘	片同期心緒比较过	t/相比达率恋别的I+4	ds.



于本基金资产净值的 20%。 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

				-
40.00%				_
1258%				_
556%				_
23.00%				
1100				_
100%				
7.00%	1000			
7.1022			90	
2.04%		_		
233			-	
2.06%		ш	_	
2.06% 7.76%		Ш	_	

3.3 过去三年基金的利润分配情况 注:本基金过去三年未发生过利润分配的情况。 **S.4 管理人报告** 

姓名	职务	任本基金的基金	6经理(助理)期限	证券从业年限	说明
X±45	87.95	任职日期	离任日期	NEST/MARTHUR	0091
蒋劲刚	久嘉证券投资基 金的基金经理	2012年3月7 日	_	16年	男,中国籍。天津大学材料系工学学士、天津大学管理学院工学硕士。管館即于採圳市华为技术有限公司。海南富岛资产管理有限公司。2011年10月北人民越基金管理有限公司,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、机构理财部投资经理、长城消费增值股票基金的基金经理。
乔春	久嘉证券投资基 金的基金经理	2014年9月16日	_	<b>4</b> 年	男,中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士、具有4年证券从业经历。2010年进入长城基金管理有限公司、管任行业研究员、"长城安心回报混合型证券投资基金"基金经理助理。
注:0	)上述任职日期、	离任日期根据2	公司做出决定的任	免日期填写。	

6. 本程与期於古以久。本选金寶思、賦下投資组合的同问交易於多均任合理范围內,结果付合相天政東法規和公司制度的規定。
4.3 异常交易行为的专项说明
报告期內未及观定基金存在异常交易行为,沒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滤证券当日成交融的%的现象。
4.4 管理人对往告期內基金的投資策略和业绩表现的说明
4.4 管理人对往告期內基金的投资策略和业绩表现的说明
4.1 报告期內基金投资策略和运作分析
6.结 2014 中的股市、下半年市场主要取指以 60%的涨幅使 A 股年度牛冠全球。股市井喷式上涨可以归结于无风险利率下行滞来的大盘高弱投估的上升或及靠结核增型驱动等。但更为直接的原因是外围资金借助于各种金融创新工具投资分及差较营产规。了资金推动型中市、如果实用把这整件市场长到 2012 年度来看,中国交过量中的风格公司并没有分别是共且经常常等到股级。经济基本面没有多大起色、市场参与者多组经效量子状况是、制造题材、排促"风口"。2014 年內基金採厂"大政分商"选度偏影"的行业位置编制并将合成长任他的信债特态 使发水随量给 在公司两十人保险公司下,上述策略导致业绩难以表现在是、业绩要突出、必须采取收收缩的行业配置策略,但同时也会面临着婚情市场市委的风险。

及使用的问题方法及产品的问题方法。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第9封结。 第1封结。 第1与结结。 第1与

估值数据。 4. 管理人对报告期内基金和阅分配情况的说明 根据《久嘉证券投资基金基金合同》关于收益分量原则的规定。基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%;基金当 年收益应先综补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配,就会投资当年亏损,则不进行收益分配。 本金 2014年度合计已分配利润 0.00元,截止年报告期末,本基金可供分配制商为 129,307,522.60元,不进行年度收益 分配。

分配。

\$5. 报告期内本基金托管人遵规守信情况 即明 在七年次日到水、华盛业中以70世种间为 - 129,301,522.69 元、不进行牛度収益 

\$5. 报告期内本基金托管人遵规守信情况 即明 在七千官久盖证券投资基金法》相关法律法规的规定 
以及《久盖证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定 
以及《久盖证券投资基金法金间》、久嘉证券投资金托管协议》的约定、对久嘉证券投资基金语型人一长城基金管理人 
例公司2014年1月1日至2014年12月31日基金的投资运作。进行了认真 独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了 
社会人的文学 
没有从事任印的非常基金份额得有人和运的行为。 

为16年次,对16年次,为16年次,对16年次,为16年次

等问题上、不存在损害基金价额评算人对验的订为;在状态中的"为一切是少少为地方还是是最强化。"为一方面的变作。在校报展基金台间的规定进行。

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
本托管人以为、长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定。基金管理人所编制和披露的久嘉证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实。准确、完整、未发现有损害基金持有人和适的行为。

5.6 审计报告

6.1 审计报告基本信息 安永华明会计师事务所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。 第7 年度财务报表

7.1 资产负债表 会计主体:久嘉证券投资基金

## 久嘉证券投资基金

## **2014** 年度 报告摘要

### 2014年12月31日

报告截止日:	2014年12月	31 ⊟

			単位:人民巾
资产	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		110,953,965.22	149,447,907.24
结算备付金		2,844,446.36	192,973.34
存出保证金		246,436.62	296,988.03
交易性金融资产		1,913,272,765.38	1,589,847,100.38
其中:股票投资		1,495,811,265.38	1,207,383,100.38
基金投资		_	
债券投资		417,461,500.00	382,464,000.00
资产支持证券投资		-	_
贵金属投资		-	_
衍生金融资产		_	-
买人返售金融资产		-	30,000,165.00
应收证券清算款		3,484,087.64	
应收利息		7,309,354,17	4.765.496.97
应收股利		_	_
应收申购款		-	-
递延所得税资产		_	_
其他资产		-	-
资产总计		2.038.111.055.39	1,774,550,630.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年 12 月 31 日	上年度末 2013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		_	2,927,120.82
应付赎回款		_	-
应付管理人报酬		2,591,875.23	2,247,257.71
应付托管费		431,979.21	374,542.96
应付销售服务费		_	-
应付交易费用		914,850.51	455,015.76
应交税费		6,609.30	6,609.30
应付利息		-	_
应付利润		-	-
递延所得税负债		_	-
其他负债		704,500.00	704,500.00
负债合计		4,649,814.25	6,715,046.55
所有者权益:			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润		33,461,241.14	-232,164,415.59
所有者权益合计		2,033,461,241.14	1,767,835,584.41
负债和所有者权益总计		2.038.111.055.39	1,774,550,630.96
	日,基金份额净值人	民市 1.0167 元,基金份额总额 2,000,00	

7.2 利润农 会计主体: 久嘉证券投资基金 本报告期: 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

本版日列:2014 午 1 万 1 日至 2014 午 12 7	3		单位:人民币:
项目	附注号	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		302,200,727.67	80,256,720.22
1.利息收入		20,473,204.04	17,579,156.01
其中:存款利息收入		1,397,728.74	1,514,585.14
债券利息收入		18,500,770.18	15,661,919.57
资产支持证券利息收入		_	-
买人返售金融资产收入		574,705.12	402,651.30
其他利息收入		_	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		73,971,045.96	70,807,504.69
其中:股票投资收益		58,731,354.58	49,411,375.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益		50,880.00	53,360.00
资产支持证券投资收益		_	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	_
股利收益		15,188,811.38	21,342,769.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		207,756,477.67	-8,146,071.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		_	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	16,131.08
减:二、费用		36,575,070.94	36,139,408.49
1. 管理人报酬		27,056,170.38	26,271,155.60
2. 托管费		4,509,361.70	4,378,525.89
3. 销售服务费		_	-
<ol> <li>交易费用</li> </ol>		4,624,009.29	5,108,151.11
5. 利息支出		-	_
其中:卖出回购金融资产支出		_	_
6. 其他费用		385,529.57	381,575.89
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		265,625,656.73	44,117,311.73
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		265.625.656.73	44.117.311.73

本报告期: 2014 年 1 月 1 日全 2014	平 12 月 31 日		单位:人民币元		
项目	20	本期 14年1月1日至2014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)	2,000,000,000.00	-232,164,415.59	1,767,835,584.41		
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	265,625,656.73	265,625,656.73		
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)	-	-	-		
其中:1.基金申购款	-	1	-		
2.基金赎回款	-		-		
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)	2,000,000,000.00	33,461,241.14	2,033,461,241.14		
项目	上年度可比期间 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)	2,000,000,000.00	-276,281,727.32	1,723,718,272.68		
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	44,117,311.73	44,117,311.73		
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)	-	-	-		
其中:1.基金申购款	-	-	-		
2.基金赎回款	-	-	-		
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)	2,000,000,000.00	-232,164,415.59	1,767,835,584.41		

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:

彭洪波 会计机构负责人 主管会计工作负责人

选或官理人以以7.74 报告的 14 报告的 15 报告的 15 报告的 16 报告的 16 报告的 16 报告的 16 报告的 17 报告的 18 报告的 17 报告的 18 报告

文平373 18-64 [行音论业会计准则的要求,真实,完整地反映了本基金于 2014年 12 ] 7-44 本报告明所采用的会计改策,会计估计与最近一期年度报告相一致的说明 本报告明所采用的会计改策,会计估计与最近一期年度报告相一致。 7-45 美错更正的说明 本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。 7-46 [经]]

场中取得的收入、包括尖类股票、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、营不证收企业所得 税。 数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、售免证收流通股股东应缴纳的企业 所得税。 1946年,1958年 1958年,19

7.4.7 关联方关系 关联方名称 城基金管理有限公司 基金管理人、基金发起丿

/.4.8.1.1 胶宗	父芴			金额单位:人民币元
	本期 2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
关联方名称	成交金額	占当期股票 成交总额的比 例	成交金額	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	421,219,726.91	13.85%	218,453,415.54	6.53%
东方证券	31,284,807.00	1.03%	_	-
7.4.8.1.2 债券	交易			金额单位:人民币元
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年1	2月31日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年	12月31日
大联刀石阶	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 成交总额的比例
La L bismaile				

7.4.0.1.2 [贝分子]	义勿			金额单位:人民币元	
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12	2月31日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
大联刀石桥	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	
长城证券	30,697,874.90	54.57%	_	-	
东方证券	-	-	-	-	
7.4.8.1.3 债券[	回购交易			金额单位:人民币5	
	本期 2014年1月1日至2014年1	2月31日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年		
关联方名称	同胞成次金額	占当期债券回购	同胞成次金額	占当期债券	

7-48.1-4 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。 7-48.1-5 应支付关联方的佣金

					金额单位:人民币
	关联方名称 -		2014年1月1日	本期  至 2014年 12月 31日	
		当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余額	占期末应付佣金总 額的比例
	长城证券	475,170.58	14.98%	255,050.48	27.90%
	东方证券	28,481.63	0.90%	28,481.63	3.12%

关联方名称		上年 2013年1月1日		
大联万石称	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	198,879.60	6.55%	91,691.96	20.21%
东方证券	=	-	=	-

上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

其中,支付前時以前第2年結中接 注:11基金管理费每日计量 技力转布现金比例高于基金管严净值的 20%,超过部分不计提基金管理费。计算方法如下: H=E×1.5%/当年天数 H 为每日已的基金管理费 E 为前一日的基金管理费 E 为前一日的基金管产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值) 2)本期末本基金末文付的管理费余额人民币 2.591,875.23元。(2013 年末:人民币 2.247,257.71元) 7.48.22基金托管费

期度生的基金应文付的任管费 4.500,361.70 注: 1.1 法。 4.500,361.70 注: 1.1 法。 4.500,361.70 注:1.1 法。 4.500,361.70 注:1.500,361.70 
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

本期 2014年1月1日至2014年12月31日 上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

				单位:人民币元					
关联方 名称		本期 至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日						
4010	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收人					
中国农业银行	110,953,965.22	1,373,558.98	149,447,907.24	1,487,102.32					
注:本基金的	注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,并按银行同业利率计息。								

在1. 于高速的探刊开始记录或几百公丁四级几级门内。 7.486 本基金在采销期内参与关联方东销业券的情况 注:本基金干本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购人关联方承销证券。 7.49 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

代码 300406	名称 九强 生物	2014年	10	日 2015年 10月	限対		价格						
7403	Shee S			30 日		受锁 定	14.32			价 (单位:股) 成本总额 76.95 57,938 829,672		4,458,329.10	
7.4.9.2	2 期オ	卡持有的	暂时位	亭牌等;	流通	受限股	票					金额单位:	人民司
	股票 名称	停牌日 期	停牌 原因	期末 估值年	k 自价	复牌日 期	短 开盘		對	湿(股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
000616	海航 投资	2014年 12月1 日	重大 事项 停牌	4.77	7	-		-		4,000,000	14,312,514.00	19,080,000.00	
600332	白云山	2014年 12月4 日	重大 事项 停牌	27.1	1	2015年 1月13 日		29.82		400,000	10,238,664.16	10,844,000.00	
300063	天龙 集团	2014年 12月1 日	重大 资重组	17.7	5	-		-	100,000		1,379,839.00	1,775,000.00	

: 截至本报告期末 2014 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 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 注:截至本报告期末 2014 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.无质押偿产业保证的水。如十十2月31日止,半盛业水中, 元.无质押偿等。 74.10 有助于壁解和分析会计报表需要说明的其他事项 74.101 承诺事项 截至资产负债委日,本基金无需要说明的承诺事项。 74.102 其他事项

7.4.10.2 其他事項 ()公允的作值 管理尼已经评估了银行存款,结算备付金、买人返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长, 公允的值与账面价值相容。 各层次金融工具公允价值 于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人 民币。1842903.15.38元、划分为第二层次的余额为人民币 0.352,450.00元、无划分分第三层级余额。 公允价值所属层次间重大变动 对于证券交易所上市的破界和债券,咨出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况。本基金不 会于停梯日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用

的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。 第三层级公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转人转出

定。 (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

## 8.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币
序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,495,811,265.38	73.39
	其中:股票	1,495,811,265.38	73.39
2	固定收益投资	417,461,500.00	20.48
	其中:债券	417,461,500.00	20.48
	资产支持证券	-	=
3	贵金属投资	-	Т
4	金融衍生品投资	-	=
5	买人返售金融资产	-	=
	其中:买新式回购的买人返售金融资产	-	Т
6	银行存款和结算备付金合计	113,798,411.58	5.58
7	其他各项资产	11,039,878.43	0.54
8	合计	2,038,111,055.39	100.00

金额单位:人民币元

占基金资产净值比例(%)	公允价值	行业类别	代码
_	-	农、林、牧、渔业	Α
0.06	1,279,530.00	采矿业	В
40.37	820,963,263.04	制造业	С
1.19	24,190,000.00	电力、热力、燃气及水生产和供应业	D
3.55	72,273,311.36	建筑业	E
2.14	43,474,500.00	批发和零售业	F
-	=	交通运输、仓储和邮政业	G
-	-	住宿和餐饮业	Н
7.53	153,213,943.95	信息传输、软件和信息技术服务业	I
9.35	190,034,600.00	金融业	J
3.08	62,590,952.75	房地产业	K
2.06	41,800,000.00	租赁和商务服务业	L
0.16	3,272,500.00	科学研究和技术服务业	M
1.72	35,067,126.40	水利、环境和公共设施管理业	N
-	-	居民服务、修理和其他服务业	0
-	-	教育	P
-	-	卫生和社会工作	Q
2.29	46,528,787.88	文化、体育和娱乐业	R
0.06	1,122,750.00	综合	S
73.56	1,495,811,265.38	合计	

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	600406	国电南瑞	5,000,000	72,750,000.00	3.58
2	000001	平安银行	4,000,000	63,360,000.00	3.12
3	002063	远光软件	2,651,148	53,155,517.40	2.61
4	600036	招商银行	3,000,000	49,770,000.00	2.45
5	000581	威孚高科	1,837,483	49,299,668.89	2.42
6	600271	航天信息	1,300,000	39,663,000.00	1.95
7	002444	巨星科技	3,300,000	36,960,000.00	1.82
8	601299	中国北车	5,000,000	36,650,000.00	1.80
9	000513	丽珠集团	700,986	34,656,747.84	1.70
10	601992	金隅股份	3,370,802	34,179,932.28	1.68
				) 月 28 日起,本管理人对旗下基金原 法进行估值。详见本管理人的相关2	

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

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

序号	股票代码	股票名杯	本期累计头人金额	(%)
1	000581	威孚高科	50,918,673.18	2.5
2	000001	平安银行	44,900,000.00	2.
3	002444	巨星科技	37,665,572.43	2.
4	600637	百视通	37,052,231.55	2.
5	600036	招商银行	35,542,540.00	2.0
6	300332	天壕节能	34,558,105.98	1.
7	600588	用友软件	34,137,211.68	1.
8	300005	探路者	30,286,095.84	1.
9	600068	葛洲坝	29,401,807.00	1.
10	601998	中信银行	28,997,802.69	1.0
11	300303	聚飞光电	28,758,103.35	1.0
12	601788	光大证券	28,524,583.00	1.
13	002051	中工国际	26,350,980.05	1.
14	002063	远光软件	25,968,929.78	1.
15	300070	碧水源	25,753,656.05	1.
16	002650	加加食品	25,729,679.81	1.
17	600150	中国船舶	25,701,009.39	1.
18	300037	新宙邦	25,351,204.27	1.
19	000963	华东医药	24,732,387.02	1.
20	300177	中海达	24,539,313.99	1.

注:买人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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初點金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	73,181,740.46	4.14
2	600588	用友软件	59,942,142.58	3.39
3	002035	华帝股份	54,892,854.08	3.11
4	600637	百视通	47,880,524.33	2.71
5	601169	北京银行	45,745,337.85	2.59
6	600519	贵州茅台	36,592,146.02	2.07
7	300332	天壕节能	35,768,758.00	2.02
8	000024	招商地产	34,609,926.47	1.96
9	300275	梅安森	33,951,949.31	1.92
10	000069	华侨城 A	33,688,733.24	1.91
11	600066	宇通客车	33,606,615.54	1.90
12	300037	新宙邦	32,008,864.21	1.81
13	600261	阳光照明	31,872,831.57	1.80
14	600352	浙江龙盛	29,921,113.76	1.69
15	300170	汉得信息	29,034,154.42	1.64
16	601788	光大证券	28,996,236.67	1.64
17	601808	中海油服	27,508,273.44	1.56
18	600522	中天科技	27,338,174.61	1.55
19	600138	中青旅	27,303,290.73	1.54
20	600062	华润双鹤	27,169,555.74	1.54

在:头面亚侧按头头成文亚侧(成文单扩来以成文) 8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

头人股票	成本(成交)尼額		1,539,024,079.43
卖出股票	收人(成交)总额		1,508,387,517.08
注:头	人股票成本和卖出股票收入均按买卖 1末按债券只和公米的债券投资组合	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。
0.3 39.	[A] 文 [A] 对 [A] 对 [A] 以 [A] 以 [A] 以 [A] [A] 以 [A]		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	417,461,500.00	20.53
	其中:政策性金融债	417,461,500.00	20.53
4	企业债券	1	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	П	-

	1471			,,	
8.6 期	末按公允价值占基金	è资产净值比例 <del>力</del>	七小排序的前五名信	5 券投资明细	金额单位:人民币5
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	100230	10国开 30	1,000,000	100,480,000.00	4.94
2	110407	11次发 07	1,000,000	100,020,000.00	4.92
3	110212	11国开 12	900,000	90,243,000.00	4.44
4	100236	10国开 36	700,000	70,217,000.00	3.45
-	040004	THIT 4404	550,000	57 504 500 00	2.70

8.7 期未按公允价值:基金资产价值比例大小排序的前十名资产支持证券投资特 注:本基金率报告期末共有省资产对证券。 8.8 报告期末处之价值占基金资产价值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 注:本基金率报告期末未持有销金属。 8.9 期未按公价值占基金资产价值比例大小排序的前五名权证投资明细

11 按告期末本基金投资的国债期货交易信兑说到 111 本期国信期货投资或申捐商国信期货约投资率。比例限制,信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。 1-4 本规划的基本基础经验的国债期货投资或基础。 1-5 本基本报告期末进行国情期货投资,期末未持有国债期货。 1-1 本期国债期投资。 1-1 本期国债期投资。 1-1 本期国债期投资。 1-2 投资组合报告附注。

8.12.1 本报告期内本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

8. 12.2 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。 8.12.3 期末其他各项资产构成

72.3	4-944	342,1394
1	存出保证金	246,436.6
2	应收证券清算款	3,484,087.6
3	应收股利	
4	应收利息	7,309,354.1
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	11,039,878.4
8.12.4	期末持有的处于转股期的可转换债券明细	

引引能存在尾差。 § 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

45,952,720 2.30 40,560,964.

文付给会计师事务所的报酬为人民币十万元。 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6年。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 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 

	牙冏石怀	父勿毕儿奴虽	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	音往
	招商证券	2	543,141,982.96	17.86%	494,476.00	15.59%	-
	中信证券	2	474,519,470.60	15.60%	432,002.64	13.62%	-
	长城证券	3	421,219,726.91	13.85%	475,170.58	14.98%	-
	中信建投	1	315,110,671.17	10.36%	286,877.19	9.04%	-
	华西证券	1	248,255,747.97	8.16%	226,011.82	7.12%	-
	大同证券	1	214,675,566.93	7.06%	195,440.27	6.16%	-
	申银证券	1	206,731,253.71	6.80%	307,234.62	9.68%	-
	银河证券	2	128,661,526.28	4.23%	197,015.01	6.21%	-
	国信证券	2	124,718,573.35	4.10%	113,544.36	3.58%	-
	中银国际	1	111,372,435.24	3.66%	181,614.79	5.72%	-
	国泰君安	2	95,126,103.09	3.13%	119,104.21	3.75%	-
	长江证券	1	64,494,970.18	2.12%	58,716.40	1.85%	-
	西南证券	1	41,721,518.56	1.37%	37,983.45	1.20%	-
	东方证券	1	31,284,807.00	1.03%	28,481.63	0.90%	-
	中金公司	1	20,908,319.64	0.69%	19,035.03	0.60%	-
	渤海证券	1	-	-	-	-	-
	方正证券	1	-	-	-	-	-
	民族证券	1	-	-	=	-	-
	中投证券	1	-	-	-	-	-
	光大证券	1	-	-	-	-	-
	宏源证券	1	-	-	-	-	-
	华宝证券	1	-	-	-	-	-
	东兴证券	1	-	-	-	-	-
	国盛证券	1	-	-	-	-	-
	中航证券	1	-	-	-	-	-
	红塔证券	1	-	1	-	-	-
	世纪证券	1	-	1	-	-	-
	信达证券	1	-	1	-	-	-
	高华证券	1	-	_	-	-	-
_	注:1、报告期7	内租用证券公司	席位的变更情况:				

高中证券

注:报告期内报用证券公司席位的变更情况。
本报告期内共新值 1个交易单元。但南证券 1、截止本报告期末共计 36 个交易单元。
2 专用席的应连标序准和程序
本基金管理人员贵基村代理本基金证券买卖的证券参省机构,使用其席位作为基金的专用交易席位、选择的标准是:
(1)实力规则: 信息良计: 注册资本系少于 3亿元人民币;
(2)财务状况良好,各项财务特标显示公司经营状及稳定;
(3)驾客行为规范,能测是基金证价的活动。4分规第2;
(4)内部管理规范,严格,具备键全均均控制度,并能是基金运作高度保密的要求;
(6)具备基金运作所需访成效,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)再条本金运作所需访成效,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,市场运销分析报告发基他专订报告。
据据上选择能等解除信息、基金管理人应根据主发和变易中、通常、基金管理人应根据有关规定。在参管性人根据主持和参与性人是优先的证券经营机构实到主持和规定量、支付的概念于以数据。
10.72.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

	[M-22*	2.00	[M 37*E-194	9,30,00	TAIL)	COU
券商名称	成交金額	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	100,000,000.00	62.50%	-	-
长城证券	30,697,874.90	54.57%	60,000,000.00	37.50%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华西证券	25,552,515.50	45.43%	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
申银证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
Adapt Literation						