

2013年第1号

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	59,920,300	1,000,069,807.00	9.83
2	600016	民生银行	124,196,352	976,183,326.72	9.60
3	601088	中国神华	27,761,365	703,750,602.75	6.92

4	601766	中国船舶	137,176.713	683,072.21808	6.71
5	601988	中信证券	79,944.406	408,290.73012	5.52
6	601318	中国平安	10,858.7207	49,481.84001	4.40
7	600036	招商银行	35,359.580	486,104.22508	4.78
8	600048	保利地产	35,080.789	479,098.73040	4.69
9	000069	华侨城A	59,687.868	447,659.01000	4.40
10	601299	中国联通	93,747.971	422,803.34921	4.16

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5、报告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

注：本基金本报告期末未持有债券。

6、报告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。

7、报告期内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、投资组合报告附注

(1) 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、处罚。

(2) 本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  
外股票。

其 他 资 产 构 成		金 额 (元)
序号	名称	
1	存出保证金	1,500,000.00
2	应收证券清算款	193,943,368.18
3	应收股利	
4	应收利息	283,844.35
5	应收申购款	1,424,866.19
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	197,152,078.72

(4) 报告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。

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**十二、基金业绩**

过往一定阶段长城品牌优选基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

**(截至2012年12月31日)**

时间段	净值增长 率	净值增长 率	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标准	①-③	②-④
-----	-----------	-----------	--------------	-----------------	-----	-----

年份	标准差	标准差/平均	标准差/平均	标准差/平均	标准差/平均	标准差/平均
2007年1月1日至2007年12月31日	18.446	1.47%	12.27%	1.42%	6.17%	0.05%
2008年1月1日至2008年12月31日	-55.01%	2.51%	-53.09%	2.25%	-1.92%	0.26%
2009年1月1日至2009年12月31日	73.94%	1.81%	66.92%	1.53%	7.02%	0.38%
2010年1月1日至2010年12月31日	-17.34%	1.40%	-7.75%	1.17%	-9.59%	0.23%
2011年1月1日至2011年12月31日	-12.14%	1.17%	-19.47%	0.97%	7.33%	0.20%
2012年1月1日至2012年12月31日	12.76%	1.12%	5.98%	0.94%	6.78%	0.18%
基金合同成立日至2012年12月31日	-24.09%	1.67%	-30.79%	1.46%	6.70%	0.21%

### 十三、基金的费用征收

(一)与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括：基金管理人的管理费；基金托管人的托管费；基金财务核算和支付的银行费用；基金估值和估值的信息披露费用；基金申购赎回费；基金投资所发生的证券和期货经纪费用；基金的证券交易费用以及按照国家有关规定和基金合同约定应列入基金费用项目的其他费用。

上述基金费用由基金管理人按法律规定的范围内按照公告的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

1、基金管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=Ex年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为1.5%

H为每日计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理人划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3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、休息日，则顺延至假期后首个工作日。

2、基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=Ex年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.25%

H为每日计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日，则顺延至假期后首个工作日。

本基金申购费、赎回费按如下标准和方式收取：

(1) 申购费

本基金申购费由基金投资人根据其它有关法规及相应协议的规定，按实际支付金额支付，列入当期基金费用。

(2) 与基金销售有关的费用

1. 申购费用

本基金的申购费按申购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔申购，申购费率按单笔分别计算。费率如下：

申购时间	申购费率
50万元以下	1.5%
50万元至100万元	1.0%
200万元至500万元	0.5%
500万元以上(含)	每笔1,000元

申购份额的计算方式如下：

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)，对于500万元(含)以上的申购，净申购金额=申购金额-申购费用(4+申购费率)，

申购费=申购金额-净申购金额  
净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
申购费=净申购金额×申购费率  
2、赎回费用  
本基金的费用按持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间	赎回费率
1日以内	0.5%
1日-2日	0.25%
2日-3日	0.15%

基金赎回金额的计算,本基金的赎回金额为赎回总额扣赎回费用。其中,  
赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值  
赎回费用=赎回总额×赎回费率  
赎回金额=赎回总额-赎回费用  
3、转换费用  
①基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。  
转入金额保留到小数点后两位,剩余部分舍去,舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。  
②如转入基金申购费率低于转出基金的申购费率  
转出金额=转出基金转出当日基金份额净值×转出基金份额  
转入基金金额=转出金额+转出基金金额申购费率  
转入基金金额+转出基金金额×转出基金当日基金份额净值=申购基金补差  
转入基金金额+转出基金金额×转出基金当日基金份额净值+申购基金补差=转入基金金额+转出基金金额×转出基金当日基金份额净值+申购基金补差  
4、无折价赎回:本基金赎回金额=赎回份数×赎回当日基金份额净值,赎回当日基金份额净值,按未知价法为基金,假若转换T日转入基金(本基金)的份额净值是1.250元,赎回当日基金份额净值是1.5元,则赎回应得金额为1.5元,赎回应得基金资产为1.25元,申购补差费率为1.5%,则应得的转换费用为0.1875元。

转出基金赎回费=0  
转入基金赎回费=0  
转入基金申购费补差=100.000-100.000=0  
转入净基金金额=100.000-1,477.835=98,522.175元  
转入的份额=98,522.175/28.78=3,423.737份  
基金转换费=0+1,477.835=1,477.835元  
②如转出基金的申购费率>转入基金的申购费率  
基金转换费=转出基金金额×[转出基金申购费率-  
例:某投资者持有本基金10万份基金份额,持有期为100天,决定转换为长城货币,转换当日转出基金净值为1.250元,转出基金申购费率为0.5%,转入基金申购费率为0.5%,则对应的转换费率为50%,申购补差费为0,则可得到的转换份额及基金转换费为:  
转出金额=100,000×1.25=125,000元  
转出基金赎回费=125,000×0.5%=625元  
转入基金金额=125,000-625=124,375元  
转入基金申购费=0  
转入净基金金额=124,375-0=124,375元  
转入的份额=124,375÷124.375=1,000份

- 基金管理费=125,000,000×0.625元
- ②对于存在级差申购费、不同申购金额对应不同申购率的基金，以转出基金份额对应的基金申购费率、转出基金份额占转出基金份额中申购总份额的比例乘以转出基金份额对应的基金申购费率作为计算转出申购费用；若转出基金份额对应的基金申购费率低于基金赎回费率时，则转出申购费用为零。
- ③转出基金份额的25%计入转出基金资产。
- ④计算基金赎回费用所涉及的申购费和赎回费率均按基金合同更新后的规定执行。赎回费按照基金管理人交易、费率调整活动期后发生的规定费率，按转出基金最新公告的相应费率档次计算基金赎回费用。
- ⑤基金管理人有权根据法律法规及中国证监会的有关规定提前终止上述赎回方式或费率水平，但应事先于新赎回方式实施前至少3个工作日至少一次中国证监会指定媒体上公告。
- ⑥、本基金的费用由基金财产承担，即：由基金管理人代扣代缴所有，主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。赎回费用由基金赎回人承担，赎回费用归入基金资产的比例为赎回金额的25%，其余部分用于注册登记费和基金的其他支出等。
- ⑦不列入基金费用的项目
  - (一)基金管理人的管理费
  - (二)基金募集期间的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中支付。

基金管理人有权扣划因未履约或未完全履约义务等引起的费用支出和基金资产净值损失,并处理基金运作过程中发生的费用和与本基金基金费用。

(四) 基金管理人和基金托管人应协商降低基金管理和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须迅速和新的费率实施,前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。

(五) 基金税收

基金和基金份额持有人有根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

**十四、对投资者说明书更新部分的说明**

本基金管理人根据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城品质优选股票型证券投资基金基金合同》的规定,并结合本基金实际情况,对《基金招募说明书》进行了2012年9月18日更新的基金更新招募说明书,更新了基金招募说明书,更新了招募说明书风险提示章节截止日期与新的财务数据披露日期,在“重要提示”中,更新了招募说明书风险提示章节截止日期与新的财务数据披露日期,更新了基金招募说明书风险提示章节截止日期与新的财务数据披露日期。

自披露截至日期。

在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人基本情况及主要人员情况。

在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。

在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构信息、律师事务所与经办人信息，以及会计师事务所、经办注册会计师信息。

在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金的转换与定期定额投资的内容。

在第八部分“基金的投资”中，更新了投资组合报告内容，披露了截至2012年12月31日的数据。

在第九部分“基金业绩”中，披露了截至2012年12月31日本基金的投资业绩。

在第十九部分“基金托管协议的内容摘要”中，更新了基金托管人的注册地。

在第二十分部“对基金份额持有人的服务”中，更新了基金管理人提供的服务内容。

在第二十一部分“其他应披露的事项”中，披露了本月已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司  
二〇一三年三月二十一日

1、浦发银行  
客户服务电话: 95528  
银行网站: www.spdb.com.cn

2、长城基金  
客户服务电话: 400-8868-666  
公司网站: www.cfund.com.cn

特此公告

长城基金管理有限公司  
2013年3月21日

---