

长城优化升级股票型证券投资基金

[2012]第四季度报告

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
报告送出日期：2013年1月19日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事会及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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本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01月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金承诺以诚实信用、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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月01日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 长城优化升级股票

交易代码 200015

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2010年4月20日

报告期末基金份额总额 69,355,764.69份

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增长的企业作为投资价值，力争实现基金资产的持续增值。

本基金为股票型证券投资基金，将依据市场情况进行基金经理主动管理，精选具有成长性的股票进行投资。

本基金的长期平均风险和预期收益率低于指数型基金，高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险收益特征。

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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月01日起至12月31日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 3,665,341.48

2.本期利润 4,309,761.56

3.期末平均基金份额本期利润 0.0732

4.期末基金资产净值 72,063,053.11

5.期末基金份额净值 1.039

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基金净值是指基金资产净值除以基金份额总数。

④本基金份额净值增长率及其同期间业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 收益率标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 6.94% 0.97% 8.18% 1.02% -1.24% -0.05%

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本基金合同规定本基金投资占基金资产净值的比例范围为60%-95%，其中，不低于80%的股票资产投资于优化升级企业，债券投资占基金资产净值的比例范围为0-35%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；现金或者到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月内，建仓完成后，各项资产配置比例符合基金合同约定。

②本基金合同于2012年4月20日生效，截止本报告期末，基金合同尚未满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

刘颖芳 本基金的基金经理，长城基金管理有限公司基金经理 2012年4月20日 - 8年 中国籍，持有金融分析师(CFA)，清华大学工学硕士，清华大学MBA，曾就职于国泰君安证券、德维森实业(深圳)有限公司，2008年进入长城基金管理有限公司，现任研究部总经理助理，同时担任公司党委委员、纪委书记，长城优化升级股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金的基金经理助理。

于雷 本基金的基本金经理助理 2012年4月20日 - 5年 中国籍，中国人民大学财政金融学院经济学学士，清华大学金融学学士，金融理财师(CFA)，曾就职于国泰君安证券、德维森实业(深圳)有限公司，2008年进入长城基金管理有限公司，现任研究部总经理助理，同时担任公司党委委员、纪委书记，长城优化升级股票型证券投资基金助理。

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证券从业人员的认定方式遵从证券业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

③刘颖芳女士自2012年10月11日至2013年1月11日任假期间，在此期间由本公司旗下长城安心回报混合型基金代为履行基金经理职责。该事项已于2012年10月12日在公告中披露，上海证券交易、证券时报上进行了披露。

④基金经理或基金经理助理因公出差、度假、学习等原因，不能正常履行基金经理职责时，由其所在部门的另一名基金经理代为履行基金经理职责。

⑤基金经理或基金经理助理因公出差、度假、学习等原因，不能正常履行基金经理职责时，由其所在部门的另一名基金经理代为履行基金经理职责。

⑥基金经理或基金经理助理因公出差、度假、学习等原因，不能正常履行基金经理职责时，由其所在部门的另一名基金经理代为履行基金经理职责。

⑦基金经理或基金经理助理因公出差、度假、学习等原因，不能正常履行基金经理职责时，由其所在部门的另一名基金经理代为履行基金经理职责。

⑧基金经理或基金经理助理因公出差、度假、学习等原因，不能正常履行基金经理职责时，由其所在部门的另一名基金经理代为履行基金经理职责。

⑨合计 7,268.49

5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 公司报告期内公开披露的基金组合类投资的公告

4.2 公平交易专项说明

4.3 公平交易执行情况

4.4 公平交易制度的执行情况

4.5 公平交易制度的执行情况

4.6 公平交易制度的执行情况

4.7 公平交易制度的执行情况

4.8 公平交易制度的执行情况

4.9 公平交易制度的执行情况

4.10 公平交易制度的执行情况

4.11 公平交易制度的执行情况

4.12 公平交易制度的执行情况

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 公平交易制度的执行情况

4.15 公平交易制度的执行情况

4.16 公平交易制度的执行情况

4.17 公平交易制度的执行情况

4.18 公平交易制度的执行情况

4.19 公平交易制度的执行情况

4.20 公平交易制度的执行情况

4.21 公平交易制度的执行情况

4.22 公平交易制度的执行情况

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 公平交易制度的执行情况

4.25 公平交易制度的执行情况

4.26 公平交易制度的执行情况

4.27 公平交易制度的执行情况

4.28 公平交易制度的执行情况

4.29 公平交易制度的执行情况

4.30 公平交易制度的执行情况

4.31 公平交易制度的执行情况

4.32 公平交易制度的执行情况

4.33 公平交易制度的执行情况

4.34 公平交易制度的执行情况

4.35 公平交易制度的执行情况

4.36 公平交易制度的执行情况

4.37 公平交易制度的执行情况

4.38 公平交易制度的执行情况

4.39 公平交易制度的执行情况

4.40 公平交易制度的执行情况

4.41 公平交易制度的执行情况

4.42 公平交易制度的执行情况

4.43 公平交易制度的执行情况

4.44 公平交易制度的执行情况

4.45 公平交易制度的执行情况

4.46 公平交易制度的执行情况

4.47 公平交易制度的执行情况

4.48 公平交易制度的执行情况

4.49 公平交易制度的执行情况

4.50 公平交易制度的执行情况

4.51 公平交易制度的执行情况

4.52 公平交易制度的执行情况

4.53 公平交易制度的执行情况

4.54 公平交易制度的执行情况

4.55 公平交易制度的执行情况

4.56 公平交易制度的执行情况

4.57 公平交易制度的执行情况

4.58 公平交易制度的执行情况

4.59 公平交易制度的执行情况

4.60 公平交易制度的执行情况

4.61 公平交易制度的执行情况

4.62 公平交易制度的执行情况

4.63 公平交易制度的执行情况

4.64 公平交易制度的执行情况

4.65 公平交易制度的执行情况

4.66 公平交易制度的执行情况

4.67 公平交易制度的执行情况

4.68 公平交易制度的执行情况

4.69 公平交易制度的执行情况

4.70 公平交易制度的执行情况

4.71 公平交易制度的执行情况

4.72 公平交易制度的执行情况

4.73 公平交易制度的执行情况

4.74 公平交易制度的执行情况

4.75 公平交易制度的执行情况

4.76 公平交易制度的执行情况

4.77 公平交易制度的执行情况

4.78 公平交易制度的执行情况

4.79 公平交易制度的执行情况

4.80 公平交易制度的执行情况

4.81 公平交易制度的执行情况

4.82 公平交易制度的执行情况

4.83 公平交易制度的执行情况

4.84 公平交易制度的执行情况

4.85 公平交易制度的执行情况

4.86 公平交易制度的执行情况

4.87 公平交易制度的执行情况

4.88 公平交易制度的执行情况

4.89 公平交易制度的执行情况

4.90 公平交易制度的执行情况

4.91 公平交易制度的执行情况