

长城积极增利债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

[illegible]

5. 报告期内本基金管理人及受托人履行职责情况 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下称“本基金管理人”)已严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,履行了基金管理人应尽的义务。同时,本基金管理人已按照规定设置信息披露义务人,及时向投资者披露有关基金投资信息,并按照中国证监会相关规定履行报告和公告义务。	置改造成非流通股,流通股股东通过持有可转换为流通股的非流通股,避免在二级市场抛售流通股而导致的损失扩大等风险。 6. 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下称“本基金管理人”)已严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,履行了基金管理人应尽的义务。同时,本基金管理人已按照规定设置信息披露义务人,及时向投资者披露有关基金投资信息,并按照中国证监会相关规定履行报告和公告义务。
6. 2 托管人对报告期内本基金投资运作符合法律、法规、基金合同、托管协议及投资指令情况的监督、核查情况 6.2.1 托管人对报告期内本基金投资运作符合法律、法规、基金合同、托管协议及投资指令情况的监督、核查情况 6.2.2 托管人对报告期内本基金投资运作符合法律、法规、基金合同、托管协议及投资指令情况的监督、核查情况	6.4.7 关联方关系 6.4.7.1 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.2 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.3 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况
报告期内,本基金未实施侧袋机制。 6.3 报告期内,本基金管理人及受托人履行职责情况 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下称“本基金管理人”)已严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,履行了基金管理人应尽的义务。同时,本基金管理人已按照规定设置信息披露义务人,及时向投资者披露有关基金投资信息,并按照中国证监会相关规定履行报告和公告义务。	6.4.7.4 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.5 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.6 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况
6.4 报告期内,本基金管理人及受托人履行职责情况 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下称“本基金管理人”)已严格按照《证券投资基金法》、基金合同、托管协议的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,履行了基金管理人应尽的义务。同时,本基金管理人已按照规定设置信息披露义务人,及时向投资者披露有关基金投资信息,并按照中国证监会相关规定履行报告和公告义务。	6.4.7.7 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.8 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况 6.4.7.9 报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的一方对另一方发生关联交易的情况

6.1资产负责表		30 年度财务报表 (续表二)		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	
会计主体：长城长期股权投资证券投资基金				长城证券股份有限公司(“东方证券”)		基金管理人股东、基金代销机构	
报告截止日：2013年6月30日							
单位：人民币元							
资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日	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。			
资产：				6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联交易			
银行存款		13,106,995.59	9,565,144.16	6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易			
结算备付金		1,730,630.97	960,455.19	6.4.8.1.1 股票交易			
存出保证金		=	86,785.59				
交易性金融资产		292,946,461.40	328,882,657.20				
其中：股票投资		=	1,446,146.00				

		金额单位：人民币元		
关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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			4,821,517.10	13.17%

基金投资	-	-	-	4,200,000.00	-
债券投资	292,946,461.40	327,436,511.20	-	3,208,508.25	8.76%
资产支持证券投资	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	40,000,180.00	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	4,645,188.08	7,817,412.75	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-

[illegible]

交易性金融负债	-	-	长城证券	-	比例	-	287,200,000.00	21.65%
衍生金融负债	-	-	东方证券	-	-	-	854,600,000.00	64.41%
卖出回购金融资产款	-	-	6.4.3.1.4 权证交易					
应付证券清算款	10,928,010.93	-	注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。					
应付赎回款	2,231,261.69	5,527,064.02	6.4.3.1.5 应付关联方的佣金					
应付管理人报酬	174,110.61	199,566.28	金额单位：人民币元					
应付托管费	53,572.51	61,405.02	关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日				
应付销售服务费	34,572.22	46,501.48		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	
应付交易费用	14,657.67	4,075.00						
应交税费	40.00	-						
应付利息	-	-						
应付利润	-	-	长城证券	-	-	-	-	
递延所得税负债	-	-	东方证券	-	-	-	-	
其他负债	133,204.27	161,958.72	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日					
负债合计	13,569,429.90	6,000,570.52	关联方名称	本期				
				当期	占当期佣金	期末应付佣金金额	占期末应付	

所有者权益：							
实收基金		267,557,628.55		354,213,541.34			
未分配利润		31,454,745.74		27,183,055.28			
所有者权益合计		299,012,374.29		381,396,596.62			
负债和所有者权益总计		312,581,804.19		387,397,167.14			
注：长盛积极1号于2013年06月10日，长城积极增利债券A类基金份额持有人大会审议通过，自2013年6月12日起，长城积极增利债券A类基金份额净值由1.110元/基金份额调整为0.957,628.55元/份，其中长城积极增利债券A类基金份额180,302,122.87份，长城积极增利债券C类基金份额880,255,506.68份。							
C-2. 利率债							
会计主体：长盛积极增利债券证券投资基金							
报告期：2013年1月1日至2013年3月31日							
				单位：人民币元			
项目				本期	上年度可比期间		
				2013年1月1日至2013年3月31日	2012年1月1日至2012年6月30日		
当期发生的基金应支付的管理费				1,239,456.04	1,390,843.41		

项目	附注号	2013年6月30日	2013年12月31日	2012年12月31日	2012年6月30日	其中：支付销售机构的客户维护费	421,009.50	1,102,965.03
一、收入		17,126,762.31	51,950,801.58			注：基金管理费按照前一日基金资产净值值0.65%年费率计提。计算方法如下： H=E×0.65%/当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一基金资产净值 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。 6.4.8.2.2 基金托管费		
1.利息收入		7,552,981.86	13,714,210.02			单位：人民币元		
其中：存款利息收入		71,669.03	136,488.25			项目		
债券利息收入		7,220,694.85	13,480,466.20					
资产支持证券利息收入		-	-			本期	2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
买入返售金融资产收入		260,617.98	97,255.57			当期发生的基金应支付的托管费	381,371.21	581,797.96
其他利息收入		-	-			注：基金托管费按照前一日基金资产净值值0.25%年费率计提。计算方法如下： H=E×0.25%/当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付。 6.4.8.2.3 销售服务费		
2.投资收益(损失以“-”填列)		13,678,641.37	-8,449,382.02			单位：人民币元		
其中：股票投资收益		-590,200.56	-697,878.93			获得销售服务费的各关联方名称		
基金投资收益		-	-					
债券投资收益		14,375,550.18	-7,788,727.09			2013年1月1日至2013年6月30日	本期	2013年1月1日至2013年6月30日
资产支持证券投资		-	-			当期发生的基金应支付的销售服务费	长盛积极增利服务A	长盛积极增利服务C
衍生工具收益		-	-			合计	173,540.56	173,540.56
股利收益		3,291.75	37,224.00			中国建设银行		
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		-4,205,978.71	46,527,878.00					
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-			长盛积极增利服务A		
5.其他收入(损失以“-”填列)		91,117.79	158,095.58					
六、费用		2,315,123.73	2,814,428.22			长盛积极增利服务B		
其中：销售费用		-	-					

[illegible]

会计主体:长期股权投资权益类证券投资准备金			单位:人民币元		
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日					
项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30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)	354,213,541.34	27,183,055.28	381,396,596.62		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,911,634.59	14,911,634.59		
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购减少以“-”号填列)	-86,655,912.79	-10,639,944.13	-97,295,856.92		
其中:1.基金申购款	360,597,407.36	34,771,955.37	395,369,363.03		
2.基金赎回款	-447,253,320.15	-45,411,899.80	-492,665,219.95		
四、本期利润分配持有人的应计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)	267,557,628.55	31,454,745.74	299,012,374.29		
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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)	559,506,028.76	-23,115,273.47	536,390,755.29		
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	48,106,372.86	48,106,372.86		
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期申购减少以“-”号填列)	162,203,002.03	9,637,470.15	171,840,472.18		

[illegible]

				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	1380077	13鄂宇债	300,000	30,471,000.00	10.19
2	1380185	13鞍山城投债	300,000	30,318,000.00	10.14
3	1380192	13绥芬河债	300,000	30,114,000.00	10.07
4	1280472	12淮钢债	200,000	20,606,000.00	6.89
5	1380088	13三明城投债	200,000	20,310,000.00	6.79

序号	名称	金额
1	存出保证金	86,785.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,645,188.08
5	应收申购款	15,331.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-
9	合计	4,797,716.23

[illegible]

项目	份额级别	持有份额总额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城利极增利债券A	22,258.98	0.0123%
	长城利极增利债券C	—	—
	合计	22,258.98	0.0083%

注：1、本基金高级管理人员、基金投资和研究部门人员持有本基金份额总数的数量区间为0。
2、本基金基金管理人持有本基金基金份额总数的数量区间为0。

§9 开放基金业务变动

10. 基金停牌期间有人大会决议	§10 重大事件披露	§10.2.2.1 基金停牌期间有人大会决议
10.1 基金本报告期有人大会决议	10.1 基金本报告期有人大会决议	10.1 基金本报告期有人大会决议
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门、发生重大变动	10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门、发生重大变动	10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门、发生重大变动
1. 基金管理人重大人事变动	1. 基金管理人重大人事变动	1. 基金管理人重大人事变动
本报告期,基金管理人无重大人事变动。	本报告期,基金管理人无重大人事变动。	本报告期,基金管理人无重大人事变动。
2. 基金托管人的专门基金托管部门无重大变动	2. 基金托管人的专门基金托管部门无重大变动	2. 基金托管人的专门基金托管部门无重大变动
本报告期,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。	本报告期,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。	本报告期,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
10.3 涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的价格	10.3 涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的价格	10.3 涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的价格
本报告期报告期内无涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的诉讼。	本报告期报告期内无涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的诉讼。	本报告期报告期内无涉及基金申购、赎回、基金资产、基金估值业务的诉讼。

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	
国金证券	2	8,662,520.36	63.31%	7,886.46	63.31%	-
首创证券	1	5,020,258.67	36.69%	4,570.21	36.69%	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-

[illegible]

招商证券	1,509,708,243.41	96.25%	1,665,500,000.00	100.00%
长江证券	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—
华泰联合	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—

中信证券	-
华泰证券	-
华西证券	-
天源证券	-
渤海证券	-
中金公司	-
东方证券	1.32%

注：根据报告期内证券公司提供的更新数据，本期报告期内新增西部证券2个交易席位，减少前一个席位及其下个交易日成交金额。截至报告期末，公司共拥有10个交易席位。

(6) 客户结构、信用状况：为基金资产净值提供担保的机构中，本基金管理人负责选择并持续监督基金买卖的股票和债券，使用其账户作为基金的交易结算账户。选择的标准是：

- a) 财务状况良好，信誉良好；净资产不少于亿元人民币；
- b) 经营业绩良好，各项指标均能显示公司经营能力持续提升。