

# 长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 08 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§6 半年度财务报表(未经审计)</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
7.6 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.....	36
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.8 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.....	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	38

<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	38
10.2 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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	38
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>42</b>
11.1 备查文件目录.....	42
11.2 存放地点.....	42
11.3 查阅方式.....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	长城久富股票 (LOF)	长城久富 (场内简称)
基金主代码	162006	
交易代码	162006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 2 月 12 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,063,458,024.18 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2007 年 5 月 18 日	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有核心竞争力的企业，分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益，力争为基金持有人实现稳定的超额回报。
投资策略	本基金投资的核心策略是“自下而上、精选个股”，同时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性。精选原则将继承基金久富以往富有成效的核心企业评价体系，以“具备核心竞争力、能够在市场中获取超额收益的企业”为主，构建均衡的投资组合。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中信全债指数收益率。
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 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		长城基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	彭洪波	张咏东
	联系电话	0755-23982338	021-32169999
	电子邮箱	penghb@ccfund.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		400-8868-666	95559
传真		0755-23982328	021-62701216
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号 新世界商务中心 41 层	上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号 新世界商务中心 40、41 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	518026	200120
法定代表人	杨光裕	胡怀邦

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报、中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算公司深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期( 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	48,452,488.91
本期利润	-305,490,235.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1579
本期加权平均净值利润率	-12.53%
本期基金份额净值增长率	-11.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	204,428,993.54
期末可供分配基金份额利润	0.0991
期末基金资产净值	2,267,887,017.72
期末基金份额净值	1.0991
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2011 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	72.12%

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 “期末可供分配利润”的计算方法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。

### 3.2 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
过去一个月	0.62%	1.07%	1.05%	0.90%	-0.43%	0.17%
过去三个月	-3.97%	1.02%	-4.01%	0.83%	0.04%	0.19%
过去六个月	-11.53%	1.14%	-1.54%	0.93%	-9.99%	0.21%
过去一年	12.54%	1.36%	14.39%	1.06%	-1.85%	0.30%
过去三年	28.28%	1.59%	12.74%	1.51%	15.54%	0.08%
自基金转型以来起至今	72.12%	1.70%	28.90%	1.67%	43.22%	0.03%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D0 到 D1 区间内每个交易日收益率的合成计算而来，计算公式如下：

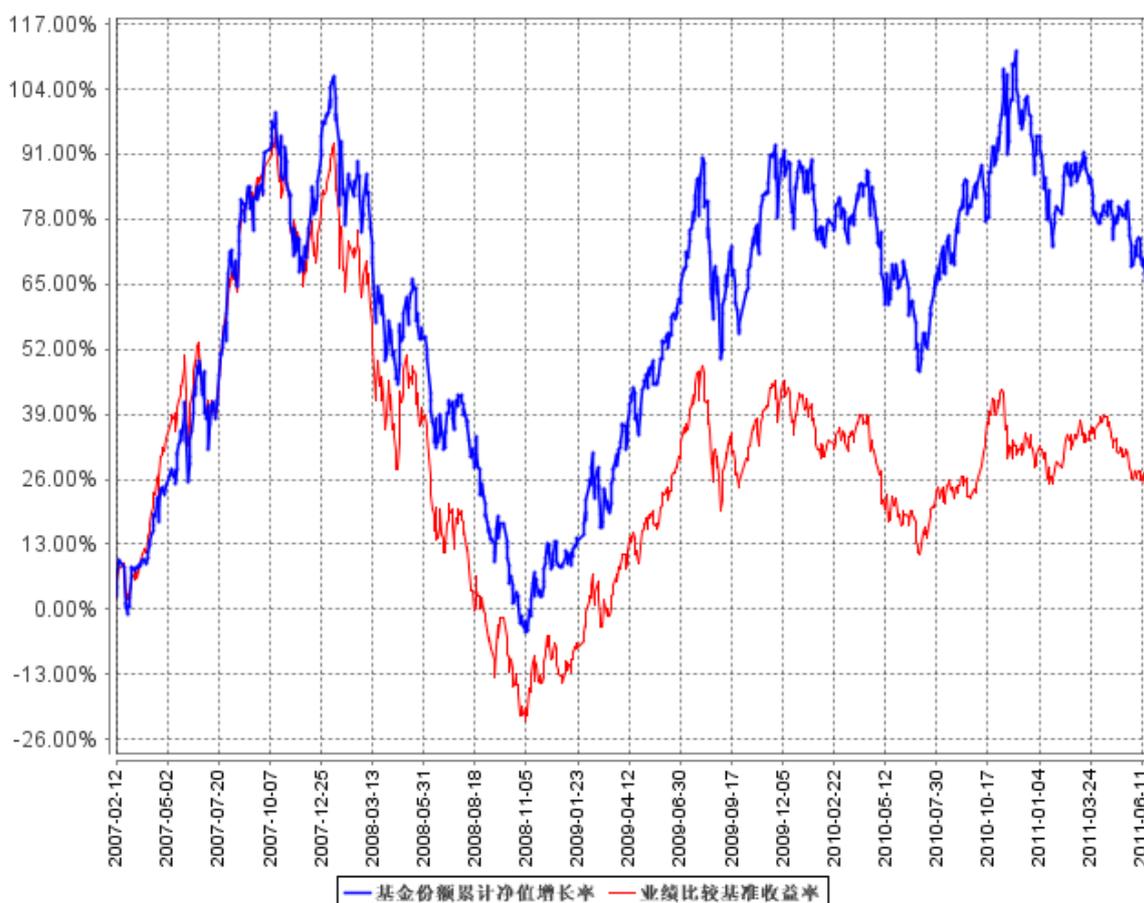
从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准收益率= (1+D1 日业绩比较基准收益率) × (1+D2 日业绩比较基准收益率) × …… × (1+ Dn 日业绩比较基准收益率) -1

这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

长城久富业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×75%+中信全债指数日收益率×25%  
 指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成。

#### 3.2.2 自基金转型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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金于 2007 年 2 月 12 日由封闭式基金基金久富转型而来。

②本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产 60%-95%，债券占基金总资产 0%-35%，权证投资占基金资产净值 0%-3%，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%。本报告期末本基金的投资运作符合法律法规和基金合同的相关规定。

## § 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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券有限责任公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券有限责任公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管

理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金和长城积极增利债券型证券投资基金。

#### 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		
杨建华	投资总监、基金管理部总经理、本基金的基金经理、长城久泰和长城中小盘基金的基金经理	2009年9月22日	-	11年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部，2001年10月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理。

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证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长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，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况，本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整，有效地保护了基金持有人利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序，保证各基金获得了公平的交易机会。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本期公司旗下长城久富核心成长基金与投资风格比较相近的长城品牌优选基金业绩差异较大，长城久富核心成长基金本月份额净值增长率为-11.53%，长城品牌优选基金本月份额净值增长率为3.98%。两只基金收益率差异的原因主要在于行业配置策略不同，久富配置的前五大行业是食品饮料、医药、批发零售、机械设备和和石油化工；长城品牌优选基金配置前五大行业是金融、交通运输、机械设备、采掘业和金属非金属。在上半年行情中，银行、交运设备等行业股票上涨，而医药、食品饮料等行业股票下跌，因此长城品牌基金业绩表现优于长城久富基金。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为，未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

### 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

上半年，中国经济依然面临较为严峻的外部环境，美国第二轮量化宽松政策实施完毕后，经济依然复苏乏力，失业率居高不下，房地产市场萎靡不振，而欧洲主权债务危机依然此起彼伏。在这种情势下更发生了日本地震及海啸引发的核危机对全球相关产业链的冲击，以及中东政局动荡尤其是利比亚危机直接将国际油价推高到100美元附近。国内经济形势也错综复杂，伴随着通胀逐月走高，控制通胀成为上半年经济政策的主要目标。央行动用了两次加息、每月提高存款准备金率的紧缩措施，同时房产税试点、限购、房价调控目标等措施都陆续出台，但是政策力度和效果还未显现，长江中下游地区由旱转涝更加重了对通胀的担忧。为缓冲控制通胀对经济增长的不利影响，政府政府推出了1000万套保障住房建设、加大水利建设等措施。在外需和国内消费短期内无法快速提升的情况下，投资成为“保增长”的重要手段，这在证券市场也得到了充分的反应，上半年和固定资产投资相关的钢铁、水泥、煤炭、机械等行业个股以及银行、地产等静态估值较低的调整充分的蓝筹股在报告期内都曾有良好的表现，上年度业绩和估值被不同程度透支的中小盘股，在一季报业绩不及预期、估值偏高等压力下，出现大幅度回落，消费类个股也在消费意愿下降、规范商业预付卡、药品限价等政策措施的影响下持续调整。二季度末市场出现风格转

换的迹象，景气度高涨的白酒、调整充分的医药、零售行业逐步企稳反弹。本基金总体维持对内需和战略新兴产业中长期看好的观点，组合变化不大，报告期内业绩表现逊于比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金净值增长率为-11.53%，同期业绩比较基准增长率为-1.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年连续出台的调控政策将产生一定的效果，政府在保增长和控通胀中寻求的平衡也基本上能够实现。我们认为，下半年通胀形势有望得到缓解，6月末银行间拆借利率超过8%说明资金面的紧张程度已经迫近临界点，政策将有结构性的微调。而政府推出的年内开工1000万套保障房、加大水利建设投入的政策目标陆续落实也使年内的经济继续保持较快增长毫无悬念，对宏观经济“硬着陆”的担忧更是杞人忧天。但是从长远看，我们对依赖投资保增长的方式持保留态度，对经济结构转型的必要性深信不疑，但是这并不意味着我们对投资领域蕴含的投资机会视而不见。因此，总体判断，下半年证券市场面临的宏观经济及政策环境将好于上半年，在投资者普遍调低对上市公司业绩预期的前提下，部分上市公司的业绩也许会给投资者带来惊喜，这些都预示着下半年市场将趋于活跃。在系统性风险趋弱的前提下，个股选择将成为获得良好业绩表现的重要手段。因此，下半年我们要从确定的增长、合理的估值中寻找稳妥的投资机会，自下而上精选个股，竭力给持有人带来满意的回报。

#### 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

公司成立了基金估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司分管估值业务副总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席基金估值委员会。

基金估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究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，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因数，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委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据基金估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法

及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

基金估值委员会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；基金会会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，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，向基金估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

#### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值委员会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。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程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

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定，本基金收益每年最多分配4次，年度收益分配比例不低于可分配收益的40%，基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值，如基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

本基金2011年4月19日对2010年的利润进行了分配，共分配利润353,146,812.18元。截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为204,428,993.54元，期末可供分配基金份额利润为0.0991，将按照基金合同的约定适时向投资者分配。

## § 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

2011年上半年度，基金托管人在长城久富股票（LOF）证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年度，长城基金管理有限公司在长城久富股票（LOF）证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配，分配金额为353,146,812.18元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2011年上半年度，由长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长城久富股票（LOF）证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务报表(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	26,173,523.26	32,464,559.10
结算备付金		40,820,204.40	120,069,212.47
存出保证金		1,103,913.63	1,103,913.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,107,118,977.38	2,603,311,074.57
其中：股票投资		2,027,462,977.38	2,524,127,074.57
基金投资		-	-
债券投资		79,656,000.00	79,184,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	98,000,267.00	20,000,150.00
应收证券清算款		-	16,474,279.66
应收利息	6.4.7.5	1,474,416.50	437,956.87
应收股利		-	-
应收申购款		55,287.79	481,286.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,274,746,589.96	2,794,342,432.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		920,851.60	20,905,012.10
应付管理人报酬		2,737,172.61	3,632,706.76
应付托管费		456,195.40	605,451.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	345,681.23	1,144,356.11
应交税费		666,400.00	666,400.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,733,271.40	1,678,836.76
负债合计		6,859,572.24	28,632,762.86
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,063,458,024.18	1,908,958,209.45
未分配利润	6.4.7.10	204,428,993.54	856,751,460.08
所有者权益合计		2,267,887,017.72	2,765,709,669.53
负债和所有者权益总计		2,274,746,589.96	2,794,342,432.39

注：截至 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0991 元，基金份额总额 2,063,458,024.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-282,833,184.79	-568,387,142.46
1. 利息收入		1,869,503.80	2,173,749.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	659,009.74	1,601,891.27
债券利息收入		892,853.14	21.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		317,640.92	571,837.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		69,096,639.30	188,490,176.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,826,896.07	177,903,858.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	228,294.89	34,052.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	8,041,448.34	10,552,265.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-353,942,724.27	-759,212,139.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	143,396.38	161,070.30
<b>减：二、费用</b>		22,657,050.57	32,193,741.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	18,183,516.56	22,708,464.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,030,586.05	3,784,744.07
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,205,362.98	5,462,114.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	237,584.98	238,417.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-305,490,235.36	-600,580,883.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-305,490,235.36	-600,580,883.75

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	1,908,958,209.45	856,751,460.08	2,765,709,669.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-305,490,235.36	-305,490,235.36
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）	154,499,814.73	6,314,581.00	160,814,395.73
其中：1. 基金申购款	350,478,978.43	60,365,031.02	410,844,009.45
2. 基金赎回款	-195,979,163.70	-54,050,450.02	-250,029,613.72
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）	-	-353,146,812.18	-353,146,812.18
五、期末所有者权益（基金净值）	2,063,458,024.18	204,428,993.54	2,267,887,017.72
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	2,038,245,462.60	1,450,664,104.60	3,488,909,567.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-600,580,883.75	-600,580,883.75
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）	118,030,620.20	23,415,655.93	141,446,276.13
其中：1. 基金申购款	328,977,851.26	133,264,582.75	462,242,434.01
2. 基金赎回款	-210,947,231.06	-109,848,926.82	-320,796,157.88
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）	-	-574,003,608.66	-574,003,608.66
五、期末所有者权益（基金净值）	2,156,276,082.80	299,495,268.12	2,455,771,350.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____	_____	_____
杨光裕	余骏	桑煜
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）由原久富证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）2007年1月31日证监基金字[2007]25号文《关于核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，久富证券投资基金由封闭式基金转为上市开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同，并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”。自2007年2月12日起，《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，原《久富证券投资基金基金合同》失效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

根据上述证监基金字[2007]25号的核准，本基金自2007年3月5日至2007年3月6日（已达到限量申购额）公开集中申购。经深圳大华天诚会计师事务所验证并出具深华(2007)验字015号验资报告。于集中申购验资日（2007年3月12日），集中申购资金及利息总计人民币7,934,819,964.27元，折合基金份额7,934,819,964.27份。

集中申购验资结束日同时为原久富证券投资基金的基金份额转换日。长城基金管理有限公司

按照基金转换基准日（2007 年 3 月 9 日）原久富证券投资基金的份额净值，对原久富证券投资基金进行了基金份额转换。经基金托管人确认，原久富证券投资基金的基金总份额由 500,000,000.00 份转换为 1,140,424,000.00 份。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $75\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+25\% \times$  中信全债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》和《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 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 2011 年 06 月 30 日的财务状况以及 2011 年 01 月 01 日至 2011 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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

本基金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。

#### 6.4.5. 差错更正的说明

本基金于本报告期末发生会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券

（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股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，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入及债券的利息收入，由上市公司及债券发行企业在向基金派发股息、红利收入及债券的利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股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，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	26,173,523.26
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	26,173,523.26

注：本基金于本期末投资于定期存款和其他存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,810,150,935.70	2,027,462,977.38	217,312,041.68
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	79,918,530.00	79,656,000.00
	合计	79,918,530.00	79,656,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,890,069,465.70	2,107,118,977.38	217,049,511.68

注：本基金于本期所投资的股票中，无因股权分置改革而获得非流通股股东支付现金对价的情况。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	98,000,267.00	-
合计	98,000,267.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	6,201.21

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	21,767.60
应收债券利息	1,257,534.25
应收买入返售证券利息	188,866.64
应收申购款利息	-
其他	46.80
合计	1,474,416.50

注：其他均为应收权证保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	345,144.23
银行间市场应付交易费用	537.00
合计	345,681.23

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00
应付赎回费	737.42
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	148,765.71
预提上市年费	29,752.78
预提银行间债券账户维护费	4,426.92
合计	1,733,271.40

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,908,958,209.45	1,908,958,209.45

本期申购	350,478,978.43	350,478,978.43
本期赎回(以“-”号填列)	-195,979,163.70	-195,979,163.70
本期末	2,063,458,024.18	2,063,458,024.18

注：本期申购包含红利再投资份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,253,452,277.77	-396,700,817.69	856,751,460.08
本期利润	48,452,488.91	-353,942,724.27	-305,490,235.36
本期基金份额交易产生的变动数	67,291,531.84	-60,976,950.84	6,314,581.00
其中：基金申购款	183,178,757.94	-122,813,726.92	60,365,031.02
基金赎回款	-115,887,226.10	61,836,776.08	-54,050,450.02
本期已分配利润	-353,146,812.18	-	-353,146,812.18
本期末	1,016,049,486.34	-811,620,492.80	204,428,993.54

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	141,875.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	514,319.41
其他	2,815.26
合计	659,009.74

注：其他包括申购款利息收入 2,040.47 元以及权证保证金利息收入 774.79 元。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	466,164,198.19
减：卖出股票成本总额	405,337,302.12
买卖股票差价收入	60,826,896.07

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	980,145.29
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	751,600.00
减：应收利息总额	250.40
债券投资收益	228,294.89

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

注：本基金本期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期未发生衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,041,448.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,041,448.34

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-353,942,724.27
——股票投资	-354,414,724.27
——债券投资	472,000.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-353,942,724.27

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	143,396.38
合计	143,396.38

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,205,362.98
银行间市场交易费用	-
合计	1,205,362.98

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
上市年费	29,752.78
银行费用	551.00
银行间结算账户维护费	8,926.92
合计	237,584.98

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	-	-	728,726,666.85	21.68%
东方证券	-	-	719,645,553.29	21.41%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	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 成交总额的比例
长城证券	-	-	210,073.50	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	617,325.17	21.97%	551,666.33	30.80%
东方证券	587,289.82	20.90%	196,744.44	10.99%

注：本基金本期未有应支付关联方佣金的情况。

上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和上海证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,183,516.56	22,708,464.50
其中：支付销售机构的客户维护费	3,679,226.88	4,545,870.82

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前十五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,030,586.05	3,784,744.07

注：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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前十五个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
基金转型日（2007年2月12日）持有的基金份额		-

期初持有的基金份额	5,702,120.00	5,702,120.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,702,120.00	5,702,120.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	0.26%

注：基金管理人于本期及上年度可比期间持有本基金份额相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算并支付。基金合同转型日为 2007 年 02 月 12 日。

#### 6.4.10.4.2 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

注：除基金管理人外，本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	26,173,523.26	141,875.07	157,285,213.12	221,706.19

注：本基金用于证券交易结算的资金已通过交通银行基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。本期末及上年度末的相关余额在资产负债表中的结算备付金科目中单独列示。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未有在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2011 年 4 月 19 日	2011 年 4 月 20 日	2011 年 4 月 19 日	1.9000	169,825,669.08	183,321,143.10	353,146,812.18	
合计	-	-	-	1.9000	169,825,669.08	183,321,143.10	353,146,812.18	

注：本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000759	中百集团	2011年4月14日	重大事项	10.99	-	-	3,400,000	39,162,334.00	37,366,000.00	-
600315	上海家化	2010年12月6日	重大事项	35.60	-	-	495,531	16,918,856.42	17,640,903.60	-

注：①、根据相关法规的规定，经与托管行协商一致，自2011年5月25日起，本管理人对旗下基金所持中百集团(股票代码000759)按指数收益法进行估值。详见本管理人2011年5月26日公告。

中百集团(股票代码000759)2010年度权益分派，股权登记日为2011年7月7日，除息日为2011年7月8日，每股派发现金红利人民币0.12元（含税）。

②、根据相关法规的规定，经与托管行协商一致，自2011年1月17日起，本管理人对旗下基金所持上海家化(股票代码600315)按指数收益法进行估值。详见本管理人2011年1月18日公告。

上海家化(股票代码600315)2010年度权益分派，股权登记日为2011年4月28日，除息日为2011年4月29日，每股派发现金红利人民币0.25元（含税）。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金于本期末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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金于本期末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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值（所有者权益）的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,173,523.26	-	-	-	-	-	26,173,523.26
结算备付金	40,820,204.40	-	-	-	-	-	40,820,204.40
存出保证金	103,913.63	-	-	-	-	1,000,000.00	1,103,913.63
交易性金融资产	-	-	79,656,000.00	-	-	2,027,462,977.38	2,107,118,977.38
买入返售金融资产	98,000,267.00	-	-	-	-	-	98,000,267.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,474,416.50	1,474,416.50
应收申购款	55,287.79	-	-	-	-	-	55,287.79
资产总计	165,153,196.08	-	79,656,000.00	-	-	2,029,937,393.88	2,274,746,589.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	920,851.60	920,851.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,737,172.61	2,737,172.61
应付托管费	-	-	-	-	-	456,195.40	456,195.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	345,681.23	345,681.23
应交税费	-	-	-	-	-	666,400.00	666,400.00
其他负债	-	-	-	-	-	1,733,271.40	1,733,271.40
负债总计	-	-	-	-	-	6,859,572.24	6,859,572.24
利率敏感度缺口	165,153,196.08	-	79,656,000.00	-	-	-	
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	32,464,559.10	-	-	-	-	32,464,559.10
结算备付金	120,069,212.47	-	-	-	-	120,069,212.47
存出保证金	103,913.63	-	-	-	1,000,000.00	1,103,913.63
交易性金融资产	-	-	79,184,000.00	-	2,524,127,074.57	2,603,311,074.57
买入返售金融资产	20,000,150.00	-	-	-	-	20,000,150.00
应收证券清算款	-	-	-	-	16,474,279.66	16,474,279.66
应收利息	-	-	-	-	437,956.87	437,956.87
应收申购款	481,286.09	-	-	-	-	481,286.09
资产总计	173,119,121.29	-	79,184,000.00	-	2,542,039,311.10	2,794,342,432.39
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	20,905,012.10	20,905,012.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,632,706.76	3,632,706.76
应付托管费	-	-	-	-	605,451.13	605,451.13
应付交易费用	-	-	-	-	1,144,356.11	1,144,356.11
应交税费	-	-	-	-	666,400.00	666,400.00
其他负债	-	-	-	-	1,678,836.76	1,678,836.76
负债总计	-	-	-	-	28,632,762.86	28,632,762.86
利率敏感度缺口	173,119,121.29	-	79,184,000.00	-	-	

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	利率上升25个基点	-58,196.82	-152,611.57
	利率下降25个基点	58,379.73	153,276.22

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产 60%-95%，债券占基金总资产 0%-35%，权证投资占基金资产净值 0%-3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。于本期末本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,027,462,977.38	89.40	2,524,127,074.57	91.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	79,656,000.00	3.51	79,184,000.00	2.86
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,107,118,977.38	92.91	2,603,311,074.57	94.13

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	沪深300指数上升5%	72,633,861.16	89,139,547.64
	沪深300指数下降5%	-72,633,861.16	-89,139,547.64

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金净值，负数表示可能减少基金净值。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 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	2,027,462,977.38	89.13
	其中：股票	2,027,462,977.38	89.13
2	固定收益投资	79,656,000.00	3.50
	其中：债券	79,656,000.00	3.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	98,000,267.00	4.31
	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	66,993,727.66	2.95
6	其他各项资产	2,633,617.92	0.12
7	合计	2,274,746,589.96	100.00

#### 7.2 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	50,090,802.68	2.21
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,538,306,687.55	67.83
C0	食品、饮料	685,025,390.86	30.21

C1	纺织、服装、皮毛	16,930,500.00	0.75
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	91,772,953.48	4.05
C5	电子	68,089,121.41	3.00
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	106,680,385.61	4.70
C8	医药、生物制品	569,808,336.19	25.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	42,922,800.64	1.89
H	批发和零售贸易	339,714,908.77	14.98
I	金融、保险业	35,178,628.05	1.55
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,817,886.71	0.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	16,431,262.98	0.72
	合计	2,027,462,977.38	89.40

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	925,000	196,682,750.00	8.67
2	000568	泸州老窖	4,000,000	180,480,000.00	7.96
3	000858	五粮液	4,000,314	142,891,216.08	6.30
4	000513	丽珠集团	4,829,286	132,660,486.42	5.85
5	600079	人福医药	4,682,842	103,303,494.52	4.56
6	002024	苏宁电器	6,232,306	79,835,839.86	3.52
7	600887	伊利股份	4,408,272	73,397,728.80	3.24
8	002050	三花股份	1,891,896	63,000,136.80	2.78
9	600329	中新药业	4,488,114	54,261,298.26	2.39
10	600557	康缘药业	3,821,873	53,544,440.73	2.36
11	000869	张裕A	515,683	50,949,480.40	2.25
12	600664	哈药股份	3,223,498	50,608,918.60	2.23
13	000860	顺鑫农业	2,257,357	38,916,834.68	1.72
14	002045	广州国光	5,220,225	38,838,474.00	1.71

15	600778	友好集团	3,141,140	38,510,376.40	1.70
16	000759	中百集团	3,400,000	37,366,000.00	1.65
17	601818	光大银行	10,501,083	35,178,628.05	1.55
18	600785	新华百货	1,284,270	34,264,323.60	1.51
19	000887	中鼎股份	2,559,060	33,191,008.20	1.46
20	000400	许继电气	996,141	30,691,104.21	1.35
21	600062	双鹤药业	1,203,914	29,845,028.06	1.32
22	000963	华东医药	1,143,942	27,763,472.34	1.22
23	000999	华润三九	1,517,194	27,233,632.30	1.20
24	600276	恒瑞医药	859,183	25,749,714.51	1.14
25	000538	云南白药	441,330	25,191,116.40	1.11
26	600352	浙江龙盛	2,425,996	23,241,041.68	1.02
27	600271	航天信息	861,378	22,258,007.52	0.98
28	600196	复星医药	2,005,716	21,822,190.08	0.96
29	000419	通程控股	2,860,000	21,249,800.00	0.94
30	000639	西王食品	668,033	20,809,227.95	0.92
31	600588	用友软件	1,000,232	20,664,793.12	0.91
32	000028	一致药业	769,739	19,874,660.98	0.88
33	000895	双汇发展	299,909	19,814,987.63	0.87
34	000417	合肥百货	1,051,531	19,137,864.20	0.84
35	600858	银座股份	911,803	18,637,253.32	0.82
36	002007	华兰生物	531,018	18,022,750.92	0.79
37	000423	东阿阿胶	432,366	17,839,421.16	0.79
38	000792	盐湖股份	300,000	17,700,000.00	0.78
39	600315	上海家化	495,531	17,640,903.60	0.78
40	600828	成商集团	1,348,565	16,465,978.65	0.73
41	600415	小商品城	1,336,962	16,431,262.98	0.72
42	002029	七匹狼	500,000	15,850,000.00	0.70
43	002273	水晶光电	434,149	15,564,241.65	0.69
44	600859	王府井	377,486	15,088,115.42	0.67
45	002138	顺络电子	668,608	13,686,405.76	0.60
46	002073	软控股份	630,541	12,989,144.60	0.57
47	600327	大东方	1,230,900	11,521,224.00	0.51
48	000998	隆平高科	429,768	11,173,968.00	0.49
49	002317	众生药业	275,603	6,187,287.35	0.27
50	600754	锦江股份	276,731	4,817,886.71	0.21
51	600993	马应龙	186,044	3,538,556.88	0.16
52	601566	九牧王	50,000	1,080,500.00	0.05

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	601818	光大银行	44,842,035.00	1.62
2	000895	双汇发展	34,905,560.47	1.26
3	000538	云南白药	24,061,860.31	0.87
4	600169	太原重工	17,923,206.05	0.65
5	000792	盐湖股份	17,391,124.17	0.63
6	000858	五粮液	15,525,703.20	0.56
7	600036	招商银行	14,377,313.54	0.52
8	600778	友好集团	14,071,211.54	0.51
9	600271	航天信息	12,587,121.48	0.46
10	002007	华兰生物	12,184,429.78	0.44
11	600828	成商集团	8,444,993.80	0.31
12	600887	伊利股份	5,338,871.34	0.19
13	000417	合肥百货	4,758,683.00	0.17
14	601169	北京银行	4,747,690.00	0.17
15	000999	华润三九	3,879,692.00	0.14
16	002273	水晶光电	3,823,990.00	0.14
17	000419	通程控股	3,755,400.00	0.14
18	600588	用友软件	3,492,038.99	0.13
19	601009	南京银行	3,132,825.00	0.11
20	000963	华东医药	2,365,607.80	0.09

注：买入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。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

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	000651	格力电器	55,301,780.71	2.00
2	000568	泸州老窖	50,802,880.93	1.84
3	601607	上海医药	47,411,119.75	1.71
4	600519	贵州茅台	37,910,537.73	1.37
5	600169	太原重工	18,592,217.96	0.67

6	600693	东百集团	18,115,316.70	0.65
7	600036	招商银行	14,998,000.00	0.54
8	000759	中百集团	14,533,975.91	0.53
9	000887	中鼎股份	14,195,831.65	0.51
10	002336	人人乐	12,520,653.64	0.45
11	002277	友阿股份	12,145,459.78	0.44
12	600195	中牧股份	12,034,045.90	0.44
13	002014	永新股份	11,815,518.22	0.43
14	000895	双汇发展	11,408,749.40	0.41
15	002252	上海莱士	10,811,078.03	0.39
16	002029	七匹狼	8,908,673.97	0.32
17	000501	鄂武商A	7,816,728.12	0.28
18	000513	丽珠集团	7,738,425.79	0.28
19	002050	三花股份	7,203,286.49	0.26
20	600386	北巴传媒	6,858,461.54	0.25

注：卖出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。

### 7.4.3 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	263,087,929.20
卖出股票收入（成交）总额	466,164,198.19

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	79,656,000.00	3.51
	其中：政策性金融债	79,656,000.00	3.51
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	79,656,000.00	3.51

**7.6 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	100226	10 国开 26	800,000	79,656,000.00	3.51
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.8 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**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.9 投资组合报告附注**

**7.9.1** 本基金投资的前十名证券除宜宾五粮液股份有限公司外，其他证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

宜宾五粮液股份有限公司于 2011 年 5 月 28 日发布“关于收到中国证监会《行政处罚决定书》的公告”，监管机构认定公司在信息披露方面存在违法事实，并对相关高管人员处以警告和罚款。

本基金管理小组分析认为，五粮液是一家具有长期投资价值的优质公司，该处罚不影响公司的长期投资价值，而且公司估值水平相对具有一定的吸引力。本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序在较低价格区域对五粮液进行了投资。

**7.9.2** 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之外股票。

**7.9.3 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	1,103,913.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,474,416.50
5	应收申购款	55,287.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,633,617.92

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 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
78,369	26,330.03	114,972,492.05	5.57%	1,948,485,532.13	94.43%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	长城基金管理有限公司	5,702,120.00	5.46%
2	余世昌	1,010,121.00	0.97%
3	朱爱萍	1,000,120.00	0.96%
4	王艳红	1,000,000.00	0.96%
5	曾长耀	1,000,000.00	0.96%
6	贾红革	1,000,000.00	0.96%
7	莫少洪	660,000.00	0.63%
8	高捷	642,675.00	0.62%
9	郭旭	546,054.00	0.52%
10	廖良器	500,060.00	0.48%

注：①以基金账户为统计口径；

②持有人为场内持有人，占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例  
×100%。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	9,242.53	0.0004%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金转型日（2007年2月12日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,908,958,209.45
本报告期基金总申购份额	350,478,978.43
减：本报告期基金总赎回份额	195,979,163.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,063,458,024.18

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

因任期届满，并经第四届董事会第一次会议审议并决议，关林戈先生不再担任公司总经理；韩浩先生不再担任公司副总经理；彭洪波先生不再担任公司督察长；在新任总经理到任前，由余骏先生代为履行公司总经理职责；在新任督察长到任前，由彭洪波先生代为履行公司督察长职责。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内基金管理人和托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

### 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

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	
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	384,797,106.47	53.04%	312,649.24	51.91%	-
中银国际	1	216,432,006.18	29.83%	183,965.96	30.55%	-
国泰君安	1	124,267,614.74	17.13%	105,626.47	17.54%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

报告期内租用的证券公司席位没有变化。

#### 2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；

- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、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、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 10.7.2 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
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
广发证券	980,145.29	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年1月18日
2	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持亚太股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年1月25日
3	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持哈药股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年2月17日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法	中国证券报、证券时报、上海证券报和本	2011年2月18日

	的公告	基金管理人网站	
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年2月22日
6	关于增加中信证券为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年3月18日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持双汇发展股票估值调整的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年3月23日
8	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持上海汽车、华域汽车股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年4月7日
9	长城久富核心成长股票基金(LOF)收益分配公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年4月14日
10	关于天源证券增加为代销机构及开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年4月15日
11	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持安信信托股票市价估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年4月27日
12	长城基金关于在中信证券开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年4月28日
13	长城基金管理有限公司关于设立北京分公司的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年5月6日
14	关于与通联支付合作开通工商银行、光大银行、平安银行借记卡网上交易的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年5月16日
15	关于东莞农村商业银行增加为代销机构及开通定投、转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年5月17日
16	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年5月26日
17	关于开通中投证券定投业务并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年6月9日
18	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行网银、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年6月29日
19	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报和本基金管理人网站	2011年6月30日
20	本报告期刊登的其他公告	-	-

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 久富证券投资基金基金份额持有人大会决议公告
- (二) 中国证监会核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的文件
- (三) 《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》
- (四) 《长城久富核心成长股票型证券投资基金招募说明书》
- (五) 《长城久富核心成长股票型证券投资基金托管协议》
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

### 11.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### 11.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>