

长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) (已更名为长城久富核心成长混合型 证券投资基金 (LOF)) 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 27 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 2015 年 08 月 25 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 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

§ 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）
场内简称	长城久富
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	1,014,014,954.63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	2007-05-18

注：本基金自2015年8月3日起更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称由“长城久富股票（LOF）”变更为“长城久富混合（LOF）”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

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。

注：自2015年8月3日起本基金由主动型股票基金变更为混合型基金，预期收益与风险由高于混合基金、债券基金与货币市场基金变更为高于债券基金与货币市场基金，但低于股票基金。

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	车君	汤嵩彦
	联系电话	0755-23982338	95559
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tangsy@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	牛锡明

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、中国证券报、上海证券报
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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	840,998,255.76
本期利润	561,601,368.76
加权平均基金份额本期利润	0.4342
本期加权平均净值利润率	30.32%
本期基金份额净值增长率	32.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	501,709,595.28
期末可供分配基金份额利润	0.4948
期末基金资产净值	1,515,724,549.91

期末基金份额净值	1.4948
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	166.54%

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	-15.71%	3.74%	-5.48%	2.63%	-10.23%	1.11%
过去三个月	5.45%	2.81%	8.46%	1.96%	-3.01%	0.85%
过去六个月	32.67%	2.22%	20.55%	1.71%	12.12%	0.51%
过去一年	55.27%	1.70%	76.71%	1.39%	-21.44%	0.31%
过去三年	64.95%	1.38%	64.37%	1.13%	0.58%	0.25%
自基金合同生效日起至 今	166.54%	1.54%	83.81%	1.43%	82.73%	0.11%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D1 到 Dn 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

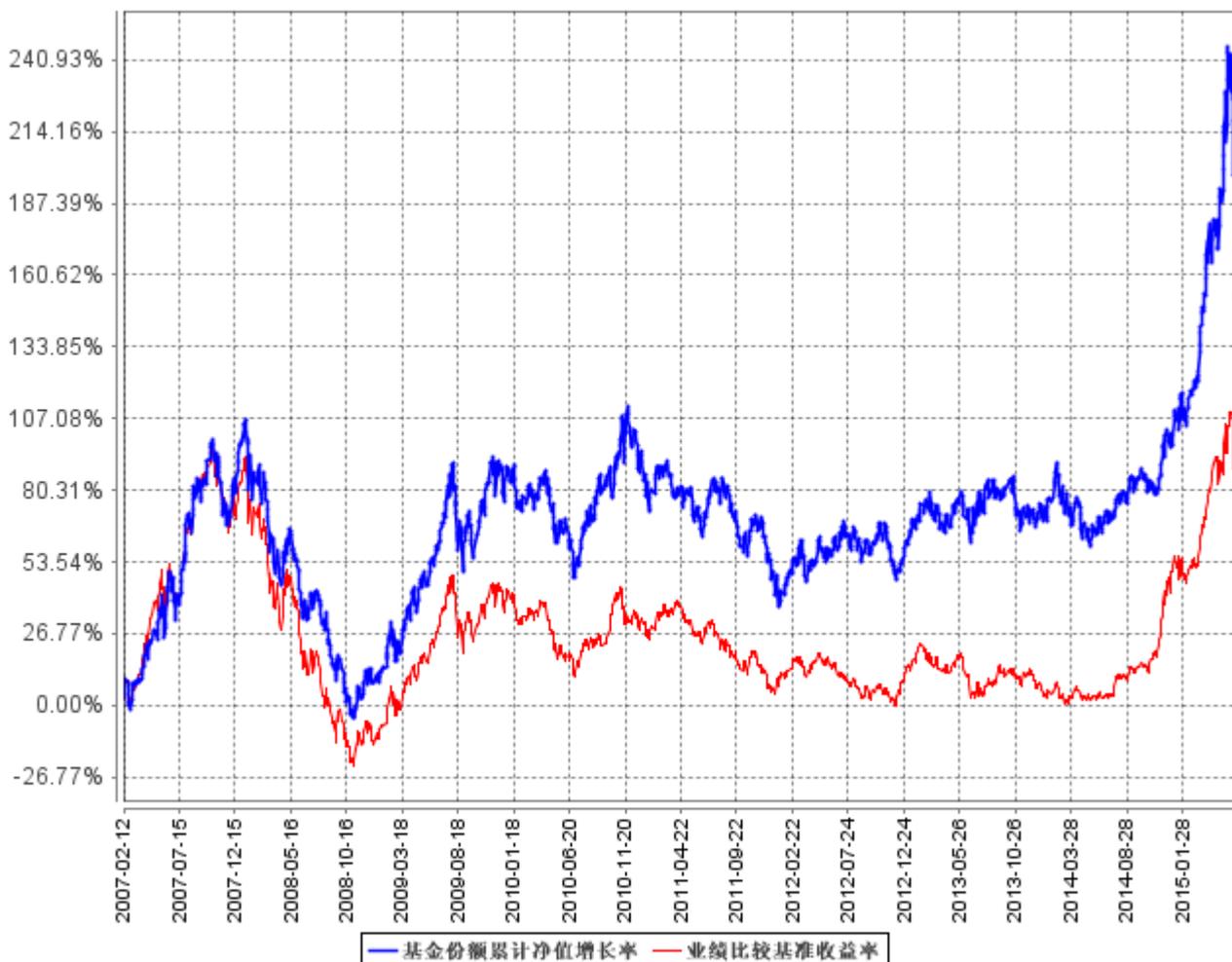
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

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%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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，由长城证券股份有限公司（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股份有限公司（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：久嘉证券投资资金；开放式基金：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、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、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、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金。

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	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2009 年 9 月 22 日	-	15 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”和“长城中小盘成长股票型证券投资基金”的基金经理、公司总经理助理。

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。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没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该证券当日成交量的 5% 的现象。

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，美国经济相对于其他主要经济体一枝独秀，欧日仍旧相对低迷，美元维持强势，石油等大宗商品价格维持在低位，人民币相对美元有所贬值，对其他货币仍然升值显著。国内宏观经济仍然呈现弱势格局，增速继续放缓，下行压力依然较大，但是出现低位企稳态势。在政策放松等因素推动下房地产销售有所好转，部分一线城市房价出现显著上涨，社会消费相对平稳。货币政策继续延续适度宽松态势，相继降准降息，利率市场化稳步推进。财政政策继续托底，同时继续深化改革、推动经济结构转型，鼓励大众创业、支持万众创新。证券市场方面，年初对杠杆资金进入市场的限制延缓了增量资金进场的节奏，市场重回存量资金博弈态势，围绕互联网的转型主题持续盛行，TMT 领涨市场，军民融合、环保、国企改革、一带一路、京津冀一体化等主题都借

助政策或者事件驱动有所表现。3 月份后，增量基金入市节奏加快，大盘蓝筹股有所表现，但是投资者和关注的重点仍在互联网相关板块，尤其是两会后，“互联网+”大行其道，部分相关个股短期表现、估值水平、市值规模都达到超乎想象的地步。股市成为“故事汇”，只要有转型的愿望、拥抱互联网的决心，市值就被高看一线，定增注入概念、管理层增持锁定价格、股权激励描绘未来的成长，这些都一步一步强化投资者的信心，市值则一步一步膨胀到令人咂舌的地步，创业板一路冲上 4000 点。最终在二季度末监管部门彻查场外配资的压迫下出现流动性问题，指数快速回落。本基金报告期内加大了对战略新兴产业及转型成长类个股的关注，适度加大了配置比例，在快速回落的市场中未能有效控制净值回撤，整个报告期净值表现不佳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为 32.67%，本基金业绩比较基准收益率为 20.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，尽管宏观经济出现企稳迹象，上半年经济增速也超预期达到 7.0%的水平，但是下行压力依然存在。尽管猪价上行压力较大，但是预期通胀率仍将保持低位。货币政策适度宽松、财政政策继续托底增长的态势仍将持续。围绕“十三五”规划，政策着力点仍将放在推动经济增长方式转变方面，鼓励大众创业、万众创新。证券市场经过上半年的疯狂炒作后有望恢复一定程度的理性，监管部门对场外配资的清理和规范也会延缓增量资金进入股市的步伐，市场不太可能出现上半年大量个股翻倍上涨的壮观景象，投资机会将转向个股挖掘。转型成长仍将是投资者关注的重点，缺乏业绩支撑、纯粹讲故事的公司将不再受到青睐，具备一定估值容忍度的、积极参与转型创新的公司有望成为市场未来的中坚力量，其中更有望诞生伟大的公司。下半年，随着深港通的落实、A 股市场纳入 MSCI 指数体系的不断推进，资本市场会进一步对外开放，具有国际竞争优势、估值优势的公司价值有望得到提升。本基金将积极把握其中蕴藏的投资机会，努力给基金持有人带来稳定、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

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、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受托资产估值委员会。

受托资产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素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产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。

受托资产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，向受托资产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、剪操作性强、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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

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抵于面值，如基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

本基金 2015 年 1 月 21 日对 2014 年的利润进行了分配，共分配利润 71,936,018.10 元。截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 501,709,595.28 元，期末可供分配基金份额利润为 0.4948，将按照基金合同的约定适时向投资者分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 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

2015 年上半年度，基金托管人在长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2015 年上半年度，长城基金管理有限公司在长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) 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 71,936,018.10 元，符合基金合同的规定。

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

2015 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核心成长股票型证券投资基金 (LOF) 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 半年度财务会计报告（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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,235,947.35	6,259,715.35
结算备付金		168,802,639.61	87,088,299.24
存出保证金		1,233,677.60	574,368.03
交易性金融资产	6.4.7.2	1,383,120,384.64	1,648,305,050.07

其中：股票投资		1,383,120,384.64	1,648,305,050.07
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,067,838.93	6,906,968.16
应收利息	6.4.7.5	88,007.80	52,106.95
应收股利		-	-
应收申购款		576,630.92	36,530.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,560,125,126.85	1,749,223,037.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
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		10,347,565.42	-
应付赎回款		25,217,918.73	5,886,970.41
应付管理人报酬		2,327,113.27	2,230,443.88
应付托管费		387,852.19	371,740.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,113,631.30	1,967,704.06
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	340,096.03	207,160.72
负债合计		44,400,576.94	11,330,419.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,014,014,954.63	1,479,389,453.11
未分配利润	6.4.7.10	501,709,595.28	258,503,164.99
所有者权益合计		1,515,724,549.91	1,737,892,618.10
负债和所有者权益总计		1,560,125,126.85	1,749,223,037.81

注：截至 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4948 元，基金份额总额 1,014,014,954.63 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		592,458,069.33	-7,793,021.02
1.利息收入		1,361,634.38	1,167,239.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,326,374.54	959,346.87
债券利息收入		62.63	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,197.21	207,892.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		870,379,774.83	101,050,289.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	862,379,889.78	85,039,782.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	315,777.37	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	7,684,107.68	16,010,506.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-279,396,887.00	-110,398,673.17
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	113,547.12	388,124.06
减：二、费用		30,856,700.57	22,236,219.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,717,954.88	15,774,519.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,286,325.81	2,629,086.45
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,619,408.46	3,564,028.44
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	233,011.42	268,585.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		561,601,368.76	-30,029,240.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		561,601,368.76	-30,029,240.69

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	1,479,389,453.11	258,503,164.99	1,737,892,618.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	561,601,368.76	561,601,368.76
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)	-465,374,498.48	-246,458,920.37	-711,833,418.85
其中：1.基金申购款	53,281,612.50	19,322,109.47	72,603,721.97
2.基金赎回款	-518,656,110.98	-265,781,029.84	-784,437,140.82
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)	-	-71,936,018.10	-71,936,018.10
五、期末所有者权益(基金净值)	1,014,014,954.63	501,709,595.28	1,515,724,549.91
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	2,082,626,094.81	199,858,676.49	2,282,484,771.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-30,029,240.69	-30,029,240.69
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)	-213,256,984.18	-9,524,046.22	-222,781,030.40
其中：1.基金申购款	179,660,764.99	10,095,460.50	189,756,225.49
2.基金赎回款	-392,917,749.17	-19,619,506.72	-412,537,255.89
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)	-	-82,912,690.18	-82,912,690.18
五、期末所有者权益(基金净值)	1,869,369,110.63	77,392,699.40	1,946,761,810.03

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：

<u>杨光裕</u>	<u>熊科金</u>	<u>彭洪波</u>
基金管理人负责人	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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《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》、《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。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 6 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、会计估计除 6.4.5.2 中说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）中对于固定收益品种估值的相关规定，自 2015 年 3 月 25 日起，本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，调整后采用第三方估值机构提供的价格数据对前述固定收益品种进行估值。相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

除上述事项外，本基金本报告期内无其他会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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》的规定，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，免征营业税。

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。

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

个人所得税税率为 20%。

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》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2015年6月30日
活期存款	5,235,947.35
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,235,947.35

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 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,487,342,281.67	1,383,120,384.64	-104,221,897.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,487,342,281.67	1,383,120,384.64	-104,221,897.03

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

注：本基金本期末各项买入返售金融资产余额均为零。

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 2015年6月30日
应收活期存款利息	1,780.36
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	85,672.34
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	555.10
合计	88,007.80

注：其他为应收结算保证金利息。

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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	5,113,631.30
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,113,631.30

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 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,519.64
预提费用	327,576.39
合计	340,096.03

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,479,389,453.11	1,479,389,453.11
本期申购	53,281,612.50	53,281,612.50
本期赎回(以“-”号填列)	-518,656,110.98	-518,656,110.98
本期末	1,014,014,954.63	1,014,014,954.63

注：本期申购包含基金转入、红利再投资份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

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	827,426,233.24	-568,923,068.25	258,503,164.99
本期利润	840,998,255.76	-279,396,887.00	561,601,368.76
本期基金份额交易产生的变动数	-400,534,582.89	154,075,662.52	-246,458,920.37
其中：基金申购款	37,102,640.40	-17,780,530.93	19,322,109.47
基金赎回款	-437,637,223.29	171,856,193.45	-265,781,029.84
本期已分配利润	-71,936,018.10	-	-71,936,018.10
本期末	1,195,953,888.01	-694,244,292.73	501,709,595.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	49,074.19
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	1,270,209.65
其他	7,090.70
合计	1,326,374.54

注：其他包括申购款利息收入 7.67 元以及结算保证金利息收入 7,083.03 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,089,470,601.24
减：卖出股票成本总额	4,227,090,711.46
买卖股票差价收入	862,379,889.78

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	315,777.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	315,777.37

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,067,840.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	752,000.00
减：应收利息总额	62.63
买卖债券差价收入	315,777.37

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未发生贵金属投资，本期末持有数量及金额均为零，无收益/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 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,684,107.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,684,107.68

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-279,396,887.00
——股票投资	-279,396,887.00
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-279,396,887.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	113,159.55
转出基金补偿收入	387.57
合计	113,547.12

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	14,619,408.46
银行间市场交易费用	-
合计	14,619,408.46

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	148,765.71
上清所银行间结算账户维护费及CFCA证书费	400.00
上市年费	29,752.78

银行费用	535.03
中债银行间结算账户维护费	8,926.92
合计	233,011.42

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

本基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”，并相应修改基金合同和托管协议，详见本管理人 2015 年 8 月 3 日公告。”

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利害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	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	785,818,466.93	8.42%	854,293,563.24	37.83%
东方证券	89,278,812.56	0.96%	15,826,424.29	0.70%

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

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通过关联方交易单元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	本期 2015年1月1日至2015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	715,409.50	8.42%	715,409.50	13.99%
东方证券	81,279.40	0.96%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	777,749.47	37.83%	213,218.91	33.89%
东方证券	14,408.51	0.70%	14,408.51	2.29%

注：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 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	13,717,954.88
其中：支付销售机构的客户维护费	2,274,971.69	2,434,369.76

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,286,325.81	2,629,086.45

注：基金托管费每日计提，按月支付。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

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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
基金合同生效日（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	0.5623%	0.31%

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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014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	5,235,947.35	49,074.19	5,430,276.79	268,961.14

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。本期及上年度可比期间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	2015年1月21日	2015年1月22日	2015年1月21日	0.5000	38,673,982.59	33,262,035.51	71,936,018.10	注：属2014年度利润2015年实施分配
合计	-	-	-	0.5000	38,673,982.59	33,262,035.51	71,936,018.10	

6.4.12 期末（2015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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300406	九强生物	2014年10月27日	-	新股流通受限	14.32	46.82	62,572	448,015.52	2,929,621.04	2014年10月30日上市，开盘价18.34

		日								元，本基金网下申购配售限售 12 个月。
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--	----------------------

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
001696	宗申动力	2015 年 6 月 30 日	重大事项	18.31	2015 年 8 月 24 日	15.53	4,109,890	68,305,316.44	75,252,085.90	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项	62.50	2015 年 8 月 5 日	69.20	811,706	26,273,445.66	50,731,625.00	-
600587	新华医疗	2015 年 5 月 22 日	重大事项	50.16	2015 年 7 月 3 日	52.77	842,100	34,081,185.18	42,239,736.00	-
002375	亚厦股份	2015 年 6 月 17 日	重大事项	23.96	2015 年 7 月 20 日	26.29	1,649,859	35,240,175.21	39,530,621.64	-
601877	正泰电器	2015 年 5 月 18 日	重大事项	31.40	-	-	1,124,000	32,661,848.38	35,293,600.00	-
300113	顺网科技	2015 年 5 月 5 日	重大事项	53.60	2015 年 8 月 6 日	51.93	650,000	38,370,397.55	34,840,000.00	-
601311	骆驼股份	2015 年 6 月 18 日	重大事项	23.31	2015 年 7 月 15 日	25.38	1,431,977	32,396,783.03	33,379,383.87	-
300195	长荣股份	2015 年 6 月 23 日	重大事项	28.35	-	-	818,520	34,527,796.93	23,205,042.00	-
601633	长城汽车	2015 年 6 月 19 日	重大事项	36.69	2015 年 7 月 13 日	38.50	500,000	25,181,189.62	18,345,000.00	-
002183	怡亚通	2015 年 6 月 1 日	重大事项	65.78	-	-	278,700	14,821,100.00	18,332,886.00	-
002367	康力电梯	2015 年 6 月 2 日	重大事项	20.90	-	-	818,400	18,070,906.93	17,104,560.00	-
300161	华中数控	2015 年 5 月 22 日	重大事项	30.28	-	-	500,000	18,906,000.00	15,140,000.00	-
000669	金鸿能源	2015 年 5 月 4 日	重大事项	37.72	2015 年 7 月 23 日	33.95	269,373	9,261,900.24	10,160,749.56	-
600366	宁波韵升	2015 年 5 月 22 日	重大事项	35.09	2015 年 8 月 12 日	31.58	100,000	3,336,092.02	3,509,000.00	-
002586	围海股份	2015 年 5 月 4 日	重大事项	9.99	-	-	1,298,000	12,497,751.98	12,967,020.00	-
600461	洪城水业	2015 年 2 月 26 日	重大事项	13.10	-	-	200,000	2,339,927.00	2,620,000.00	-

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

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

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由金融工具产生的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，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，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的债券资产的公允价值。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人员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。

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因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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 2015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	5,235,947.35	-	-	-	-	-	5,235,947.35
结算备付金	168,802,639.61	-	-	-	-	-	168,802,639.61
存出保证金	1,233,677.60	-	-	-	-	-	1,233,677.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,383,120,384.64	1,383,120,384.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,067,838.93	1,067,838.93
应收利息	-	-	-	-	-	88,007.80	88,007.80
应收申购款	-	-	-	-	-	576,630.92	576,630.92
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	175,272,264.56	-	-	-	-	1,384,852,862.29	1,560,125,126.85
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,347,565.42	10,347,565.42
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,217,918.73	25,217,918.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,327,113.27	2,327,113.27

应付托管费	-	-	-	-	-	387,852.19	387,852.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,113,631.30	5,113,631.30
应交税费	-	-	-	-	-	666,400.00	666,400.00
其他负债	-	-	-	-	-	340,096.03	340,096.03
负债总计	-	-	-	-	-	44,400,576.94	44,400,576.94
利率敏感度缺口	175,272,264.56	-	-	-	-	-	-
上年度末 2014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	6,259,715.35	-	-	-	-	-	6,259,715.35
结算备付金	87,088,299.24	-	-	-	-	-	87,088,299.24
存出保证金	574,368.03	-	-	-	-	-	574,368.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,648,305,050.07	1,648,305,050.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,906,968.16	6,906,968.16
应收利息	-	-	-	-	-	52,106.95	52,106.95
应收申购款	-	-	-	-	-	36,530.01	36,530.01
资产总计	93,922,382.62	-	-	-	-	1,655,300,655.19	1,749,223,037.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,886,970.41	5,886,970.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,230,443.88	2,230,443.88
应付托管费	-	-	-	-	-	371,740.64	371,740.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,967,704.06	1,967,704.06
应交税费	-	-	-	-	-	666,400.00	666,400.00
其他负债	-	-	-	-	-	207,160.72	207,160.72
负债总计	-	-	-	-	-	11,330,419.71	11,330,419.71
利率敏感度缺口	93,922,382.62	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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市场利率和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

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：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	1,383,120,384.64	91.25	1,648,305,050.07	94.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,383,120,384.64	91.25	1,648,305,050.07	94.85

6.4.13.4.3.2 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（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		76,646,184.83
沪深 300 指数下降 5%		-76,646,184.83	-45,328,388.88

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

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 950,469,074.67 元，划分为第二层次的余额为人民币 432,651,309.97 元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若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，本基金不会于停牌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。

第三层次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入转出情况。

(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。

§ 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	1,383,120,384.64	88.65
	其中：股票	1,383,120,384.64	88.65
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	174,038,586.96	11.16
7	其他各项资产	2,966,155.25	0.19
8	合计	1,560,125,126.85	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,017,305.00	1.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	806,948,243.92	53.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,780,749.56	0.84
E	建筑业	60,687,641.64	4.00
F	批发和零售业	75,897,892.10	5.01
G	交通运输、仓储和邮政业	53,781,144.16	3.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,472,136.70	11.44
J	金融业	20,823,404.00	1.37
K	房地产业	30,450,000.00	2.01
L	租赁和商务服务业	61,460,757.36	4.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,811,036.96	1.64
R	文化、体育和娱乐业	29,663,637.44	1.96
S	综合	14,326,435.80	0.95
	合计	1,383,120,384.64	91.25

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	000625	长安汽车	3,738,145	79,061,766.75	5.22
2	001696	宗申动力	4,109,890	75,252,085.90	4.96
3	300059	东方财富	1,100,000	69,399,000.00	4.58
4	000963	华东医药	811,706	50,731,625.00	3.35
5	000902	新洋丰	1,586,843	43,082,787.45	2.84

6	600587	新华医疗	842,100	42,239,736.00	2.79
7	002375	亚厦股份	1,649,859	39,530,621.64	2.61
8	002228	合兴包装	1,293,237	37,309,887.45	2.46
9	601877	正泰电器	1,124,000	35,293,600.00	2.33
10	300113	顺网科技	650,000	34,840,000.00	2.30
11	601313	江南嘉捷	1,813,175	33,924,504.25	2.24
12	601311	骆驼股份	1,431,977	33,379,383.87	2.20
13	002594	比亚迪	600,000	33,138,000.00	2.19
14	000599	青岛双星	2,400,000	31,224,000.00	2.06
15	600530	交大昂立	950,000	30,808,500.00	2.03
16	600340	华夏幸福	1,000,000	30,450,000.00	2.01
17	000673	当代东方	899,989	29,663,637.44	1.96
18	600029	南方航空	2,000,000	29,080,000.00	1.92
19	600271	航天信息	406,459	26,301,961.89	1.74
20	600804	鹏博士	846,025	25,262,306.50	1.67
21	002462	嘉事堂	473,941	25,166,267.10	1.66
22	300015	爱尔眼科	769,096	24,811,036.96	1.64
23	600115	东方航空	2,004,963	24,701,144.16	1.63
24	300115	长盈精密	700,000	23,317,000.00	1.54
25	600138	中青旅	1,100,278	23,237,871.36	1.53
26	300195	长荣股份	818,520	23,205,042.00	1.53
27	300136	信维通信	818,314	20,376,018.60	1.34
28	601888	中国国旅	300,000	19,890,000.00	1.31
29	601633	长城汽车	500,000	18,345,000.00	1.21
30	002183	怡亚通	278,700	18,332,886.00	1.21
31	002367	康力电梯	818,400	17,104,560.00	1.13
32	002022	科华生物	400,000	17,064,000.00	1.13
33	600829	人民同泰	838,100	16,627,904.00	1.10
34	002376	新北洋	900,000	16,110,000.00	1.06
35	002576	通达动力	514,774	15,541,027.06	1.03
36	600129	太极集团	568,069	15,462,838.18	1.02
37	002450	康得新	500,000	15,300,000.00	1.01
38	300161	华中数控	500,000	15,140,000.00	1.00
39	002085	万丰奥威	243,404	14,913,363.08	0.98
40	002331	皖通科技	500,000	14,690,000.00	0.97
41	600603	大洲兴业	848,220	14,326,435.80	0.95
42	300200	高盟新材	900,000	13,986,000.00	0.92
43	002586	围海股份	1,298,000	12,967,020.00	0.86
44	600406	国电南瑞	600,000	12,414,000.00	0.82

45	601009	南京银行	500,000	11,400,000.00	0.75
46	300247	桑乐金	644,400	10,374,840.00	0.68
47	000523	广州浪奇	600,000	10,362,000.00	0.68
48	000669	金鸿能源	269,373	10,160,749.56	0.67
49	002696	百洋股份	441,500	9,567,305.00	0.63
50	300017	网宿科技	199,980	9,283,071.60	0.61
51	601628	中国人寿	293,200	9,183,024.00	0.61
52	600257	大湖股份	500,000	8,450,000.00	0.56
53	002482	广田股份	300,000	8,190,000.00	0.54
54	002421	达实智能	378,620	7,583,758.60	0.50
55	002284	亚太股份	299,200	7,518,896.00	0.50
56	600332	白云山	200,000	6,892,000.00	0.45
57	000858	五粮液	200,000	6,340,000.00	0.42
58	000971	蓝鼎控股	231,500	5,521,275.00	0.36
59	002009	天奇股份	200,000	4,954,000.00	0.33
60	600518	康美药业	200,000	3,546,000.00	0.23
61	600366	宁波韵升	100,000	3,509,000.00	0.23
62	300406	九强生物	62,572	2,929,621.04	0.19
63	600461	洪城水业	200,000	2,620,000.00	0.17
64	002456	欧菲光	44,210	1,491,645.40	0.10
65	601211	国泰君安	7,000	240,380.00	0.02

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	300059	东方财富	93,214,237.70	5.36
2	600271	航天信息	85,664,986.88	4.93
3	001696	宗申动力	80,639,310.09	4.64
4	600369	西南证券	64,300,419.44	3.70
5	300207	欣旺达	60,891,915.51	3.50
6	600687	刚泰控股	52,885,061.77	3.04
7	601166	兴业银行	51,884,457.69	2.99
8	002228	合兴包装	50,319,080.62	2.90
9	002594	比亚迪	48,617,827.80	2.80

10	600138	中青旅	46,523,095.59	2.68
11	600340	华夏幸福	43,763,617.34	2.52
12	601311	骆驼股份	43,330,361.13	2.49
13	601988	中国银行	42,365,058.00	2.44
14	000001	平安银行	41,371,301.53	2.38
15	600352	浙江龙盛	40,883,556.48	2.35
16	000673	当代东方	40,606,711.10	2.34
17	000090	天健集团	40,150,647.85	2.31
18	600350	山东高速	39,893,426.80	2.30
19	002367	康力电梯	38,629,069.93	2.22
20	300113	顺网科技	38,370,397.55	2.21
21	600728	佳都科技	37,978,780.28	2.19
22	600530	交大昂立	37,446,123.10	2.15
23	600804	鹏博士	37,345,640.77	2.15
24	000651	格力电器	36,174,554.11	2.08
25	600048	保利地产	35,543,121.78	2.05
26	002375	亚厦股份	35,240,175.21	2.03

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	000568	泸州老窖	133,834,024.93	7.70
2	000651	格力电器	130,234,767.25	7.49
3	000513	丽珠集团	124,382,113.32	7.16
4	300032	金龙机电	103,216,982.25	5.94
5	600369	西南证券	96,704,937.67	5.56
6	600271	航天信息	87,555,943.30	5.04
7	601166	兴业银行	82,685,413.71	4.76
8	600518	康美药业	79,034,177.39	4.55
9	300207	欣旺达	77,641,318.91	4.47
10	600594	益佰制药	75,597,482.13	4.35
11	000001	平安银行	73,785,464.89	4.25
12	600887	伊利股份	72,511,819.53	4.17
13	300063	天龙集团	72,241,942.92	4.16
14	000400	许继电气	71,161,389.17	4.09

15	000895	双汇发展	66,440,515.61	3.82
16	300026	红日药业	65,685,811.78	3.78
17	001696	宗申动力	60,462,264.97	3.48
18	600687	刚泰控股	60,082,739.85	3.46
19	601688	华泰证券	53,116,518.66	3.06
20	000800	一汽轿车	52,104,601.73	3.00
21	600000	浦发银行	51,957,848.13	2.99
22	600885	宏发股份	50,792,569.62	2.92
23	600352	浙江龙盛	47,325,600.89	2.72
24	000090	天健集团	47,181,676.81	2.71
25	002189	利达光电	46,955,568.00	2.70
26	600690	青岛海尔	45,768,791.46	2.63
27	600350	山东高速	44,709,328.29	2.57
28	600728	佳都科技	43,954,513.99	2.53
29	002048	宁波华翔	43,453,553.76	2.50
30	601988	中国银行	42,500,000.00	2.45
31	601318	中国平安	41,655,015.49	2.40
32	000402	金融街	41,506,604.86	2.39
33	600557	康缘药业	39,052,267.75	2.25
34	002364	中恒电气	37,819,465.10	2.18
35	002448	中原内配	37,522,396.47	2.16
36	600008	首创股份	37,201,411.82	2.14
37	002658	雪迪龙	37,161,984.85	2.14
38	600048	保利地产	35,949,450.00	2.07
39	002185	华天科技	35,759,677.13	2.06

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	4,241,302,933.03
卖出股票收入（成交）总额	5,089,470,601.24

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货，本期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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、处罚。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,233,677.60
2	应收证券清算款	1,067,838.93
3	应收股利	-
4	应收利息	88,007.80
5	应收申购款	576,630.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,966,155.25

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001696	宗申动力	75,252,085.90	4.96	重大事项
2	000963	华东医药	50,731,625.00	3.35	重大事项
3	600587	新华医疗	42,239,736.00	2.79	重大事项
4	002375	亚厦股份	39,530,621.64	2.61	重大事项
5	601877	正泰电器	35,293,600.00	2.33	重大事项
6	300113	顺网科技	34,840,000.00	2.30	重大事项

7.12.6 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
32,400	31,296.76	245,794,339.74	24.24%	768,220,614.89	75.76%

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	9.95%
2	朱爱萍	1,959,039.00	3.42%
3	王艳红	1,000,000.00	1.75%
4	曾长耀	1,000,000.00	1.75%
5	高捷	642,675.00	1.12%
6	郭旭	586,054.00	1.02%
7	贾红革	550,000.00	0.96%
8	廖良器	500,060.00	0.87%
9	苏志文	350,163.00	0.61%
10	邓佩倩	346,633.00	0.61%

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%；

③以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

注：期末基金管理人的从业人员持有本基金的数量为 0.00 份。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	1,479,389,453.11
本报告期基金总申购份额	53,281,612.50
减：本报告期基金总赎回份额	518,656,110.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,014,014,954.63

§ 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

本报告期内，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事项。

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。本基金自2015年8月3日起更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	1	1,823,785,020.66	19.55%	1,660,374.17	19.55%	-
中银国际	1	1,818,175,469.83	19.49%	1,655,264.07	19.49%	-
银河证券	1	1,619,601,875.34	17.36%	1,474,486.12	17.36%	-
申万宏源	1	1,221,048,104.31	13.09%	1,111,637.55	13.09%	-
安信证券	1	841,683,882.45	9.02%	766,269.60	9.02%	-
长城证券	2	785,818,466.93	8.42%	715,409.50	8.42%	-
华西证券	1	655,107,697.83	7.02%	596,410.90	7.02%	-
国泰君安	1	475,798,677.77	5.10%	433,165.99	5.10%	-
东方证券	2	89,278,812.56	0.96%	81,279.40	0.96%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	1,067,840.00	100.00%	50,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 12 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (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，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (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。

10.8 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旗下基金持有的“12 邵城投（122565）”债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	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、上海证 券报、证券时报及本	2015 年 1 月 5 日

	的公告	基金管理人网站	
3	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持中国南车、中国北车股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 6 日
4	长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 19 日
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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 21 日
6	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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 23 日
7	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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 27 日
8	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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 7 日
9	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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 12 日
10	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、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 6 日
11	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 10 日

12	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 14 日
13	长城基金关于增加泉州银行为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 16 日
14	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
15	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持正邦科技股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 18 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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
17	长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
18	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
19	长城基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 3 月 26 日

	值方法的公告	券日报及本基金管理人网站	
20	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 4 日
21	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 8 日
22	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 11 日
23	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 23 日
24	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 28 日
25	长城基金关于增加中金公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务及实施申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
26	关于长城基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 4 日

		理人网站	
27	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 12 日
28	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 19 日
29	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
30	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
31	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 26 日
32	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
33	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与农业银行开展的网上银行、手机银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 1 日

34	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 2 日
35	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 3 日
36	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 4 日
37	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 9 日
38	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 13 日
39	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、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 19 日
40	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、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
41	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行开	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2015 年 6 月 30 日

	展的 网上银行、手机银行申 购手续费费率优惠活动的公告	基金管理人网站	
42	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、上海证 券报、证券时报、证 券日报及本基金管 理人网站	2015 年 6 月 30 日

§ 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>