

长城安心回报混合型证券投资基金 2015 年半年度报告 摘要

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国农业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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金简称 | 长城安心回报混合 |
| 基金主代码 | 200007 |
| 交易代码 | 200007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006 年 8 月 22 日 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,944,574,626.38 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率 2 倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略 | 分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用“注重收益、关注成长、精选个股”的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。 |
| 业绩比较基准 | 银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍。 |
| 风险收益特征 | 本基金是绝对回报产品，其预期收益与风险低于股票型基金，高于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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 车君 | 林葛 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 95599 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 010-68121816 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|------------------------------|
| 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 |

§ 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 | 1,921,225,017.03 |
| 本期利润 | 2,196,455,492.23 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.3696 |
| 本期基金份额净值增长率 | 36.72% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4338 |
| 期末基金资产净值 | 3,081,005,905.46 |
| 期末基金份额净值 | 1.0463 |

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。

3.2 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 | -12.45% | 3.21% | 0.39% | 0.01% | -12.84% | 3.20% |
| 过去三个月 | 12.32% | 2.44% | 1.15% | 0.01% | 11.17% | 2.43% |
| 过去六个月 | 36.72% | 1.89% | 2.43% | 0.01% | 34.29% | 1.88% |
| 过去一年 | 46.32% | 1.44% | 5.55% | 0.02% | 40.77% | 1.42% |
| 过去三年 | 60.38% | 1.08% | 19.01% | 0.02% | 41.37% | 1.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 205.83% | 1.44% | 69.27% | 0.02% | 136.56% | 1.42% |

3.2.2 自基金合同生效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：本基金合同规定本基金投资组合为：股票投资比例为基金净资产的 10%—85%；权证投资比例为基金净资产的 0%—3%；债券投资比例为基金净资产的 10%—85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的 5%以上。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：久嘉证券投资基金；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 | | |
| 徐九龙 | 长城安心回报混合基金、长城医疗保健基金、长城新兴产业基金的基金经理 | 2009 年 1 月 6 日 | - | 13 年 | 男，中国籍，兰州大学理学学士、中山大学理学硕士。曾就职深圳市沙头角保税区管理局、深圳市经济贸易局。2002 年 3 月进入长城基 |

| | | | | | |
|-----|-------------------|-----------|---|----|--|
| | | | | | 金管理有限公司，曾任基金管理部研究员、“长城久富核心成长股票型证券投资基金”基金经理、“长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。 |
| 郑帮强 | 长城安心回报混合基金的基金经理助理 | 2015年1月9日 | - | 4年 | 男，中国籍，华中科技大学工业工程学士、华中科技大学管理科学与工程硕士。曾就职于长江证券股份有限公司。2013年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员。 |

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。

③本基金的基金经理助理郑帮强先生于 2015 年 7 月 7 日离任，并自 2015 年 7 月 8 日起担任“长城优化升级混合型证券投资基金”的基金经理。

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》、《长城安心回报混合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

今年上半年上证指数虽小幅下跌，但波动幅度变窄，操作的空间越来越小。但以创业板为代表的中小市值股票先扬后抑，波动幅度加大。

本基金的大类资产一直配置在消费板块，一方面基于消费类大市值股票估值相对较低，中长期看风险不大；另一方面，本基金持有较多的医药股。在目前市场状况下，本基金没有大幅调整持仓结构，因此仓位和结构变化不大。

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 36.72%，在同类可比的基金中排名靠后。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的情况看，我国经济在微刺激的政策作用下，出现短期企稳迹象，但下行压力犹存。我们认为，下半年市场走势将取决于宏观政策、房地产销售状况以及上市公司的业绩增长情况，

市场仍然呈现震荡格局，小市值股票风险较大。我们将逐步调整和优化组合，争取在控制风险的前提下竭力改善基金的投资绩效。

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、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、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《长城安心回报混合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 12 次，年度收益分配比例不低于基金可分配收益的 60%，基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值。

截止本报告期末，本基金可供分配利润为 1,277,478,625.11 元，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长城基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：长城安心回报混合型证券投资基金

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 | | 196,099,090.93 | 216,695,805.68 |
| 结算备付金 | | 642,399.92 | 7,135,356.41 |
| 存出保证金 | | 1,510,394.37 | 775,050.47 |
| 交易性金融资产 | | 2,914,697,732.47 | 5,376,659,434.77 |
| 其中：股票投资 | | 2,486,793,732.47 | 4,736,200,894.77 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 427,904,000.00 | 640,458,540.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 60,000,290.00 | 214,045,721.07 |
| 应收证券清算款 | | - | 18,951,751.87 |
| 应收利息 | | 4,386,605.11 | 8,673,480.71 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 689,261.99 | 5,852.93 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 3,178,025,774.79 | 5,842,942,453.91 |
| 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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 26,765,214.07 | 14,256,956.52 |
| 应付赎回款 | | 59,114,329.60 | 20,695,185.67 |
| 应付管理人报酬 | | 4,806,412.87 | 7,595,398.98 |
| 应付托管费 | | 801,068.80 | 1,265,899.83 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 4,250,694.67 | 2,676,992.21 |
| 应交税费 | | 206,630.13 | 206,630.13 |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 1,075,519.19 | 1,219,878.16 |
| 负债合计 | | 97,019,869.33 | 47,916,941.50 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 1,307,978,785.11 | 3,363,583,254.91 |
| 未分配利润 | | 1,773,027,120.35 | 2,431,442,257.50 |
| 所有者权益合计 | | 3,081,005,905.46 | 5,795,025,512.41 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,178,025,774.79 | 5,842,942,453.91 |

注：报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0463 元，基金份额总额 2,944,574,626.38 份。

6.2 利润表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

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 | | 2,260,377,710.81 | 100,955,539.27 |
| 1.利息收入 | | 14,614,267.13 | 25,210,314.81 |
| 其中：存款利息收入 | | 1,235,257.41 | 2,654,923.80 |
| 债券利息收入 | | 12,262,293.47 | 19,533,427.14 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,116,716.25 | 3,021,963.87 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,970,200,274.01 | 105,676,894.87 |
| 其中：股票投资收益 | | 1,943,806,183.00 | 41,784,624.39 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 7,042,149.68 | 5,384,216.93 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 19,351,941.33 | 58,508,053.55 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 275,230,475.20 | -30,111,739.56 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 332,694.47 | 180,069.15 |
| 减：二、费用 | | 63,922,218.58 | 69,348,814.86 |
| 1. 管理人报酬 | | 41,237,795.36 | 55,593,864.90 |
| 2. 托管费 | | 6,872,965.89 | 9,265,644.15 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|--|-------------------------|----------------------|
| 4. 交易费用 | | 15,109,575.51 | 3,768,803.23 |
| 5. 利息支出 | | 428,603.71 | 428,000.54 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 428,603.71 | 428,000.54 |
| 6. 其他费用 | | 273,278.11 | 292,502.04 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,196,455,492.23 | 31,606,724.41 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,196,455,492.23 | 31,606,724.41 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

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） | 3,363,583,254.91 | 2,431,442,257.50 | 5,795,025,512.41 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 2,196,455,492.23 | 2,196,455,492.23 |
| 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） | -2,055,604,469.80 | -2,854,870,629.38 | -4,910,475,099.18 |
| 其中：1.基金申购款 | 29,281,406.46 | 39,346,672.13 | 68,628,078.59 |
| 2.基金赎回款 | -2,084,885,876.26 | -2,894,217,301.51 | -4,979,103,177.77 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,307,978,785.11 | 1,773,027,120.35 | 3,081,005,905.46 |
| 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 | 4,866,045,495.80 | 2,932,801,849.33 | 7,798,847,345.13 |

| | | | |
|--|------------------|------------------|------------------|
| 金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 31,606,724.41 | 31,606,724.41 |
| 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) | -334,152,425.40 | -200,826,430.10 | -534,978,855.50 |
| 其中:1.基金申购款 | 42,983,390.51 | 26,129,871.45 | 69,113,261.96 |
| 2.基金赎回款 | -377,135,815.91 | -226,956,301.55 | -604,092,117.46 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 4,531,893,070.40 | 2,763,582,143.64 | 7,295,475,214.04 |

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

长城安心回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由长城基金管理有限公司发起,经中国证券监督管理委员会(中国证监会)“证监基金字[2006]23号”《关于同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的批复》核准,基金合同于2006年8月22日生效的契约型开放式证券投资基金,存续期限不定,首次设立募集规模为1,416,548,067.74份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

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。本基金的业绩比较基准为:银行一年期定期存款(税前)利率的2倍。

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

本基金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 06 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

本基金于本期未发生会计差错更正。

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 关联方关系

6.4.7.1 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

本报告期无对本基金存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行 | 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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 | 695,059,308.07 | 8.21% | - | - |
| 东方证券 | 142,748,827.49 | 1.69% | - | - |

6.4.8.1.2 债券交易

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 | 111,616,364.38 | 53.24% | 78,430,700.00 | 18.87% |

6.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

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。

6.4.8.1.5 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 | 632,782.47 | 8.21% | 229,937.04 | 5.43% |
| 东方证券 | 129,958.18 | 1.69% | - | - |

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。

本基金上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 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 | 41,237,795.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,490,217.70 | 9,917,454.90 |

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三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

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 | 6,872,965.89 | 9,265,644.15 |

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三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.8.4.2 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：除基金管理人之外的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。

6.4.8.5 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 |
| 中国农业银行 | 196,099,090.93 | 1,185,187.47 | 315,423,803.61 | 2,623,994.27 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|----------------|----|
| 000963 | 华东医药 | 2015年6月26日 | 重大事项停牌 | 62.50 | 2015年8月5日 | 69.20 | 3,200,000 | 114,377,458.51 | 200,000,000.00 | - |
| 001696 | 宗申动力 | 2015年6月30日 | 重大事项停牌 | 18.31 | 2015年8月24日 | 15.53 | 6,000,000 | 92,633,829.13 | 109,860,000.00 | - |
| 600872 | 中炬高新 | 2015年5月4日 | 重大事项停牌 | 23.16 | - | - | 4,000,000 | 40,232,505.25 | 92,640,000.00 | - |
| 600790 | 轻纺城 | 2015年5月25日 | 重大事项停牌 | 12.42 | 2015年8月18日 | 12.04 | 1,300,000 | 15,048,157.00 | 16,146,000.00 | - |
| 300287 | 飞利信 | 2015年6月2日 | 重大事项停牌 | 54.26 | - | - | 240,000 | 8,692,100.00 | 13,022,400.00 | - |
| 002353 | 杰瑞股份 | 2015年5月27日 | 重大事项停牌 | 35.04 | - | - | 150 | 7,166.00 | 5,256.00 | - |

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2015 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押证券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2015 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押证券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 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 06 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 2,055,120,076.47 元，划分为第二层级的余额为人民币 859,577,656.00 元，无划分为第三层级余额。

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 | 2,486,793,732.47 | 78.25 |
| | 其中：股票 | 2,486,793,732.47 | 78.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 427,904,000.00 | 13.46 |
| | 其中：债券 | 427,904,000.00 | 13.46 |
| | 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 | 60,000,290.00 | 1.89 |
| | 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 | 196,741,490.85 | 6.19 |
| 7 | 其他各项资产 | 6,586,261.47 | 0.21 |
| 8 | 合计 | 3,178,025,774.79 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,848,305,332.47 | 59.99 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 407,865,000.00 | 13.24 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 121,542,400.00 | 3.94 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 16,146,000.00 | 0.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 82,801,000.00 | 2.69 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 10,134,000.00 | 0.33 |
| | 合计 | 2,486,793,732.47 | 80.71 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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 | 000963 | 华东医药 | 3,200,000 | 200,000,000.00 | 6.49 |
| 2 | 600511 | 国药股份 | 3,500,000 | 176,365,000.00 | 5.72 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,800,000 | 169,252,000.00 | 5.49 |
| 4 | 300026 | 红日药业 | 7,500,000 | 168,300,000.00 | 5.46 |
| 5 | 600079 | 人福医药 | 3,700,000 | 137,085,000.00 | 4.45 |
| 6 | 000513 | 丽珠集团 | 1,800,000 | 122,094,000.00 | 3.96 |
| 7 | 000661 | 长春高新 | 900,000 | 117,000,000.00 | 3.80 |
| 8 | 600594 | 益佰制药 | 2,000,000 | 116,260,000.00 | 3.77 |
| 9 | 002294 | 信立泰 | 4,000,000 | 114,400,000.00 | 3.71 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 6,000,000 | 113,400,000.00 | 3.68 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站 (www.ccfund.com.cn) 的半年度报告正文。

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 | 000651 | 格力电器 | 199,330,695.33 | 3.44 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 183,781,846.12 | 3.17 |
| 3 | 002294 | 信立泰 | 136,550,370.14 | 2.36 |
| 4 | 001696 | 宗申动力 | 115,803,989.15 | 2.00 |
| 5 | 600518 | 康美药业 | 92,522,642.25 | 1.60 |
| 6 | 600685 | 广船国际 | 83,609,044.98 | 1.44 |
| 7 | 600511 | 国药股份 | 73,154,691.69 | 1.26 |
| 8 | 601628 | 中国人寿 | 71,598,282.46 | 1.24 |
| 9 | 000902 | 新洋丰 | 71,160,695.17 | 1.23 |
| 10 | 601313 | 江南嘉捷 | 65,831,701.88 | 1.14 |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 45,420,375.97 | 0.78 |
| 12 | 600037 | 歌华有线 | 38,335,735.25 | 0.66 |
| 13 | 300026 | 红日药业 | 35,828,193.91 | 0.62 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 32,350,000.00 | 0.56 |
| 15 | 000555 | 神州信息 | 30,376,608.88 | 0.52 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 16 | 000523 | 广州浪奇 | 29,575,630.92 | 0.51 |
| 17 | 002236 | 大华股份 | 27,397,169.72 | 0.47 |
| 18 | 600999 | 招商证券 | 27,214,094.35 | 0.47 |
| 19 | 600109 | 国金证券 | 26,627,700.23 | 0.46 |
| 20 | 000826 | 桑德环境 | 24,984,659.34 | 0.43 |

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 | 353,748,824.89 | 6.10 |
| 2 | 600594 | 益佰制药 | 340,212,238.84 | 5.87 |
| 3 | 600535 | 天士力 | 329,764,139.20 | 5.69 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 313,579,892.63 | 5.41 |
| 5 | 000513 | 丽珠集团 | 275,968,626.75 | 4.76 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 268,421,014.97 | 4.63 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 264,466,489.27 | 4.56 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 253,000,906.47 | 4.37 |
| 9 | 000963 | 华东医药 | 239,123,516.50 | 4.13 |
| 10 | 000625 | 长安汽车 | 228,308,637.02 | 3.94 |
| 11 | 000895 | 双汇发展 | 226,400,671.01 | 3.91 |
| 12 | 600557 | 康缘药业 | 188,482,534.49 | 3.25 |
| 13 | 000400 | 许继电气 | 175,944,814.27 | 3.04 |
| 14 | 600406 | 国电南瑞 | 152,733,059.25 | 2.64 |
| 15 | 600518 | 康美药业 | 135,535,828.23 | 2.34 |
| 16 | 002065 | 东华软件 | 129,919,046.63 | 2.24 |
| 17 | 000826 | 桑德环境 | 114,858,010.00 | 1.98 |
| 18 | 002063 | 远光软件 | 113,244,308.34 | 1.95 |
| 19 | 002555 | 顺荣三七 | 108,502,978.75 | 1.87 |
| 20 | 600079 | 人福医药 | 103,725,941.53 | 1.79 |

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 | 1,997,457,760.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 6,472,620,607.70 |

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 | 70,501,000.00 | 2.29 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 275,492,000.00 | 8.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 275,492,000.00 | 8.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 81,911,000.00 | 2.66 |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 427,904,000.00 | 13.89 |

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

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 | 130234 | 13 国开 34 | 1,500,000 | 146,640,000.00 | 4.76 |
| 2 | 1382138 | 13 甘公投 MTN1 | 500,000 | 51,800,000.00 | 1.68 |
| 3 | 019501 | 15 国债 01 | 500,000 | 50,385,000.00 | 1.64 |
| 4 | 110237 | 11 国开 37 | 500,000 | 48,065,000.00 | 1.56 |
| 5 | 110410 | 11 农发 10 | 300,000 | 30,387,000.00 | 0.99 |

7.7 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。

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

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

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，本期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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 | 1,510,394.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,386,605.11 |
| 5 | 应收申购款 | 689,261.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,586,261.47 |

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 | 000963 | 华东医药 | 200,000,000.00 | 6.49 | 重大事项停牌 |

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 |
| 198,326 | 14,847.14 | 8,075,652.32 | 0.27% | 2,936,498,974.06 | 99.73% |

8.2 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 | 1,865.87 | 0.0001% |

8.3 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 |
|-----------------|---|

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2006年8月22日）基金份额总额 | 1,416,548,067.74 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,572,225,068.48 |
| 本报告期基金总申购份额 | 65,919,282.40 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,693,569,724.50 |
| 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 | 2,944,574,626.38 |

§ 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

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

报告期内本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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所未发生变化。

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

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其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 | |
| 招商证券 | 2 | 1,520,466,345.43 | 17.95% | 1,384,233.77 | 17.95% | - |
| 国信证券 | 2 | 1,416,129,169.48 | 16.72% | 1,289,245.77 | 16.72% | - |
| 国泰君安 | 2 | 1,117,790,661.12 | 13.20% | 1,017,640.92 | 13.20% | - |
| 西南证券 | 1 | 894,279,941.53 | 10.56% | 814,153.04 | 10.56% | - |
| 中信建投 | 1 | 865,883,681.14 | 10.22% | 788,299.65 | 10.22% | - |
| 中信证券 | 2 | 810,666,608.57 | 9.57% | 738,029.64 | 9.57% | - |
| 长城证券 | 3 | 695,059,308.07 | 8.21% | 632,782.47 | 8.21% | - |
| 华西证券 | 1 | 430,967,275.14 | 5.09% | 392,350.71 | 5.09% | - |
| 大同证券 | 1 | 338,402,997.33 | 4.00% | 308,082.19 | 4.00% | - |
| 银河证券 | 2 | 237,683,553.36 | 2.81% | 216,387.52 | 2.81% | - |
| 东方证券 | 1 | 142,748,827.49 | 1.69% | 129,958.18 | 1.69% | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止本报告期末共计 36 个交易单元。

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。

10.7.2 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 |
| 招商证券 | 10,128,000.00 | 4.83% | 103,600,000.00 | 9.50% | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 20,580,000.00 | 9.82% | 786,600,000.00 | 72.15% | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|----------------|--------|-----------------|--------|---|---|
| 中信建投 | 38,800,600.00 | 18.51% | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | -200,000,000.00 | 18.35% | - | - |
| 长城证券 | 111,616,364.38 | 53.24% | - | - | - | - |
| 华西证券 | 28,524,400.00 | 13.61% | - | - | - | - |
| 大同证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | - | - | - | - | - | - |
| 红塔证券 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |