

# 长城久鑫保本混合型证券投资基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 03 月 24 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。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 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.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 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.....	50
8.7 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.....	50

8.8 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 .....	50
8.9 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 .....	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.3 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 .....	52
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 其他重大事件 .....	55
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
13.1 备查文件目录 .....	70
13.2 存放地点 .....	70
13.3 查阅方式 .....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久鑫保本混合型证券投资基金
基金简称	长城久鑫保本
基金主代码	000649
交易代码	000649
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 7 月 30 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,190,559,018.06 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在安全资产和风险资产之间的大类资产配置策略，包括固定比例组合保险策略（CPPI）+时间不变性投资组合保险策略（TIPP）；另一层为安全资产的投资策略（债券投资策略和可转换债券投资策略）和风险资产的投资策略（股票投资策略和新股申购策略）。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	王永民
	联系电话	0755-23982338	010-66594896
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95566
传真		0755-23982328	010-66594942
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	层	
邮政编码	518026	100818
法定代表人	杨光裕	田国立

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司	北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦写字楼 9 层

注：本基金第一个保本周期的保证人为中海信达担保有限公司，第一个保本周期已于 2015 年 5 月 19 日提前到期。本基金自 2015 年 6 月 15 日起进入第二个保本周期，第二个保本周期的保证人为中国投融资担保股份有限公司。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015 年	2014 年 7 月 30 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	436,888,620.32	114,080,913.96
本期利润	464,206,981.59	136,541,673.90
加权平均基金份额本期利润	0.1651	0.0507
本期加权平均净值利润率	15.68%	4.97%
本期基金份额净值增长率	20.33%	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	642,775,915.03	105,488,000.92
期末可供分配基金份额利润	0.2015	0.0433

期末基金资产净值	3,294,940,154.85	2,559,714,611.98
期末基金份额净值	1.033	1.051
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	26.47%	5.10%

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。

④本基金合同于 2014 年 7 月 30 日生效。

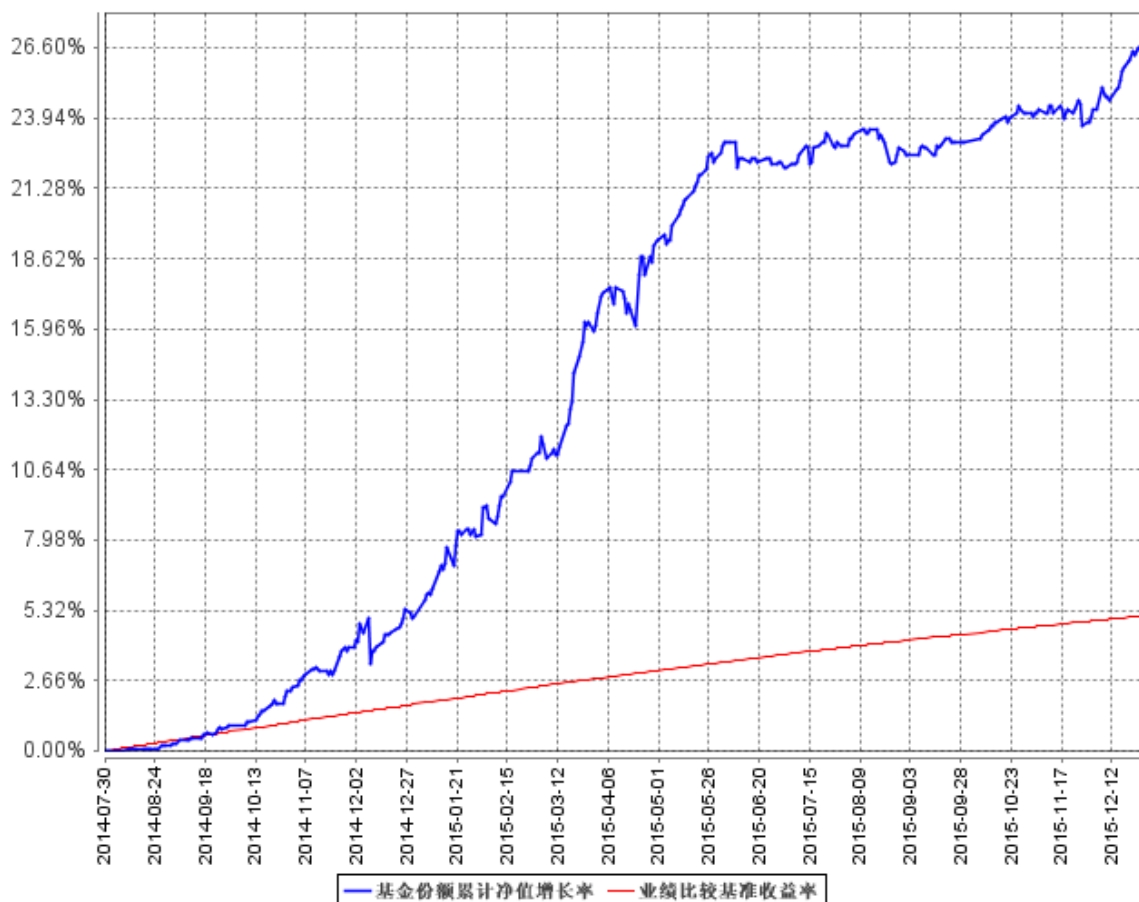
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	2.79%	0.19%	0.71%	0.01%	2.08%	0.18%
过去六个月	3.40%	0.18%	1.50%	0.01%	1.90%	0.17%
过去一年	20.33%	0.27%	3.37%	0.01%	16.96%	0.26%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	26.47%	0.26%	5.14%	0.01%	21.33%	0.25%

### 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

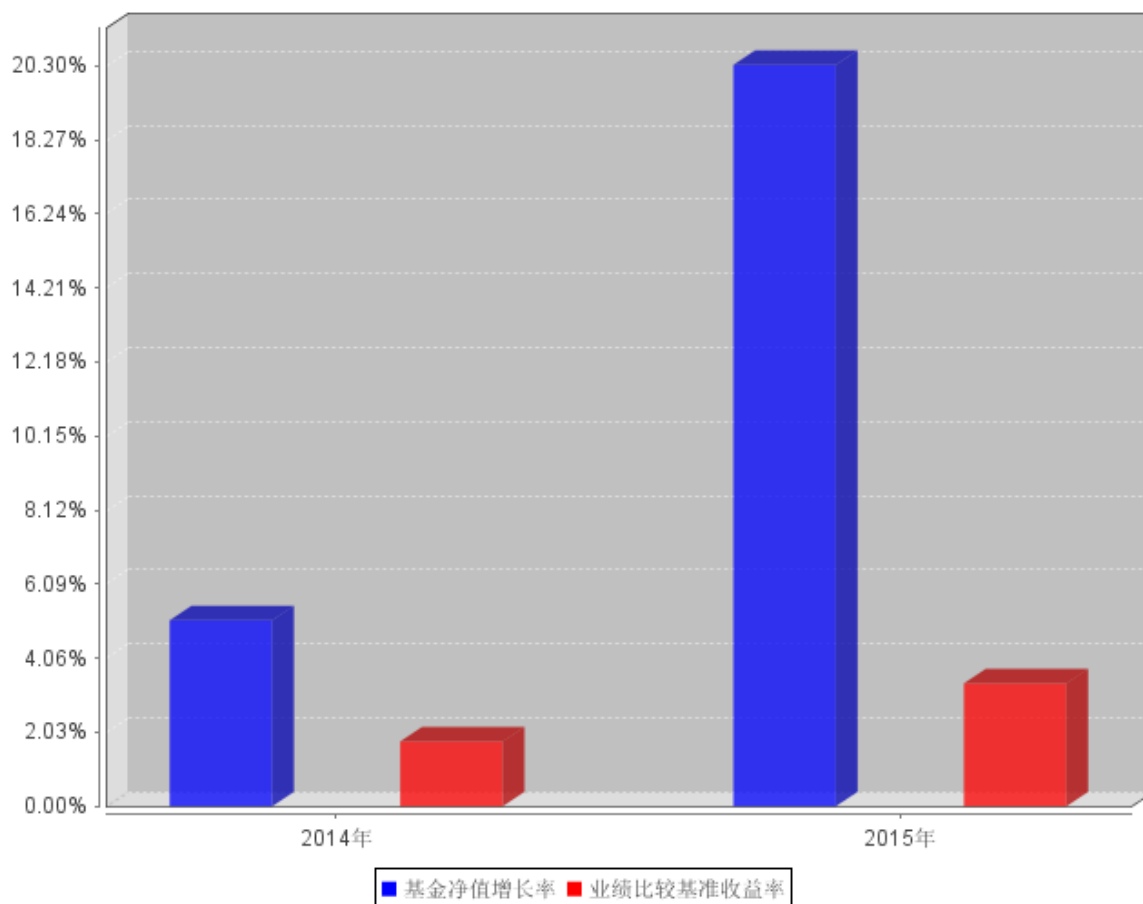


注：本基金合同规定本基金投资组合为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于 2014 年 07 月 30 日生效，自基金合同生效以来未进行利润分配。

## § 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：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、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、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、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、长城优化升级混合型证券投资基金、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、长城医疗保健混合型证券投资基金、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、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略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		
史彦刚	长城稳健增利债券基金、长城岁岁金理财债券基金、长城久利保本基金、长城淘金债券型基金、长城久鑫保本基金、长城久盈纯债分级债券型基金、长城	2014 年 7 月 30 日	-	8 年	男，中国籍，中国人民大学经济学硕士。曾就职于中国工商银行总行信贷评估部、中国银行业监督管理委员会监管一部、中信银行总行风险管理部，2007 年 9 月至 2009 年 3 月任嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师，2009 年 3 月至 2011 年 6 月任国泰基金管理有限公司固定收益投资经理。2011 年 6 月进入长城基金管理有限公司基金管理部工作。

	久惠保本、长城新策略混合基金的基金经理				
储雯玉	长城稳固、长城久惠保本、长城久利保本、长城久鑫保本基金的基金经理	2015年10月15日	-	7年	女，中国籍，中央财经大学经济学学士、北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。2008年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员，“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理。
马强	长城久恒基金、长城久鑫保本、长城新策略混合基金的基金经理	2015年12月15日	-	3年	男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、自2015年1月9日至2015年6月23日担任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”和“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”基金经理助理，自2015年3月9日至2015年6月23日担任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理。
李振兴	长城久利保本基金、长城保本混合基金和长城久鑫保本混合基金的基金经理	2014年9月5日	2015年10月15日	7年	男，中国籍，武汉大学计算机、工商管理双学士、金融学硕士。具有7年证券从业经历。曾就职于艾默生网络能源有限公司。2008年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、长城基金管理有限公司“长城久利保本基金”、“长城保本混合型证券投资

					资基金”基金经理助理。
--	--	--	--	--	-------------

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》、《长城久鑫保本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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2015 年，国内经济增速相对平稳，经济结构在向积极的方向调整和变化，但是经济仍然存在一定的下行压力，基础设施投资增速从中高速大幅回落，受到外围国家贬值影响，出口竞争力大幅下降，贸易顺差更多来自于大宗商品价格回落带来的进口增速下降。2015 年，美国经济一枝独秀，美联储加息预期逐步升温，资金回流和资产回报率上升带来美元持续升值；大宗商品雪上加霜，原油价格迭创新低，需求持续萎靡；日本、欧洲不断通过量化宽松等手段刺激经济，然而效果并不甚明显。

货币政策坚持稳健灵活的基调，实现政策预调微调，年内实施了多次降准降息，人民币利率逐步实现市场化，SHIBOR、回购利率等市场化利率在利率传导中的作用不断提升；人民币加入 SDR，汇率中间价逐步放开，实现了在相对均衡利率水平上的合理浮动，人民币从盯住美元逐步转向盯住一篮子货币。

2015 年，受到大宗商品价格大幅下跌、PPI 等原材料价格指标持续负增长等因素影响，国内通胀压力较小，CPI 保持相对低位运行，并且出现了一定的通缩压力。

2015 年，债券市场收益率继续下行，原因来自于三个方面，一是从中长期来看，国内利率水平仍有下行空间，收益率曲线尽管平坦化，但是长端收益率与国外仍然有较大的正息差；二是受到信托资产收缩、银行理财资金配置需求扩张的影响，利率债出现阶段性的供求失衡；三是信用风险逐步显现，部分债券出现违约迹象，信用息差分化加大。

2015 年股票市场经历了多年以来的大牛市，同时也经历了前所未有的市场波动，在市场结构分化明显、波动率不断加大的背景下，我们秉承了两个原则，一是自下而上选择优质成长股，选择看得准、估值合理、行业空间大的个股进行投资；二是严格控制风险敞口，灵活调整组合仓位，防止市场大起大落带来净值的大幅波动。

我们通过保持灵活的仓位，均衡行业与个股配置，较好的控制了净值回撤和波动性，总体实现了良好而稳健的投资收益。我们保持了中性偏长的久期，控制杠杆率，通过灵活的利率债波段操作提高组合的债券收益；有效利用组合现金头寸和回购杠杆，积极参与新股和新债投资，对于组合收益有较好的增厚。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 20.33%，同期业绩比较基准收益率为 3.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年国内一方面要面对供给侧改革、传统产业产能升级替代的压力，另一方面也要面对战略新兴产业和新的产业增长点逐步释放产生的动力。压力和动力的切换对于 2016 年经济增长形成了一定的不确定性。总体来看，结构性的变化将是 2016 年经济的主要特征，三次产业结构仍然在逐步向第三产业倾斜，工业增加值增速水平保持稳定，但是工业产值结构将发生较大变化，在人民币国际化的背景下，中国的进出口将更多融入国际产业分工和比较优势的大格局。

受到外围经济疲软等因素影响，美联储加息的基础有所动摇，在此背景下，如何促进全球经济的平稳增长，防止不同国家货币的竞争性贬值将是 2016 年的重要命题，美国独善其身，一枝独秀的格局或许会发生一定的变化。

宏观经济政策将整体偏于宽松，积极的财政政策符合稳增长和化解债务风险的需要。货币政策仍将保持稳健，外汇占款持续疲弱带来的基础货币缺口需要降准或其他数量手段对冲，实体经济（地产、小微、三农）需要低利率货币金融环境的支持，利率走廊不断收窄、平坦化将是大概率事件。在总需求低位和输入型通缩的组合下，国内通胀保持稳定。

展望 2016 年，权益投资方面，一是要关注市场结构变化的影响，随着中国市场的不断开放和注册制的逐步推进，股票资产定价将更加市场化；二是要在供给侧改革和经济结构调整过程中寻找实质性受益的公司和行业。在资金利率保持低位、经济保持平稳增长的背景下，我们认为权益资产仍然存在阶段性和结构性机会，但是市场波动性会有所增加。我们将根据基金合同的要求，合理控制组合仓位，选择基本面较好的个股进行投资，在行业把握上偏重符合经济发展方向的服务型消费行业、符合供给侧改革的优秀龙头企业和符合国家政策方向的智能制造、人工智能和军民参类个股，力争取得较好的风险调整后收益。

债券投资方面，经济基本面和政策面对债市仍有支撑，但收益率水平已处于历史较低水平，总体下行空间取决于是否有进一步的降息降准，也要关注 2016 年地方债扩容、银行理财资金容量等因素对于供求结构的影响。总需求持续低迷和去库存压力可能带来部分行业继续下行，不排除有信用风险发生的可能性，仍需要加强对信用风险的跟踪关注。2016 年，我们将保持组合债券仓位基本稳定，灵活调整组合久期，适当提高高评级信用债占比。根据市场情况，适当把握债券的进攻性机会，在降低组合波动性的前提下努力提高组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

#### 4.7 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

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。

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长城久鑫保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行



了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2016)审字第 60737541_H21 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城久鑫保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长城久鑫保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长城基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相

	<p>关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久鑫保本混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国北京	
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长城久鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	91,519,077.01	55,453,844.73
结算备付金		19,526,843.38	15,248,838.42
存出保证金		159,129.77	590,786.98
交易性金融资产	7.4.7.2	2,357,204,232.39	2,870,833,943.58
其中：股票投资		296,322,857.54	312,821,686.17
基金投资		-	-
债券投资		2,060,881,374.85	2,558,012,257.41
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	790,002,195.00	391,305,181.16
应收证券清算款		211,978,805.52	30,861,584.79
应收利息	7.4.7.5	30,914,294.62	46,792,236.68
应收股利		-	-
应收申购款		260,025.97	193,131.10
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,501,564,603.66	3,411,279,547.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		200,000,000.00	808,067,824.00
应付证券清算款		-	21,112,760.58
应付赎回款		1,762,688.40	17,590,574.39
应付管理人报酬		3,364,168.90	2,685,146.08
应付托管费		560,694.84	447,524.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	723,362.79	1,066,323.36
应交税费		-	-
应付利息		-	185,539.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	213,533.88	409,243.40
负债合计		206,624,448.81	851,564,935.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,606,205,952.57	2,434,805,648.33
未分配利润	7.4.7.10	688,734,202.28	124,908,963.65
所有者权益合计		3,294,940,154.85	2,559,714,611.98
负债和所有者权益总计		3,501,564,603.66	3,411,279,547.44

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额 3,190,559,018.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基 金合同生效日)至 2014年12月31日
<b>一、收入</b>		523,286,696.63	161,286,766.76
1. 利息收入		108,613,742.64	57,261,126.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,000,100.66	3,521,674.62
债券利息收入		88,506,800.24	45,297,001.25

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,106,841.74	8,442,450.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		379,372,849.63	79,526,727.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	315,042,194.43	56,783,452.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	64,245,734.65	22,727,274.36
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	84,920.55	16,000.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,318,361.27	22,460,759.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	7,981,743.09	2,038,153.63
<b>减：二、费用</b>		59,079,715.04	24,745,092.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	33,579,181.77	13,910,953.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,596,530.32	2,318,492.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,866,220.41	1,881,704.16
5. 利息支出		15,520,826.41	6,417,385.30
其中：卖出回购金融资产支出		15,520,826.41	6,417,385.30
6. 其他费用	7.4.7.20	516,956.13	216,558.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		464,206,981.59	136,541,673.90
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		464,206,981.59	136,541,673.90

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	2,434,805,648.33	124,908,963.65	2,559,714,611.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	464,206,981.59	464,206,981.59

润)			
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)	171,400,304.24	99,618,257.04	271,018,561.28
其中: 1. 基金申购款	2,390,437,109.53	506,879,398.45	2,897,316,507.98
2. 基金赎回款	-2,219,036,805.29	-407,261,141.41	-2,626,297,946.70
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)	2,606,205,952.57	688,734,202.28	3,294,940,154.85
项目	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31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)	2,800,983,932.91	-	2,800,983,932.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	136,541,673.90	136,541,673.90
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)	-366,178,284.58	-11,632,710.25	-377,810,994.83
其中: 1. 基金申购款	29,156,316.25	663,084.69	29,819,400.94
2. 基金赎回款	-395,334,600.83	-12,295,794.94	-407,630,395.77
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)	2,434,805,648.33	124,908,963.65	2,559,714,611.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

          杨光裕                                          熊科金                                          彭洪波            
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长城久鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以

下简称“中国证监会”)证监许可[2014] 469 号文“关于核准长城久鑫保本混合型证券投资基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司自 2014 年 6 月 26 日至 2014 年 7 月 25 日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014) 验字第 60737541\_H04 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 7 月 30 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 2,799,907,406.06 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 1,076,526.85 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 2,800,983,932.91 元,折合 2,800,983,932.91 份基金份额。本基金的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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金将投资对象主要分为安全资产和风险资产,其中安全资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券和债券回购等)、银行存款等;风险资产为股票、权证等。本基金按照 CPPI 和 TIPP 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中,股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于 60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构今后允许基金投资其他品种,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:3 年期银行定期存款税后收益率。

#### 7.4.2 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 2 号《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要



意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 本基金在保本周期内仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。如基金转型为“长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金”，基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

截止本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《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》的通知的规定,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 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、中国证监会财税[2015]101 号文《关于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 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	91,519,077.01	55,453,844.73
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	91,519,077.01	55,453,844.73

注：本基金于本期未投资于定期存款和其他存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	287,089,962.07	296,322,857.54	9,232,895.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	848,508,477.13	858,495,793.85	9,987,316.72
	银行间市场	1,171,826,671.98	1,202,385,581.00	30,558,909.02
	合计	2,020,335,149.11	2,060,881,374.85	40,546,225.74
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	2,307,425,111.18	2,357,204,232.39	49,779,121.21
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	291,369,545.75	312,821,686.17	21,452,140.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,359,823,378.15	1,357,529,257.41
	银行间市场	1,197,180,259.74	1,200,483,000.00
	合计	2,557,003,637.89	2,558,012,257.41
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,848,373,183.64	2,870,833,943.58	22,460,759.94

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	790,002,195.00	-
合计	790,002,195.00	-
项目	上年度末 2014年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	391,305,181.16	30,573,600.06
合计	391,305,181.16	30,573,600.06

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	上年度末 2014年12月31日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量(张)	估值总额	其中：已出售或再质押总额
1	041478001	14 牡国投	2015年1	98.96	100,000	9,896,000.00	-

		CP001	月 6 日				
2	101461030	14 温现代 MTN001	2015 年 1 月 6 日	100.28	200,000	20,056,000.00	-
合计					300,000	29,952,000.00	-

注：本基金于本期末未持有因买断式逆回购交易获得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	89,732.02	59,959.08
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	9,665.70	7,548.20
应收债券利息	30,404,143.08	46,623,206.22
应收买入返售证券利息	410,674.95	101,230.80
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	78.87	292.38
合计	30,914,294.62	46,792,236.68

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	682,732.31	1,026,141.48
银行间市场应付交易费用	40,630.48	40,181.88
合计	723,362.79	1,066,323.36

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	24,533.88	269,243.40
预提审计费	80,000.00	60,000.00
预提信息披露费	100,000.00	80,000.00

预提银行间账户维护费	4,500.00	-
预提上清所债券账户维护费	4,500.00	-
合计	213,533.88	409,243.40

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,434,805,648.33	2,434,805,648.33
本期申购	2,319,764,917.45	2,319,764,917.45
本期赎回(以“-”号填列)	-1,786,095,059.98	-1,786,095,059.98
2015年6月12日基金份额折算前	2,968,475,505.80	2,968,475,505.80
基金份额折算变动份额	665,605,617.06	-
本期申购	86,520,035.64	70,672,192.08
本期赎回(以“-”号填列)	-530,042,140.44	-432,941,745.31
本期末	3,190,559,018.06	2,606,205,952.57

注：(1)本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

(2) 根据长城基金管理有限公司于2015年5月13日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和官方网站披露的《长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的相关规则公告》的规定，长城久鑫保本混合型证券投资基金在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期，过渡期自2015年5月25日至2015年6月12日。过渡期最后一个工作日即2015年6月12日为折算日。折算后，本基金的基金份额净值调整为1.000元，折算比例为1:1.22422472。详见本管理人2015年6月16日《长城久鑫保本混合型证券投资基金转入下一保本周期过渡期折算结果的公告》。

#### 7.4.7.10 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	105,488,000.92	19,420,962.73	124,908,963.65
本期利润	436,888,620.32	27,318,361.27	464,206,981.59
本期基金份额交易产生的变动数	100,399,293.79	-781,036.75	99,618,257.04
其中：基金申购款	453,190,633.98	53,688,764.47	506,879,398.45
基金赎回款	-352,791,340.19	-54,469,801.22	-407,261,141.41



本期已分配利润	-	-	-
本期末	642,775,915.03	45,958,287.25	688,734,202.28

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
活期存款利息收入	2,742,810.28	717,715.35
定期存款利息收入	-	2,689,166.67
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	246,552.08	112,124.89
其他	10,738.30	2,667.71
合计	3,000,100.66	3,521,674.62

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出股票成交总额	1,381,573,950.83	525,698,435.48
减：卖出股票成本总额	1,066,531,756.40	468,914,982.80
买卖股票差价收入	315,042,194.43	56,783,452.68

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

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12月31日	2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	11,796,316,844.82	3,657,289,533.10
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	11,584,035,523.60	3,590,180,355.16
减：应收利息总额	148,035,586.57	44,381,903.58
买卖债券差价收入	64,245,734.65	22,727,274.36

**7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生衍生工具收益/损失。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	84,920.55	16,000.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	84,920.55	16,000.00

**7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	27,318,361.27	22,460,759.94
——股票投资	-12,219,244.95	21,452,140.42
——债券投资	39,537,606.22	1,008,619.52
——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	27,318,361.27	22,460,759.94

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	7,890,714.67	2,020,930.94

转出基金补偿收入	91,028.42	17,222.29
其他	-	0.40
合计	7,981,743.09	2,038,153.63

注：其他为新股中签返款差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	3,748,865.55	1,844,804.22
银行间市场交易费用	117,354.86	36,899.94
合计	3,866,220.41	1,881,704.16

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31日
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	120,000.00
上清所结算账户服务费	22,500.00	1,500.00
银行划款手续费	91,756.13	33,558.07
银行间债券账户服务费	22,500.00	1,500.00
其他	200.00	-
合计	516,956.13	216,558.07

注：其他为上清所 CFCA 证书费。

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年 12月31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	808,062,308.76	35.08%	374,108,293.21	29.41%

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年 12月31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	155,678,243.82	4.03%	398,942,305.15	12.11%

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年 12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
长城证券	1,520,109,000.00	4.67%	520,534,000.00	2.82%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	739,204.18	34.99%	157,891.79	23.13%
关联方名称	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日)至2014年12月31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	340,588.71	29.41%	271,954.17	26.50%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年7月30日(基金合同生效日) 至2014年12月31日
当期发生的基金应支付 的管理费	33,579,181.77	13,910,953.08
其中：支付销售机构的客 户维护费	15,734,272.51	6,206,570.76

注：1) 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1.20%的年费率计

提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2) 本期末本基金未支付的管理费余额人民币 3,364,168.90 元。(2014 年末,人民币 2,685,146.08 元)

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 7 月 30 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,596,530.32	2,318,492.25

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

2) 本期末本基金未支付的托管费余额人民币 560,694.84 元。(2014 年末,人民币 447,524.34 元)

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金本期及上年度可比期间内管理人均未有运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		2014 年 7 月 30 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行	91,519,077.01	2,742,810.28	55,453,844.73	717,715.35
------	---------------	--------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中国银行	011503005	15 中石化 SCP005	公募	500,000	49,947,500.00

注：本基金上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本年度未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	新股未上市	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
136097	15 鲁高 01	2015年12月21日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	5,820	582,000.00	582,000.00	-

##### 7.4.12.2 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	股票	停牌日期	停牌原	期末	复牌日期	复牌	数量（股）	期末	期末估值总	备注
----	----	------	-----	----	------	----	-------	----	-------	----

代码	名称		因	估值单价		开盘单价		成本总额	额	
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大事项停牌	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	200,000	6,199,151.37	6,250,000.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2015 年 12 月 31 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人民币 0.00 元,无质押证券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止,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人民币 200,000,000.00 元,于 2016 年 01 月 07 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。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。于本期末，除附注 7.4.12 期末持有的流通受限证券外，本基金持有的证券在本年度末均能及时变现。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受市场利率变化的影响。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	91,519,077.01	-	-	-	-	-	91,519,077.01
结算备付金	19,526,843.38	-	-	-	-	-	19,526,843.38
存出保证金	159,129.77	-	-	-	-	-	159,129.77
交易性金融资产	50,116,000.00	49,180,000.00	209,513,893.14	977,300,884.11	774,770,597.60	296,322,857.54	2,357,204,232.39
买入返售金融资产	790,002,195.00	-	-	-	-	-	790,002,195.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-211,978,805.52	211,978,805.52

应收利息							30,914,294.62	30,914,294.62
应收申购款							260,025.97	260,025.97
其他资产								
资产总计	951,323,245.16	49,180,000.00	209,513,893.14	977,300,884.11	774,770,597.60	539,475,983.65	3,501,564,603.66	
负债								
卖出回购金融资产款	200,000,000.00							200,000,000.00
应付赎回款							1,762,688.40	1,762,688.40
应付管理人报酬							3,364,168.90	3,364,168.90
应付托管费							560,694.84	560,694.84
应付交易费用							723,362.79	723,362.79
其他负债							213,533.88	213,533.88
负债总计	200,000,000.00						6,624,448.81	206,624,448.81
利率敏感度缺口	751,323,245.16	49,180,000.00	209,513,893.14	977,300,884.11	774,770,597.60			
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	55,453,844.73							55,453,844.73
结算备付金	15,248,838.42							15,248,838.42
存出保证金	590,786.98							590,786.98
交易性金融资产	36,366,210.00	131,491,298.00	522,097,900.00	1,351,315,713.61	516,741,135.80	312,821,686.17		2,870,833,943.58
买入返售金融资产	391,305,181.16							391,305,181.16
应收证券清算款							30,861,584.79	30,861,584.79
应收利息							46,792,236.68	46,792,236.68
应收申购款							193,131.10	193,131.10
其他资产								
资产总计	498,964,861.29	131,491,298.00	522,097,900.00	1,351,315,713.61	516,741,135.80	390,668,638.74		3,411,279,547.44
负债								
卖出回购金融资产款	807,316,825.50	750,998.50						808,067,824.00
应付证券清算款							21,112,760.58	21,112,760.58
应付赎回款							17,590,574.39	17,590,574.39
应付管理人报酬							2,685,146.08	2,685,146.08
应付托管费							447,524.34	447,524.34
应付交易费用							1,066,323.36	1,066,323.36

应付利息	-	-	-	-	-	185,539.31	185,539.31
其他负债	-	-	-	-	-	409,243.40	409,243.40
负债总计	807,316,825.50	750,998.50	-	-	-	43,497,111.46	851,564,935.46
利率敏感度缺口	-308,351,964.21	130,740,299.50	522,097,900.00	1,351,315,713.61	516,741,135.80		

#### 7.4.13.4.1.2 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（2015年12月31日）	上年度末（2014年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-23,098,809.27	-18,564,534.14
	利率下降 25 个基点	23,616,219.30	18,910,345.43

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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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，所面临的最大其他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其他价格风险，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。

本基金按照固定比例组合保险策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

于本报告期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	296,322,857.54	8.99	312,821,686.17	12.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,060,881,374.85	62.55	2,558,012,257.41	99.93
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	2,357,204,232.39	71.54	2,870,833,943.58	112.15

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	1,926,098.57	938,465.06
	沪深 300 指数下降 5%	-1,926,098.57	-938,465.06

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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

本基金管理人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 12 月 31 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 405,800,561.15 元，划分为第二层次的余额为人民币

1,951,403,671.24 元，无划分为第三层次余额。于 2014 年 12 月 31 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 929,412,904.80 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,941,421,038.78 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。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 25 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

#### 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，本基金本报告期末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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	296,322,857.54	8.46
	其中：股票	296,322,857.54	8.46
2	固定收益投资	2,060,881,374.85	58.86
	其中：债券	2,060,881,374.85	58.86
	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	790,002,195.00	22.56
	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	111,045,920.39	3.17
7	其他各项资产	243,312,255.88	6.95
8	合计	3,501,564,603.66	100.00

## 8.2 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	9,300,500.00	0.28
B	采矿业	6,955,000.00	0.21
C	制造业	169,937,894.92	5.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,666,000.00	0.41
F	批发和零售业	3,804,804.44	0.12
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	3,095,058.18	0.09
J	金融业	64,418,000.00	1.96
K	房地产业	16,333,600.00	0.50
L	租赁和商务服务业	5,307,000.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	3,505,000.00	0.11
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	296,322,857.54	8.99

## 8.3 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	600160	巨化股份	3,627,633	85,140,546.51	2.58
2	000728	国元证券	700,000	15,813,000.00	0.48

3	002348	高乐股份	899,970	15,776,474.10	0.48
4	600369	西南证券	1,500,000	14,850,000.00	0.45
5	601555	东吴证券	900,000	14,463,000.00	0.44
6	600884	杉杉股份	277,800	10,900,872.00	0.33
7	601336	新华保险	200,000	10,442,000.00	0.32
8	002273	水晶光电	250,000	10,150,000.00	0.31
9	002477	雏鹰农牧	550,000	9,300,500.00	0.28
10	601009	南京银行	500,000	8,850,000.00	0.27
11	300031	宝通科技	280,000	8,792,000.00	0.27
12	601515	东风股份	500,000	8,290,000.00	0.25
13	600162	香江控股	800,000	7,288,000.00	0.22
14	002135	东南网架	600,000	7,266,000.00	0.22
15	000697	炼石有色	250,000	6,955,000.00	0.21
16	300192	科斯伍德	399,940	6,487,026.80	0.20
17	002713	东易日盛	200,000	6,400,000.00	0.19
18	600118	中国卫星	150,000	6,381,000.00	0.19
19	600699	均胜电子	200,000	6,250,000.00	0.19
20	000061	农产品	300,000	5,307,000.00	0.16
21	000926	福星股份	300,000	5,052,000.00	0.15
22	002361	神剑股份	300,000	4,878,000.00	0.15
23	300237	美晨科技	350,000	4,354,000.00	0.13
24	600340	华夏幸福	130,000	3,993,600.00	0.12
25	000593	大通燃气	250,000	3,582,500.00	0.11
26	603698	航天工程	100,000	3,505,000.00	0.11
27	300153	科泰电源	99,999	1,893,981.06	0.06
28	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.03
29	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
30	300113	顺网科技	5,000	506,850.00	0.02
31	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.01
32	300497	富祥股份	5,523	237,654.69	0.01
33	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.01
34	002787	华源包装	10,011	163,880.07	0.00
35	300494	盛天网络	6,251	162,901.06	0.00
36	603299	井神股份	23,499	124,779.69	0.00
37	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.00
38	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.00
39	002778	高科石化	5,600	47,600.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300113	顺网科技	114,845,934.91	4.49
2	000651	格力电器	108,518,095.38	4.24
3	600160	巨化股份	72,563,374.54	2.83
4	601211	国泰君安	44,792,367.00	1.75
5	601929	吉视传媒	32,274,233.96	1.26
6	600028	中国石化	29,089,977.06	1.14
7	600271	航天信息	26,081,454.77	1.02
8	601555	东吴证券	24,012,766.30	0.94
9	002273	水晶光电	21,547,443.48	0.84
10	300205	天喻信息	20,872,809.45	0.82
11	603993	洛阳钼业	20,791,568.76	0.81
12	300072	三聚环保	20,454,300.05	0.80
13	000728	国元证券	17,525,755.00	0.68
14	000958	东方能源	17,485,122.53	0.68
15	002348	高乐股份	17,254,790.79	0.67
16	000697	炼石有色	16,133,815.02	0.63
17	000002	万科A	15,796,810.00	0.62
18	600369	西南证券	15,631,079.00	0.61
19	600118	中国卫星	15,342,666.87	0.60
20	000625	长安汽车	15,179,970.00	0.59

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。

### 8.4.2 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	600271	航天信息	218,947,700.32	8.55
2	000651	格力电器	121,918,203.71	4.76
3	300113	顺网科技	113,584,759.05	4.44
4	601888	中国国旅	74,423,993.93	2.91



5	601318	中国平安	69,555,295.37	2.72
6	002081	金螳螂	66,765,051.25	2.61
7	300144	宋城演艺	57,724,437.98	2.26
8	601929	吉视传媒	38,199,835.89	1.49
9	601211	国泰君安	36,906,524.01	1.44
10	600028	中国石化	28,936,602.84	1.13
11	002734	利民股份	27,688,456.92	1.08
12	601689	拓普集团	21,560,766.56	0.84
13	000963	华东医药	20,894,104.18	0.82
14	300205	天喻信息	19,563,470.66	0.76
15	603993	洛阳钼业	18,755,163.30	0.73
16	300072	三聚环保	17,618,583.83	0.69
17	000002	万科A	15,971,538.33	0.62
18	000958	东方能源	14,649,032.40	0.57
19	300008	上海佳豪	14,263,414.76	0.56
20	000625	长安汽车	14,208,471.27	0.56

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。

### 8.4.3 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	1,062,252,172.72
卖出股票收入（成交）总额	1,381,573,950.83

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

### 8.5 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	301,296,537.40	9.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	511,885,000.00	15.54
	其中：政策性金融债	511,885,000.00	15.54
4	企业债券	785,529,413.84	23.84
5	企业短期融资券	170,360,000.00	5.17
6	中期票据	175,156,000.00	5.32
7	可转债	115,530,453.61	3.51
8	同业存单	-	-

9	其他	1,123,970.00	0.03
10	合计	2,060,881,374.85	62.55

## 8.6 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	122399	15 中投 G1	1,481,210	148,876,417.10	4.52
2	150314	15 进出 14	1,200,000	125,940,000.00	3.82
3	113008	电气转债	750,000	103,252,500.00	3.13
4	100303	10 进出 03	1,000,000	101,460,000.00	3.08
5	122384	15 中信 01	900,000	93,447,000.00	2.84

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	159,129.77
2	应收证券清算款	211,978,805.52
3	应收股利	-
4	应收利息	30,914,294.62
5	应收申购款	260,025.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	243,312,255.88

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	103,252,500.00	3.13
2	128009	歌尔转债	11,695,953.61	0.35

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
16,134	197,753.75	315,700,186.49	9.89%	2,874,858,831.57	90.11%

### 9.2 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	108,820.08	0.0034%

### 9.3 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

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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年7月30日）基金份额总额	2,800,983,932.91
本报告期期初基金份额总额	2,434,805,648.33
本报告期基金总申购份额	2,406,284,953.09
减：本报告期基金总赎回份额	2,316,137,200.42

本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	665,605,617.06
本报告期期末基金份额总额	3,190,559,018.06

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。自 2016 年 2 月 1 日起，卢盛春先生担任公司副总经理。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币捌万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
长城证券	1	808,062,308.76	35.08%	739,204.18	34.99%	-
华泰证券	1	437,020,135.49	18.97%	398,307.68	18.85%	-
安信证券	2	372,990,998.60	16.19%	343,710.75	16.27%	-
申万宏源	1	232,173,621.27	10.08%	216,223.78	10.23%	-
光大证券	1	227,102,177.82	9.86%	206,752.18	9.79%	-
海通证券	2	226,039,732.65	9.81%	208,668.44	9.88%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内共新增 7 个交易单元（海通证券 2 个交易单元、安信证券 2 个交易单元、方正证券 2 个交易单元、申万宏源 1 个交易单元），减少银河证券 1 个交易单元，截止本报告期末共计 11 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。

### 11.7.2 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
长城证券	155,678,243.82	4.03%	1,520,109,000.00	4.67%	-	-
华泰证券	2,385,096,771.63	61.72%	21,889,000,000.00	67.21%	-	-
安信证券	335,657,740.57	8.69%	2,580,510,000.00	7.92%	-	-
申万宏源	26,243,351.12	0.68%	35,000,000.00	0.11%	-	-
光大证券	695,048,184.39	17.99%	589,800,000.00	1.81%	-	-
海通证券	266,442,623.01	6.90%	5,955,397,000.00	18.29%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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
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
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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2015 年 1 月 23 日

	的公告	基金管理人网站	
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 27 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 2 月 7 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 12 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 3 月 6 日
10	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
11	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
12	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
13	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



14	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
15	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
16	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
17	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
18	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 26 日
19	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
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 8 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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 4 月 11 日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
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 23 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 28 日
24	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
25	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
26	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
27	长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的相关规则公告	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 5 月 13 日
28	关于修改长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同的公告	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 5 月 13 日
29	长城久鑫保本混合型证券投资基金	本基金管理人网站	2015 年 5 月 13 日

	金基金合同		
30	长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的第一次提示性公告	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 5 月 15 日
31	关于增加农业银行为长城久鑫保本混合型基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	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 5 月 18 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 19 日
33	长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的第二次提示性公告	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 5 月 19 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 5 月 20 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 5 月 22 日
36	长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的第三次提示性公告	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 5 月 22 日
37	长城久鑫保本混合型证券投资基金保本周期提前到期及转入下一保本周期的第四次提示性公告	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 5 月 25 日
38	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 5 月 26 日

	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
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 5 月 28 日
40	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
41	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
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 3 日
43	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
44	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
45	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、证	2015 年 6 月 13 日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
46	长城久鑫保本混合型证券投资基金转入下一保本周期过渡期折算结果的公告	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16日
47	长城久鑫保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	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16日
48	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
49	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
50	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27日
51	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展的网上银行、手机银行申购手续费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30日
52	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
53	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、证	2015年7月1日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
54	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7月3日
55	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7月4日
56	长城基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	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7月6日
57	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7月7日
58	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7月8日
59	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7月9日
60	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7月10日

		理人网站	
61	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7月11日
62	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7月14日
63	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7月15日
64	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与平安证券开展的基金申购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7月17日
65	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7月18日
66	长城基金关于增加中信期货为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	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7月24日
67	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7月28日

68	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 7 月 29 日
69	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与浦发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 8 月 3 日
70	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 8 月 4 日
71	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 8 月 5 日
72	长城基金管理有限公司关于参加数米基金网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 8 月 7 日
73	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 8 月 8 日
74	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中金公司开展的基金申购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 8 月 19 日
75	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 8 月 19 日



	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
76	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 8 月 22 日
77	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 8 月 25 日
78	长城基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	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 8 月 25 日
79	长城基金关于增加宁波银行为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	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 8 月 26 日
80	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 8 月 26 日
81	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 8 月 27 日
82	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、证	2015 年 8 月 29 日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
83	关于长城基金管理有限公司旗下基金参与国都证券手机炒股基金申购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 8 月 31 日
84	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 9 月 2 日
85	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 9 月 7 日
86	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 9 月 10 日
87	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 9 月 16 日
88	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 9 月 26 日
89	长城基金管理有限公司关于参加好买基金公司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 9 月 28 日

		理人网站	
90	长城基金管理有限公司关于参加华宝证券有限责任公司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 9 月 30 日
91	长城基金关于调整旗下基金申购金额起点的公告	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 10 月 12 日
92	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 10 月 13 日
93	长城基金管理有限公司关于变更长城久鑫保本混合型证券投资基金基金经理的公告	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 10 月 16 日
94	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 10 月 17 日
95	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 10 月 21 日
96	长城基金关于增加申万宏源西部证券为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务的公告	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 10 月 22 日
97	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 11 月 5 日

	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
98	长城基金关于增加国金证券为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	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 11 月 6 日
99	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 11 月 7 日
100	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 11 月 11 日
101	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 11 月 12 日
102	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 11 月 25 日
103	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 11 月 28 日
104	关于增加联泰资产为长城旗下开放式基金代销机构并开通定投、	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 12 月 11 日

	转换业务及同时实行费率优惠的公告	券日报及本基金管理人网站	
105	长城基金管理有限公司关于增聘长城久鑫保本混合型证券投资基金基金经理的公告	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 12 月 16 日
106	长城基金管理有限公司关于参加深圳众禄金融控股股份有限公司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 12 月 17 日
107	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 12 月 18 日
108	关于增加盈米财富为长城旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及同时实行费率优惠的公告	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 12 月 28 日
109	长城基金管理有限公司关于指数熔断机制对旗下公募基金相关业务规则影响的公告	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 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金的第一个保本周期于 2015 年 5 月 19 日提前到期。第二个保本周期起始日为 2015 年 6 月 15 日，保本周期最长为 3 年，即第二个保本周期到期日不晚于 2018 年 6 月 15 日（如该日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日）。本基金第二个保本周期的目标收益率为 18%，在第二个保本周期内如本基金份额累计净值收益率连续 15 个工作日达到或超过该目标收益率，则本基金第二个保本周期将提前到期。第二个保本周期由中国投融资担保股份有限公司作为担保人，为基金管理人的保本义务提供连带责任保证。详见本基金管理人 2015 年 5 月 13

日及 2015 年 6 月 16 日发布的相关公告。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准长城久鑫保本混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久鑫保本混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 13.3 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

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)