

# 长城久鑫保本混合型证券投资基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 08 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	2,778,173,452.08 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：2016 年 7 月 1 日前长城基金管理有限公司的法定代表人为杨光裕，自 2016 年 7 月 1 日起法

定代表人变更为何伟。

## 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	基金管理人及基金托管人住所

## § 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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-40,515,622.77
本期利润	-78,699,314.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0263
本期基金份额净值增长率	-2.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1888
期末基金资产净值	2,802,572,222.72
期末基金份额净值	1.009

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

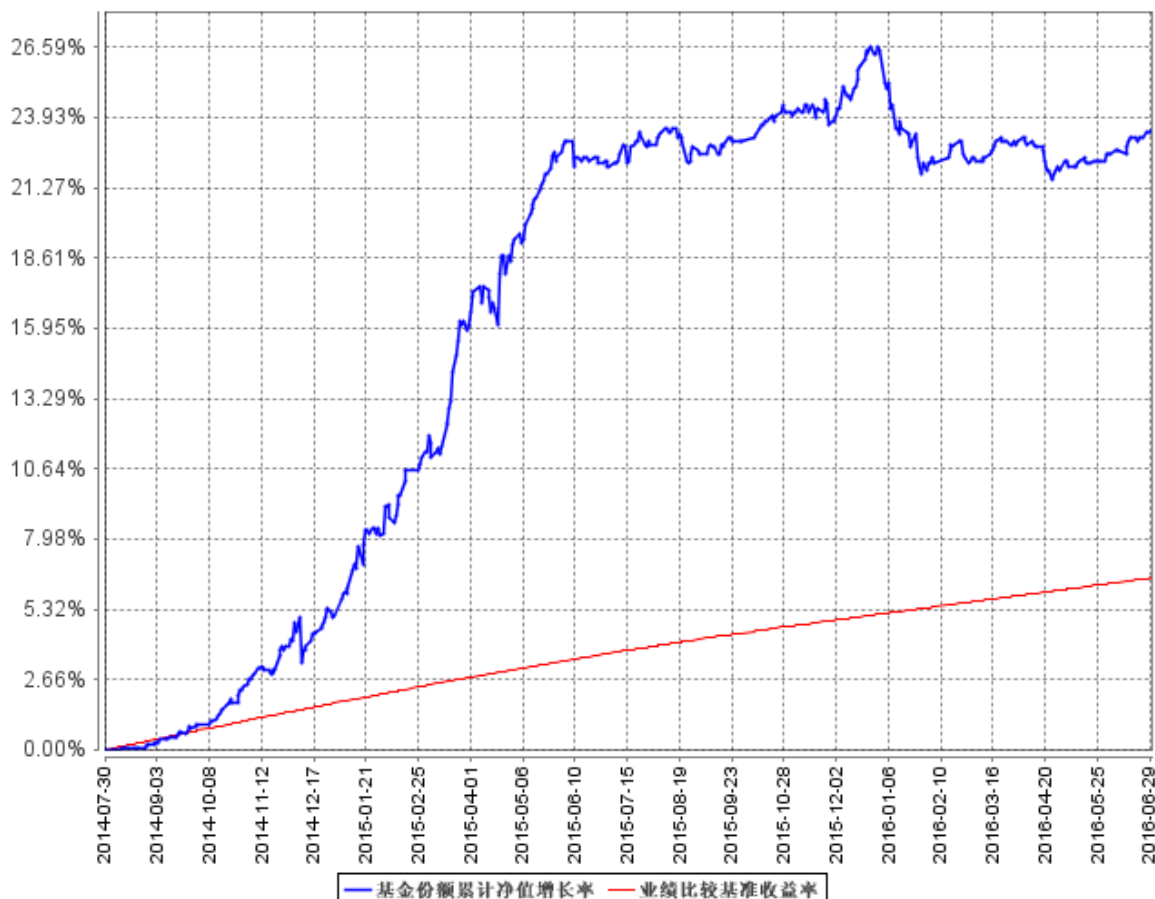
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.80%	0.09%	0.23%	0.01%	0.57%	0.08%
过去三个月	0.50%	0.12%	0.69%	0.01%	-0.19%	0.11%
过去六个月	-2.32%	0.20%	1.37%	0.01%	-3.69%	0.19%
过去一年	1.00%	0.19%	2.87%	0.01%	-1.87%	0.18%
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	23.53%	0.25%	6.52%	0.01%	17.01%	0.24%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

### 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。

## § 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%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注

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、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本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	长城岁岁金理财债券基金、长城淘金基金、长城久惠保本基金、长城新策略	2014 年 7 月 30 日	2016 年 5 月 20 日	9 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

	混合、长城久安保本、长城新优选混合、长城久润保本、长城久益保本的基金经理				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。
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、长城久润保本的基金经理	2015 年 10 月 15 日	-	8 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、长城新优选混合、长城久安保本、长城久润保本、长城久益保本的基金经理	2015 年 12 月 15 日	-	4 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、北京大学计算机专业系统结构专业硕士。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。
--	--	--	--	--	-------

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，经济仍处筑底格局。进出口、消费、固定资产投资继续底部徘徊，年初受到基建投资及地产带动产生短暂去库存效应，但持续性较差。从分项数据看，民间投资持续下滑需引起更大关注。金融数据方面，新增信贷及社会融资总额同比持续增长，资金存在脱实入虚迹象，金融领域加杠杆继续进行。通胀数据受年初食品价格大幅上涨影响小幅冲高后回落，工业品价格在供给侧改革作用下波动上行。外汇市场方面，人民币兑美元先升后贬，但资本外流大幅缓解。全球市场方面，英国公投结果退欧，南海仲裁案，土耳其政变等均加大国际市场避险情绪。债券市场



方面，违约主体范围扩大，信用风险一度引发债市悲观情绪蔓延。利率方面，收益率曲线先升后降，整体下行，但波动加大。信用利差分化，高评级继续下行，低评级有所上行。股票市场上半年经历了巨幅震荡，年初熔断机制推出后断崖式下跌，随后两月超跌反弹，之后又进入反复震荡盘整，波动周期缩短、振幅收窄，成交量明显萎缩。板块分化进一步加剧，食品饮料表现较好，而传媒、旅游、交运、计算机等行业跌幅较大。二季度分化更甚，主题炒作热情升温，OLED、稀土永磁、锂电池等概念指数涨幅均在 30%以上，新能源汽车、区块链、芯片国产化等主题涨幅也在 20%以上。

上半年本基金在安全资产方面继续保持中等久期，进一步优化组合债券的信用资质，积极参与新股及新发转债申购。在股票投资方面，年初本基金由于熔断净值出现了明显回撤，之后利用了 2 月初和 3 月中旬两次反弹机会积极做多。2 季度波段操作难度加大，我们在结合安全垫控制整体仓位的前提下，积极抓住了 OLED、稀土永磁、农业养殖、新能源汽车、军民融合等热点主题的投资机会，并从做绝对收益的思路出发及时兑现收益，实现了净值的平稳增长。

#### 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-2.32%，同期业绩比较基准为 1.37%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济将延续 L 型走势，并在稳增长与结构性改革间窄幅波动，难现趋势上行，通胀相对低位，基本面仍将是支撑债市的关键因素。但低评级信用债的到期高峰叠加新发行困难可能引发部分违约事件发生，并进而对债市带来情绪波动。基于此，债券市场后期投资将首先严防信用风险，同时，保持组合中性久期，并择机参与利率债波段机会。对于股票市场，我们略为乐观，我们认为在经历了前期大量悲观预期的消化后，市场有望出现一个反弹的时间窗口。一方面经济数据环比可能改善，另一方面临近北戴河会议、G20 峰会、人民币加入 SDR、深港通推出等关键时点，政策层面可能较为温和，不排除有新的刺激政策出台。在操作上我们依然采取紧密跟踪、伺机而动的做法，从基本面出发把握个股布局机会，在行业选择上我们重点看好三类投资机会，其一是基本面景气度向上或出现拐点的行业，如新能源汽车及汽车电子、农产品、养殖、白酒、轨道交通、油服等，其二是受益于政策引导的行业，如有色、券商、建筑、环保、煤炭、钢铁等，其三是带来经济新的增长动力的行业，如军民融合、半导体芯片、人工智能、化工新材料、智能制造等。

## 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**

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **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**

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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长城久鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		7,640,360.02	91,519,077.01
结算备付金		819,068.34	19,526,843.38
存出保证金		332,607.46	159,129.77
交易性金融资产		2,087,903,942.47	2,357,204,232.39
其中：股票投资		65,205,190.54	296,322,857.54
基金投资		-	-
债券投资		2,022,698,751.93	2,060,881,374.85
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		692,829,681.74	790,002,195.00
应收证券清算款		36,495,093.17	211,978,805.52
应收利息		26,720,000.07	30,914,294.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	260,025.97
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,852,740,753.27	3,501,564,603.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	200,000,000.00
应付证券清算款		38,002,352.16	-
应付赎回款		8,067,910.40	1,762,688.40
应付管理人报酬		2,791,608.49	3,364,168.90
应付托管费		465,268.05	560,694.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		450,879.11	723,362.79
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		390,512.34	213,533.88
负债合计		50,168,530.55	206,624,448.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		2,269,362,686.22	2,606,205,952.57
未分配利润		533,209,536.50	688,734,202.28
所有者权益合计		2,802,572,222.72	3,294,940,154.85
负债和所有者权益总计		2,852,740,753.27	3,501,564,603.66

注：报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.009 元，基金份额总额 2,778,173,452.08 份。

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-54,836,259.45	384,956,475.34
1.利息收入		48,936,038.37	48,540,718.44
其中：存款利息收入		390,701.58	2,036,359.91
债券利息收入		39,387,271.47	38,788,607.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,158,065.32	7,715,751.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-67,484,592.15	350,501,597.20
其中：股票投资收益		-72,382,970.34	311,327,493.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益		4,693,239.26	39,130,583.63
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		205,138.93	43,520.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-38,183,691.84	-19,734,304.43
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,895,986.17	5,648,464.13
<b>减：二、费用</b>		23,863,055.16	31,123,844.49

1. 管理人报酬		17,908,653.77	13,079,973.14
2. 托管费		2,984,775.60	2,179,995.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,517,182.03	2,343,068.33
5. 利息支出		1,210,957.60	13,253,642.33
其中：卖出回购金融资产支出		1,210,957.60	13,253,642.33
6. 其他费用		241,486.16	267,165.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-78,699,314.61	353,832,630.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-78,699,314.61	353,832,630.85

### 6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	2,606,205,952.57	688,734,202.28	3,294,940,154.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-78,699,314.61	-78,699,314.61
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）	-336,843,266.35	-76,825,351.17	-413,668,617.52
其中：1.基金申购款	9,222,602.88	2,248,415.59	11,471,018.47
2.基金赎回款	-346,065,869.23	-79,073,766.76	-425,139,635.99
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）	2,269,362,686.22	533,209,536.50	2,802,572,222.72
项目	上年度可比期间 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）	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（本期净利润）	-	353,832,630.85	353,832,630.85
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）	508,757,959.14	178,060,346.81	686,818,305.95
其中：1.基金申购款	2,327,223,330.03	492,181,889.82	2,819,405,219.85
2.基金赎回款	-1,818,465,370.89	-314,121,543.01	-2,132,586,913.90
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）	2,943,563,607.47	656,801,941.31	3,600,365,548.78

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：

何伟  
基金管理人负责人

熊科金  
主管会计工作负责人

彭洪波  
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。

#### 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、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。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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。

## 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。

### 6.4.7.2 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

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	154,862,913.08	16.51%	638,523,431.35	49.89%

##### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	34,002,217.60	6.06%	135,499,698.25	6.66%

##### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	21,291,000.00	0.25%	1,520,109,000.00	7.34%

##### 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 2016年1月1日至2016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	144, 223. 69	16. 51%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	581, 312. 39	49. 89%	558, 240. 96	63. 18%

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。

### 6.4.8.2 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17, 908, 653. 77	13, 079, 973. 14
其中：支付销售机构的客户维护费	8, 098, 533. 62	6, 540, 265. 29

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1. 2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1. 2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财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
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2, 984, 775. 60	2, 179, 995. 51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0. 2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0. 2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

### 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同期均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度可比期末均未持有本基金。

#### 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可比期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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
中国银行	7,640,360.02	290,729.50	721,017,341.36	1,848,892.31

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。

### 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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

## 6.4.9 期末（2016 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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-

			日							
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股未上市	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

### 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
002127	南极电商	2016年5月16日	重大事项停牌	9.63	-	-	151,402	1,327,186.47	1,458,001.26	-
002445	中南文化	2016年6月14日	重大事项停牌	24.65	-	-	10,000	204,888.25	246,500.00	-

### 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 2016 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 2016 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 2016 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 87,630,774.34 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,000,273,168.13 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。

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。

## § 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	65,205,190.54	2.29
	其中：股票	65,205,190.54	2.29
2	固定收益投资	2,022,698,751.93	70.90
	其中：债券	2,022,698,751.93	70.90
	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	692,829,681.74	24.29
	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	8,459,428.36	0.30
7	其他各项资产	63,547,700.70	2.23

8	合计	2,852,740,753.27	100.00
---	----	------------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,884,166.00	0.17
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,286,130.50	1.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.03
F	批发和零售业	18,711,000.00	0.67
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	70,492.40	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,458,001.26	0.05
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	65,205,190.54	2.33



### 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	600829	人民同泰	1,000,000	14,880,000.00	0.53
2	002450	康得新	449,787	7,691,357.70	0.27
3	300078	思创医惠	200,000	6,688,000.00	0.24
4	600482	中国动力	150,000	4,915,500.00	0.18
5	300313	天山生物	297,815	4,884,166.00	0.17
6	002179	中航光电	100,000	4,332,000.00	0.15
7	300367	东方网力	160,000	3,972,800.00	0.14
8	300065	海兰信	100,000	3,868,000.00	0.14
9	600891	秋林集团	300,000	3,831,000.00	0.14
10	600516	方大炭素	300,000	2,742,000.00	0.10

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](http://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	002224	三力士	24,932,648.01	0.76
2	000963	华东医药	17,619,624.42	0.53
3	600829	人民同泰	14,996,940.17	0.46
4	300250	初灵信息	13,721,432.20	0.42
5	300313	天山生物	13,438,301.96	0.41
6	300040	九洲电气	10,939,131.75	0.33
7	300198	纳川股份	10,879,407.65	0.33
8	600612	老凤祥	10,542,467.49	0.32
9	002127	南极电商	10,517,436.90	0.32
10	600482	中国动力	10,420,346.00	0.32
11	002643	万润股份	9,942,350.86	0.30

12	000541	佛山照明	9,769,459.00	0.30
13	002009	天奇股份	9,207,304.00	0.28
14	002513	*ST 蓝丰	8,429,529.10	0.26
15	603866	桃李面包	8,397,909.67	0.25
16	600891	秋林集团	8,387,879.34	0.25
17	600009	上海机场	8,364,442.10	0.25
18	002450	康得新	8,091,181.54	0.25
19	002509	天广消防	7,910,418.00	0.24
20	002087	新野纺织	7,722,113.61	0.23

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	600160	巨化股份	41,609,602.47	1.26
2	002224	三力士	27,458,458.33	0.83
3	000963	华东医药	17,448,433.80	0.53
4	002348	高乐股份	14,989,390.34	0.45
5	300250	初灵信息	13,750,935.40	0.42
6	601336	新华保险	13,507,762.40	0.41
7	300040	九洲电气	12,640,789.42	0.38
8	002643	万润股份	11,777,084.00	0.36
9	000728	国元证券	11,647,088.96	0.35
10	600369	西南证券	11,464,279.83	0.35
11	300198	纳川股份	11,096,851.00	0.34
12	600612	老凤祥	10,856,096.56	0.33
13	002127	南极电商	10,105,715.47	0.31
14	000541	佛山照明	9,706,941.86	0.29
15	601555	东吴证券	9,686,273.72	0.29
16	603866	桃李面包	8,862,282.00	0.27
17	002509	天广消防	8,826,807.00	0.27
18	002513	*ST 蓝丰	8,722,810.30	0.26
19	002009	天奇股份	8,407,383.72	0.26
20	002746	仙坛股份	8,159,422.70	0.25

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	395,106,157.88
卖出股票收入（成交）总额	544,500,080.53

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	227,523,904.50	8.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	995,291,000.00	35.51
	其中：政策性金融债	995,291,000.00	35.51
4	企业债券	531,165,954.63	18.95
5	企业短期融资券	120,334,000.00	4.29
6	中期票据	122,127,000.00	4.36
7	可转债（可交换债）	25,133,024.60	0.90
8	同业存单	-	-
9	其他	1,123,868.20	0.04
10	合计	2,022,698,751.93	72.17

注：“其他”为地方政府债。

## 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	160415	16 农发 15	3,000,000	301,560,000.00	10.76
2	160203	16 国开 03	2,000,000	197,360,000.00	7.04
3	122399	15 中投 G1	1,481,210	150,387,251.30	5.37
4	150221	15 国开 21	1,000,000	101,360,000.00	3.62
5	100303	10 进出 03	1,000,000	100,870,000.00	3.60

## 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，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

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	332,607.46
2	应收证券清算款	36,495,093.17
3	应收股利	-
4	应收利息	26,720,000.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,547,700.70

### 7.12.4 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	23,963,662.60	0.86

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末持有的前十名股票不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 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。

## § 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
14,544	191,018.53	248,737,158.52	8.95%	2,529,436,293.56	91.05%

### 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	108,820.08	0.0039%

### 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

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（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	3,190,559,018.06
本报告期基金总申购份额	11,289,426.55
减：本报告期基金总赎回份额	423,674,992.53
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	2,778,173,452.08

## § 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

①自 2016 年 2 月 1 日起，卢盛春先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

②由于工作调动，自 2016 年 7 月 1 日起，杨光裕先生不再担任长城基金管理有限公司董事长。

③自 2016 年 7 月 1 日起，何伟先生担任长城基金管理有限公司董事长。

#### 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，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无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、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	
平安证券	1	246,654,020.87	26.30%	229,708.98	26.30%	-
华西证券	1	233,524,095.33	24.90%	217,479.43	24.90%	-
长城证券	1	154,862,913.08	16.51%	144,223.69	16.51%	-
申万宏源	1	117,730,457.39	12.55%	109,642.62	12.55%	-
海通证券	2	95,398,686.10	10.17%	88,843.66	10.17%	-
方正证券	2	89,730,466.60	9.57%	83,565.92	9.57%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内共增加 6 个交易单元（东北证券 2 个，浙商证券 1 个，平安证券 1 个，华西证券 1 个，信达证券 1 个），截止本报告期末共计 17 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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (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
平安证券	65,503,041.82	11.67%	-	-	-	-
华西证券	114,728,095.46	20.44%	4,866,100,000.00	57.20%	-	-
长城证券	34,002,217.60	6.06%	21,291,000.00	0.25%	-	-
申万宏源	27,844,785.01	4.96%	40,000,000.00	0.47%	-	-
海通证券	116,115,076.47	20.68%	3,579,600,000.00	42.08%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	203,218,395.14	36.20%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-