

**长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金  
更新的招募说明书摘要  
(2016年第2号)**

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

二〇一六年十一月

长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金经2014年12月15日中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1361号文注册募集。基金合同于2015年4月8日生效。

## 重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年10月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日（财务数据未经审计）。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人情况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 4、法定代表人：何伟
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、成立日期：2001 年 12 月 27 日
- 7、电话：0755-23982338                      传真：0755-23982328
- 8、联系人：袁江天

9、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、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、长城久鼎保本混合型证券投资基金等三十八只基金。

- 10、客户服务电话：400-8868-666
- 11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币
- 12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券股份有限公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1. 董事、监事及高管人员介绍

#### （1）董事

何伟先生，董事长，硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。

熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。

杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生，董事，硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京

大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

万建华先生，独立董事，硕士。现任证通股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长)，中国银联股份有限公司总裁，上海国际集团总经理，国泰君安证券股份有限公司董事长。

徐英女士，独立董事，学士。现任新华资产管理股份有限公司副董事长。历任景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，北京财贸学院金融系助教、讲师。

鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。

## (2) 监事

吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师(非执业)。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券股份有限公司，任财务部总经理。

曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

张令先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书、综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海（广西）证券有限责任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

### （3）高级管理人员

何伟先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，副总经理兼市场开发部总经理、广州管理部总经理，学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理、公司总经理助理。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理。

卢盛春先生，副总经理兼机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长、监察稽核部总经理，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查

一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。

## 2. 本基金基金经理简历

乔春先生，中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士。具有6年证券从业经历。2010年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员，“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理助理。自2014年9月16日至今任“久嘉证券投资基金”基金经理，自2015年4月20日至今任本基金的基金经理。

长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金历任基金经理如下：蒋劲刚先生、吴文庆先生自2015年3月23日至2016年7月27日担任本基金的基金经理。

## 3. 本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。

杨建华先生，投资决策委员会执行委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。

钟光正先生，投资决策委员会委员，公司固定收益部总经理、基金经理。

吴文庆先生，投资决策委员会委员，公司研究部总经理、基金经理。

## 4. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

客服电话：95566

传真：(010) 66594942

### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕

士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### （三）证券投资基金托管情况

截至 2016 年 6 月 30 日，中国银行已托管 475 只证券投资基金，其中境内基金 444 只，QDII 基金 31 只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40-41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

#### 2. 代销机构

##### （1） 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

联系人：宋亚平

电话：010-66596688



传真：010-66594946

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(4) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：穆欣欣

电话：010-63636104

传真：010-68560661

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

(5) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

传真：021-50979375

网址：<http://bank.pingan.com/>

客户服务电话：95511-3

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：唐苑

传真：021-63604199

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

(7) 深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

办公地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

法定代表人：李伟

联系人：王璇

电话：0755-25188269

传真：0755-25188794

客服电话：4001961200

公司网站：[www.961200.net](http://www.961200.net)

(8) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(9) 泉州银行股份有限公司

注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

联系电话：0595-22551071

联系人：董培姗

客服电话：400-8896-312

公司网站：www.qzccb.com

(10) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

客服电话：95574

公司网站：www.nbcb.cn

(11) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：www.csc108.com

(12) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

联系人：程丽辉

电话：021-23219991

传真：021-23219100

客户服务电话：95553、4008888001

网站：www.htsec.com

(13) 长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：www.cgws.com

(14) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田薇

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

（15）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565

网站：www.newone.com.cn

（16）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168

网站：www.pingan.com

（17）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33388215

传真：021-33388224

客服电话：95523/4008895523/4008000562

网址：www.swhysc.com

（18）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

网站：www.bhzq.com

（19）中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：戴蕾

电话：0791-86868681

传真：0791-86770178

客服电话：400-8866-567

网站：www.avicsec.com

（20）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人：邱三发

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

网站：www.gzs.com.cn

（21）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜味军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：www.csc.com.cn

（22）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

（23）中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

（24）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：郑向溢

电话：0755-82558038

传真：0755-82558355

公司网址：www.essence.com.cn

客服热线：4008001001

（25）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(26) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：029-87406649

客服热线：029-87419999

网址：[www.westsecu.com.cn](http://www.westsecu.com.cn)

(27) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999 或 95579

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(28) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：021-68778790

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(29) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客户服务电话：95548

网站：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(30) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

（31）大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市长治路111号世贸中心A座13层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

（32）东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

（33）信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

（34）西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141



客服电话：4008096096

公司网站：www.swsc.com.cn

(35) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87557985

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

(36) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：4008888666

网址：www.gtja.com

(37) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座 3 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-58315221

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118

公司网站：www.hrsec.com.cn

(38) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008、95532

网址：www.china-invs.cn

（39）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法人代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（40）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人：张慎修

联系人：张曼

电话：010-52723273

传真：0755-83025991

客户服务电话：4008-888-818

网址：www.hx168.com.cn

（41）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李学东

电话：010-85679888

传真：010-85679535

联系人：秦朗

客服电话：400-910-1166

网站：www.cicc.com.cn

（42）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张磊

联系人：洪成

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网站：www.citicsf.com

（43）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005

室

法定代表人：李季

联系人：李巍

传真：010-88085195

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（44）国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街95号

办公地址：四川省成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客户服务电话：95310

网址：www.gjqz.com.cn

（45）深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（46）杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

联系人：朱晓超

联系电话：021-60897840

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(47) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

联系电话：021-38509636

客服电话：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

(48) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

联系电话：020-87599121

客服电话：400-1818-188

公司网站：www.1234567.com.cn

(49) 众升财富(北京)基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：李招弟

联系人：付少帅

联系电话：010-59497361

传真：010-64788105

客服电话：400-808-0069

公司网站：www.wy-fund.com

(50) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

联系电话：010-62020088

客服电话：400-888-6661

公司网站: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(51) 北京增财基金销售有限公司

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 王昌庆

联系人: 张蕾

联系电话: 010-67000988

客服电话: 400-001-8811

公司网站: [www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(52) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

联系人: 吴阿婷

联系电话: 0755-82721106

客服电话: 400-9200-022

公司网站: [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(53) 上海好买基金销售有限公司

住所: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 胡轶隽

联系电话: 021-20613635

客服电话: 400-700-9665

公司网站: [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(54) 上海联泰资产管理有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人: 燕斌

联系人: 凌秋艳

联系电话: 021-52822063-8105

客服电话: 4000-466-788

公司网站: [www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(55) 珠海盈米财富管理有限公司

住所: 珠海市横琴新区宝华路 6 号

法定代表人: 肖雯

联系电话: 020-89629099

传真: 020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

(56) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：4008219031

公司网站：www.lufunds.com

(57) 上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

客服电话：4006767523

网址：www.zzwealth.cn

(58) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：盛大

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(59) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期 418 室

法定代表人：齐小贺

联系人：陈勇军

电话：0755-83999913

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

(60) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

办公地址：深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

法定代表人：何昆鹏

联系人：张烨

电话：0755-84034499

传真：0755-84034477

客服电话：400-9500-888

网址：www.jfzinv.com

(61) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：陈超

客服电话：400-0988-511/ 400-0888-816

公司网站：kenterui.jd.com

(62) 北京汇成基金销售有限公司

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

公司网站：www.fundzone.cn

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 基金注册登记机构

名称：长城基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人：何伟

成立时间：2001 年 12 月 27 日

电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

联系人：张真珍

客户服务电话：400-8868-666

(三) 律师事务所与经办律师

律师事务所名称：北京市中伦律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 36-37 层

负责人：张学兵

电话：0755-33256666

传真：0755-33206888

联系人：李雅婷

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所（办公地址）：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人：Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

#### 四、基金的名称

本基金名称：长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

基金类型：混合型

基金运作方式：契约型开放式。

#### 六、基金的投资目标

本基金重点投资于环保主题类相关的上市公司，通过定量定性相结合的积极策略，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等）、权证、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。



本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资于环保主题类公司债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以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。

## 八、基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金为灵活配置混合型证券投资基金，将采用“自上而下”的策略进行大类资产配置。本基金主要综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，并结合市场流动性水平、市场波动水平、未来利率变动趋势、以及债券的供求等因素的判断，分析股票市场、债券市场、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，控制系统性风险。

### 2、股票投资策略

#### (1) 环保主题的界定

随着工业及社会的发展，生态文明建设已经成为新时期的主要任务之一。本基金将主要挖掘生态文明发展中的各种环保主题投资机会。

传统意义上，狭义的环保，是指我们日常所见到的废水废气废物的处理。从实现生态文明社会的目标来看，这个只是环境问题的最显性的冰山一角，要真正实现生态文明社会，环保主题应有更大的外延。

环保的本质是一种更科学化的工农业生产和生活方式，其最终实现，首先离不开整个产业链上的企业，包括前中后端企业的共同努力，同时，也依托于其他行业中为环境保护献计献策、履行责任、或向环保产业转型的公司的努力。

本基金定义的环保主题包括两种类型的公司：

第一，环保产业链的前端、中端、后端涉及的公司。

前端，是指从产业源头上采取措施有利于保护自然资源，防止环境污染，改善生态环境的行业，包括但不限于为清洁能源及可再生能源等新能源的开发及使用、高效率能源的生产、转换、传输及存储等服务、新材料研发及使用、生态农业、智能交通、节能减排、淘汰落后产能等提供生产设备、技术、特殊材料、服务、建筑及安装等公司；中端，是指通过加强工业过程中副产品的合理再利用，提高资源使用效率来减少污染物排放的行业，

包括但不限于废物再利用、垃圾发电、餐厨利用、循环经济等相关产业链的上下游公司。后端，即狭义的“环保”概念，是指环境监测及污染物排放后的末端治理行业，如为空气污染控制、废水管理、固体废弃物管理、消除噪声、土壤改造、环境承包与工程、环境监测、分析服务、数据收集、分析和评价等活动提供生产设备、特殊材料、建筑安装以及服务的公司等。

第二，对环保产业发展及生态建设做出积极贡献、履行环保责任或致力于向环保转型的公司，包括但不限于碳交易等。

未来随着经济增长及产业转型的进一步发展，环保主题的外延将不断扩大，本基金将根据实际情况对环保主题的界定方法进行调整。

## （2）个股投资策略

本基金将依据环保主题类股票的定义确定备选股票池，并依据定性分析和定量分析相结合的方法，进行综合评估筛选，构建本基金的各级股票池。

### 1) 定性分析

A. 对于环保产业链的前中后端股票，其核心竞争力在于科技创新能力的持续领先。本基金将重点考察企业的可持续研发能力，并结合其公司治理、生命周期、商业模式、管理能力、行业竞争格局等方面来综合评估，据此判断企业在行业内的竞争优势，并判断其投资价值。在此基础上，重点关注具备全产业链服务能力，具备外延式扩张空间，市场开拓能力突出的企业。

**科技创新能力：**科研投入是科技创新能力的保障。本基金将重点关注企业在科研投入方面的长远规划，研发投入，技术引进，人员引进等方面，以判断其科技创新能力是否有效可持续。

**公司治理：**公司是否建立了合理高效的治理结构，是否制定了前瞻性的发展战略。

**商业模式：**根据企业及行业特点分析上下游关系、企业核心竞争优势、以及业务结构等方面；

**管理能力：**主要考察企业的经营独立性，管理层对股东的责任感，管理层长效约束与激励机制的建立，管理层的长远眼光及战略能力等定性指标。

B. 对于环保产业发展及生态建设做出积极贡献、履行环保责任或致力于向环保转型的公司，本基金将重点关注但不限于以下因素：公司产品或服务对于环保的贡献，公司环保政策，公司在环保公益方面的投入，公司具有向环保产业转型的研究和准备，公司积极参与碳交易业务，公司投资于环保主题类行业等。

## 2) 定量分析

在定量分析中，本基金将结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。环保主题类股票因其高成长性一般估值较高，因此，本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的成长性。在考察其科技创新能力可持续性方面，将重点关注研发费用与营业收入的占比，及获得财政补贴的情况。而在业务结构分布上，通过其收入的地区占比及业务占比，并结合对于不同地区不同业务的发展空间研判，来综合评估。

本基金将通过对行业估值指标的横向、纵向分析，并结合成长性的行业比较，并结合其他量化指标，综合选择估值与成长位于合理区间的环保主题类企业进行投资，动态构建资产组合。

同时，本基金在进行股票资产配置时，将考察企业的流动性和换手率指标，参考基金的流动性需求，以降低股票资产的流动性风险。

## 3、债券投资策略

当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益，以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。

## 4、中小企业私募债券投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的 10%。未来法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

在中小企业私募债选择时，本基金将采用公司内部债券信用评级系统对信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。在此基础上，本基金重点关注中小企业私募债的发行要素、担保机构等发行信息对债项进行增信。

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

## 5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。

## 6、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、标的资产的构成、质量及提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $50\% \times$ 中证环保产业指数收益率 $+50\% \times$ 中债综合财富指数收益率。

本基金是灵活配置混合型基金，主要投资于环保主题类公司证券。中证环保产业指数对环保主题类行业股票具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。本基金固定收益部分的业绩比较基准采用了中债综合财富指数。该指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护，综合反映了债券市场整体价格和回报情况，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。

本基金是灵活配置混合型证券投资基金，股票投资范围为0-95%。本基金对中证环保产业指数和中债综合财富指数分别赋予50%和50%的权重符合本基金的投资特性。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。本基金由于上述原因变更业绩比较基准，不需召开基金持有人大会通过。

## 十、基金的风险收益特征

本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。

## 十一、投资组合报告

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年10月19日复核了本基金招募说明书更新中的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。

本投资组合报告所载数据截至2016年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,262,757,746.31	68.07
	其中:股票	1,262,757,746.31	68.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	95,412,500.00	5.14
	其中:债券	95,412,500.00	5.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	2.70
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	67,856,736.58	3.66
8	其他资产	379,171,797.80	20.44
9	合计	1,855,198,780.69	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,840,000.00	1.02
B	采矿业	29,736,024.78	1.62
C	制造业	836,203,358.72	45.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,295,000.00	3.82
E	建筑业	775,274.28	0.04
F	批发和零售业	24,380,390.08	1.33
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	202,640,039.25	11.01
J	金融业	23,475,760.59	1.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,371,943.74	0.89
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	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,091,828.77	1.09
R	文化、体育和娱乐业	19,928,000.00	1.08
S	综合	-	-
	合计	1,262,757,746.31	68.63

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000625	长安汽车	5,000,044	68,350,601.48	3.71
2	300182	捷成股份	3,350,091	57,320,057.01	3.12
3	300271	华宇软件	2,600,097	49,193,835.24	2.67
4	300072	三聚环保	1,600,079	44,226,183.56	2.40
5	300156	神雾环保	2,000,013	41,160,267.54	2.24
6	300196	长海股份	900,057	35,255,232.69	1.92
7	300068	南都电源	1,600,038	34,976,830.68	1.90
8	002179	中航光电	800,007	34,656,303.24	1.88
9	002196	方正电机	1,000,035	34,191,196.65	1.86
10	601199	江南水务	4,250,000	33,065,000.00	1.80

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	94,953,500.00	5.16
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	459,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	95,412,500.00	5.19

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	160005	16 付息国 债 05	800,000	79,952,000.00	4.35
2	019515	15 国债 15	150,000	15,001,500.00	0.82
3	127003	海印转债	4,590	459,000.00	0.02
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6、报告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、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、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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

## 11、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3)

其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,153,875.96
2	应收证券清算款	375,939,914.80
3	应收股利	-
4	应收利息	1,063,326.25
5	应收申购款	14,680.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	379,171,797.80

(4) 报告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。

(5) 报告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不存在流通受限的情况。

(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。

## 十二、基金的业绩

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

(截至2016年6月30日)

时间段	净值增长率①	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



基金合同生效日 (2015年4月8日)至 2015年12月31日	-2.00%	1.08%	1.80%	1.58%	-3.80%	-0.50%
2016年1月1日至2016 年6月30日	-5.31%	1.87%	-8.27%	1.28%	2.96%	0.59%
基金合同生效日 (2015年4月8日)至 2016年6月30日	-7.20%	1.44%	-6.62%	1.46%	-0.58%	-0.02%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

### 十三、基金费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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。

###### (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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。

上述“1、基金费用的种类中第(3)－(7)项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

(二) 与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

(1) 申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)－300万元	1.0%
300万元(含)－500万元	0.5%
500万元以上(含)	每笔1000元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

(2) 特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.3%
100万元(含)－300万元	0.2%
300万元(含)－500万元	0.1%
500万元以上(含)	每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老产品。

如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)，对于500万元（含）以上的申购，净申购金额

= 申购金额 - 固定申购费金额

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份数 = 净申购金额 / T日基金份额净值

例：某投资者投资100,000元申购本基金，对应的申购费率为1.5%，若申购当日基金份额净值为1.050元，则其可得到的基金份额计算如下：

净申购金额 =  $100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17$ 元

申购费用 =  $100,000 - 98,522.17 = 1,477.83$ 元

申购份额 =  $98,522.17 / 1.050 = 93,830.64$ 份

## 2、赎回费用

本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减，费率如下：

持续持有期（天）	赎回费率
1—6	1.5%
7—29	0.75%
30—184	0.5%
185—365	0.25%
366 及以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30天(含)但少于92天的基金份额所收取的赎回费的75%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于92天(含)但少于185天的基金份额所收取的赎回费的50%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于185天(含)的份额所收取的赎回费的25%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额 = 赎回份数 × 赎回当日基金份额净值

赎回手续费 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回手续费

例：某投资者赎回其持有的本基金 50,000 份，持有期为 85 天，对应的赎回费率为 0.5%，若赎回当日基金份额净值为 1.150 元，则其得到的赎回金额计算如下：

赎回总金额 =  $50,000 \times 1.150 = 57,500$  元

赎回手续费 =  $57,500 \times 0.5\% = 287.50$  元

净赎回金额 =  $57,500 - 287.50 = 57,212.50$  元

## 3、转换费用

(1) 基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具

体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额-转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率-转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额-转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额-转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差

例：某投资者持有长城货币市场证券投资基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是1.250元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为0，申购补差费率为1.5%，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1=100,000 元

转出基金赎回费=0

转入总金额=100,000-0=100,000元

转入基金申购费补差=100,000-100,000/(1+1.5%)=1,477.83元

转入净金额=100,000-1,477.83=98,522.17元

转入份额=98,522.17/1.25=78,817.73份

基金转换费=0+1,477.83=1,477.83元

②如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率

基金转换费用=转出金额×转出基金赎回费率

例：某投资者持有本基金10万份基金份额，持有期为100天，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是1.250元，转出基金对应赎回费率为0.5%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：

转出金额=100,000×1.25=125,000元

转出基金赎回费=125,000×0.5%=625元

转入总金额=125,000-625=124,375元

转入基金申购费补差=0

转入净金额=124,375-0=124,375元

转入份额=124,375/1=124,375份

基金转换费=125,000×0.5%=625元

(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金),以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用;如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时,申购补差费用视为0。

(3)转出基金赎回费的25%计入转出基金资产(基金合同或招募说明书另有规定的除外)。

(4)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行,对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种指定媒体公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
- 3、《基金合同》生效前的相关费用;
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的要求,并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动,对2016年5月20日刊登的本基金的招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

- 1、在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
- 2、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况。
- 3、在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。
- 4、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构信息。
- 5、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金转换和定期定额投资的内容。
- 6、在第八部分“基金的投资管理”中，更新了投资组合报告内容，披露截至 2016 年 6 月 30 日的的数据。
- 7、在第九部分“基金的业绩”数据中，披露了截至 2016 年 6 月 30 日本基金的业绩数据。
- 8、在第二十一部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司

2016 年 11 月 18 日