长城久利保本混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年03月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长城久利保本
基金主代码	000030
交易代码	000030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月18日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	552,335,776.27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	本基金采用固定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance)和时间不变性投资组合保险策略(Time Invariant Portfolio Protection),建立和运用严格的动态资产数量模型,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,以保证基金资产在三年保本周期末本金安全,并力争实现基金资产的保值增值。
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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

2.4信息披露方式

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	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

§3 主要财务指标、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	2014年	2013年4月18日(基金合同生效日)-2013年12月31日	2012年
本期已实现收益	214,356,304.66	6,602,170.71	-
本期利润	258,493,574.85	-13,640,889.00	-
加权平均基金份额本期利润	0.4651	-0.0155	-
本期基金份额净值增长率	42.28%	-1.60%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.3997	-0.0165	-
期末基金资产净值	773,076,884.85	777,021,257.32	-
期末基金份额净值	1.400	0.984	-

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。

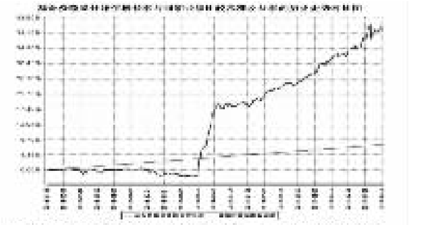
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

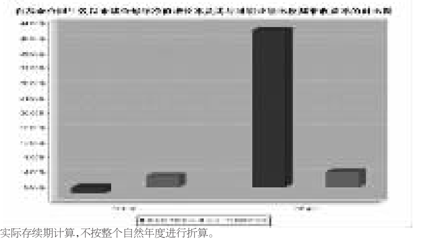
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.58%	0.54%	1.04%	0.01%	4.54%	0.53%
过去六个月	12.81%	0.41%	2.12%	0.01%	10.69%	0.40%
过去一年	42.28%	0.45%	4.22%	0.01%	38.06%	0.44%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	40.00%	0.36%	7.23%	0.01%	32.77%	0.35%

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



[illegible]

[illegible]



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2013年04月18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,由长城证券有限责任公司(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有限责任公司(47.059%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末,公司管理的基金有封闭式基金:久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板300指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金。

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、长城淘金基金、长城久利保本基金、长城久鑫保本混合基金和长城久盈纯债分级债券型基金的基金经理	2013年4月18日	-	7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。
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4月18日	-	7年	男,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"长城久利保本混合型证券投资基金"、"长城保本混合型证券投资基金"基金经理助理。
于雷	长城优化升级股票基金和长城中小盘股票基金的基金经理	2013年4月18日	2014年9月5日	7年	男,中国籍。中国人民大学财政金融学院经济学学士、硕士,香港大学金融学博士,特许金融分析师(CFA)。曾就职于华夏基金管理公司。2008年进入长城基金管理有限公司,曾任宏观、策略研究员、投资决策委员会秘书、"长城优化升级股票型证券投资基金"基金经理助理,"长城久利保本混合型证券投资基金"基金经理,"长城保本混合型证券投资基金"基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久利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

2014年,新常态下的经济增长和通胀稳步下行,全年GDP同比增长7.4%。转型带来经济阵痛,经济下行压力贯穿全年,增长动力不足,供需两端均较乏力。房地产投资经历了滑坡式下行,消费增速总体较上年有所下滑,但走势相对平稳。后危机时代,美强欧日弱格局浮现,各经济体结构矛盾仍存,出口受制于整体外需而表现疲弱。

2014年是全面深化改革的开局之年,各领域(依法治国、财税预算法、存款保险制度等)的顶层设计不断激发微观主体活力,利率市场化和人民币国际化不断推进。货币政策取向上,在稳增长和降低融资成本双重背景下,货币政策以定向性、结构性放松为特征,11月下旬央行宣布不对称降息。

债券市场经过2013的熊市,收益率调整到新高的位置,市场多头力量积聚。在经济基本面和政策面利好驱动下,2014年的债券市场迎来了波澜壮阔的牛市。全年来看,1季度资金面较为宽松,收益率缓慢下行;2季度两次定向降准使收益率大幅下行;3季度经济复苏乏力,央行下调正回购利率、5000亿SLF放水助推债市收益率进一步下行;4季度降息落实,股票牛市行情分流债券资金,在中证登质押回购新规等一系列事件负面影响下,债券收益率走势出现分化。

2014年,我们秉持"自下而上选择优质成长股为主,自上而下宏观判断为辅"的思路进行权益类投资。随着保本基金安全垫的逐步积累,结合对A股市场及个股投资机会的判断,我们在年内逐步加大了股票仓位。在此期间,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。我们保持了适中的久期,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,本基金净值增长率为42.28%,同期业绩比较基准为4.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年美国经济将延续温和扩张步伐,美元指数继续保持强势。欧元区和日本进行大规模量宽,但实际效果有限,经济疲态难改。国内经济在"三期叠加"的新常态下,一方面经济仍处于下行周期中,何时见底仍需观察;另一方面,全面改革和全面结构优化是2015年的主题,包括地方政府行为边界的划分和投融资机制的调整,制造业的转型升级和比较优势的重新打造,房地产市场的进一步市场化、走出去和引进来战略调整等变化。

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对冲,实体融资(地产、小微、三农)需要低利率货币金融环境的支持。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2015年,权益投资方面,2015年我们重点看好两类投资机会,一是快速成长、长期空间巨大的优质成长股,具体包括TMT、互联网、消费升级转型等行业。尽管在经历过去两年的成长股牛市后,此类个股经历了可观的涨幅,估值也不在低位,但在当下日新月异的技术进步、模式升级的浪潮中,企业确实有机会迎来基本面颠覆式的快速成长,对于其中的佼佼者,我们仍然看好其后续的表现。二是资金利率下行、经营效率提升带来的低估值蓝筹股,具体包括金融保险、建筑、汽车、公用事业等领域。2015年本保本基金将结合安全垫积累情况,适度调整股票仓位的弹性和灵活性,在回撤幅度可控范围内,力求为持有人实现稳健的投资收益。

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。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。2015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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握,对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素,从价值投资的角度进行理论分析,并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案,利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具,针对不同的估值方法及估值模型进行演算,为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查,对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验,具备专业胜任能力;基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格,精通基金估值政策、流程和标准,具有五年以上基金估值和会计核算工作经验;基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验,精通投资、研究理论知识和工具方法。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员,凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨,在估值方法的选择上力求客观、公允,在数据的采集方面力求公开、获取方便、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签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久利保本混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定,本基金的每份基金份额享有同等分配权;在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的10%;若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值。

截止本报告期末,本基金可供分配利润为220,741,108.58元,不进行收益分配。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:长城久利保本混合型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		5,907,263.67	38,531,762.62
结算备付金		5,827,579.79	16,621,587.52
存出保证金		291,107.60	76,204.35
交易性金融资产		710,710,823.12	1,344,541,269.20
其中:股票投资		152,329,586.22	15,015,218.08
基金投资		-	-
债券投资		558,381,236.90	1,329,526,051.12
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		200,000,500.00	-
应收证券清算款		11,999,983.30	53,233,724.96
应收利息		10,785,812.34	20,947,076.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,517,484.15	2,964.41
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		947,040,553.97	1,473,954,589.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		154,009,983.20	687,359,405.00
应付证券清算款		9,620,609.54	7,360,409.60
应付赎回款		8,083,121.13	840,147.55
应付管理人报酬		830,541.88	816,354.73
应付托管费		138,423.63	136,059.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		881,069.63	72,960.23
应交税费		94,932.32	93,530.40
应付利息		12,941.66	61,605.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		292,046.13	192,859.40
负债合计		173,963,669.12	696,933,331.89
所有者权益:			
实收基金		552,335,776.27	790,036,123.44
未分配利润		220,741,108.58	-13,014,866.12
所有者权益合计		773,076,884.85	777,021,257.32
负债和所有者权益总计		947,040,553.97	1,473,954,589.21

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.400元,基金份额总额552,335,776.27份。

7.2 利润表

会计主体:长城久利保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入		281,636,056.59	3,719,690.61
1.利息收入		36,651,344.50	31,648,176.10
其中:存款利息收入		390,729.07	232,227.22
债券利息收入		35,299,423.74	24,453,039.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		961,191.69	6,962,909.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		194,218,176.77	-8,478,714.45
其中:股票投资收益		170,583,153.19	-1,308,656.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益		23,101,408.05	-7,287,895.03
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		533,615.53	117,836.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		44,137,270.19	-20,243,059.71
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		6,629,265.13	793,288.67
减:二、费用		23,142,481.74	17,360,579.61
1. 管理人报酬		8,289,406.59	7,425,812.01
2. 托管费		1,381,567.63	1,237,635.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		2,834,547.99	351,494.91
5. 利息支出		10,196,461.89	8,064,916.05
其中:卖出回购金融资产支出		10,196,461.89	8,064,916.05
6. 其他费用		440,497.64	280,721.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		258,493,574.85	-13,640,889.00
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		258,493,574.85	-13,640,889.00

注:本基金基金合同于2013年4月18日生效,上年度可比期间系自2013年4月18日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久利保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1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)	790,036,123.44	-13,014,866.12	777,021,257.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	258,493,574.85	258,493,574.85
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)	-237,700,347.17	-24,737,600.15	-262,437,947.32
其中:1.基金申购款	883,979,658.80	216,264,221.35	1,100,243,880.15
2.基金赎回款	-1,121,680,005.97	-241,001,821.50	-1,362,681,827.47
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)	552,335,776.27	220,741,108.58	773,076,884.85
项目	上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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)	937,036,422.41	-	937,036,422.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,640,889.00	-13,640,889.00
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)	-147,000,298.97	626,022.88	-146,374,276.09
其中:1.基金申购款	3,283,679.53	-13,696.47	3,269,983.06
2.基金赎回款	-150,283,978.50	639,719.35	-149,644,259.15
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)	790,036,123.44	-13,014,866.12	777,021,257.32

注:本基金基金合同于2013年4月18日生效,上年度可比期间系自2013年4月18日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

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

长城久利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[2012]1706号文"关于核准长城久利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作为发起人于2013年3月18日至2013年4月16日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第60737541_H03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2013年4月18日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的实收基金(本金)为人民币936,525,267.72元,在募集期间有效认购资金产生的利息为人民币511,154.69元,以上实收基金(本息)合计为人民币937,036,422.41元,折合937,036,422.41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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

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)、银行存款等固定收益类资产;风险资产为股票、权证等权益类资产。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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定或修订了《企业会计准则第39号——公允价值计量》和《企业会计准则第30号——财务报表列报》等7项会计准则;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5

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。

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 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
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司("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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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	101,394,369.27	5.67%	121,181,402.57	56.87%
东方证券	405,193,051.76	22.66%	-	-

7.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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	48,741,330.32	1.84%	1,128,434,412.73	61.72%
东方证券	1,208,935,006.53	45.70%	63,093,576.63	3.45%

7.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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	845,019,000.00	4.12%	11,539,878,000.00	53.75%
东方证券	10,612,028,000.00	51.75%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1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	92,309.51	5.67%	-	-
东方证券	368,888.31	22.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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	110,324.05	56.87%	43,686.14	87.80%
东方证券	-	-	-	-

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,289,406.59	7,425,812.01
其中:支付销售机构的客户维护费	3,231,000.07	4,093,250.31

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%/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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,381,567.63	1,237,635.35

注: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0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%/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。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金,于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 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,本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年4月18日(基金合同生效日)至2013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
中国建设	5,907,263.67	202,448.33	38,531,762.62	114,232.59

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,并按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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证券。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
300386	飞天诚信	2014年6月20日	2015年6月26日	新股锁定	33.13	116.86	38,413	1,272,622.69	4,488,943.18	-
300406	九强生物	2014年10月27日	2015年10月30日	新股锁定	14.32	76.95	57,938	829,672.16	4,458,329.10	-

7.4.9.2 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
300144	宋城演艺	2014年12月19日	重大资产重组	27.38	2015年3月18日	33.13	729,902	19,544,634.08	19,984,716.76	-
002312	三泰控股	2014年12月3日	重大资产重组	23.89	2015年3月6日	26.28	100,000	2,694,257.00	2,389,000.00	-

注:根据相关法规的规定,经与托管行协商一致,自2014年12月31日起,本管理人对旗下基金所持宋城演艺(300144)按指数收益法进行估值。详见本管理人2015年1月5日公告。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014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154,009,983.20元,于2015年03月04日(先后)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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1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。

7.4.10.2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228,367,559.96元,划分为第二层次的余额为人民币482,343,263.16元,无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期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	152,329,586.22	16.08
	其中:股票	152,329,586.22	16.08
2	固定收益投资	558,381,236.90	58.96
	其中:债券	558,381,236.90	58.96
	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	200,000,500.00	21.12
	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	11,734,843.46	1.24
7	其他各项资产	24,594,387.39	2.60
8	合计	947,040,553.97	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,861,885.69	4.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,400,000.00	1.09
F	批发和零售业	13,414,971.29	1.74
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	12,774,143.18	1.65
J	金融业	36,133,669.30	4.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,760,200.00	3.46
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	19,984,716.76	2.59
S	综合	-	-
	合计	152,329,586.22	19.70

8.3 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	600271	航天信息	918,209	28,014,556.59	3.62
2	601888	中国国旅	600,000	26,640,000.00	3.45
3	300144	宋城演艺	729,902	19,984,716.76	2.59
4	601318	中国平安	263,510	19,686,832.10	2.55
5	000963	华东医药	254,989	13,414,971.29	1.74
6	002081	金螳螂	500,000	8,400,000.00	1.09
7	300226	上海钢联	100,000	6,037,000.00	0.78
8	600109	国金证券	300,000	5,937,000.00	0.77
9	601998	中信银行	699,980	5,697,837.20	0.74
10	600837	海通证券	200,000	4,812,000.00	0.62

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

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	600271	航天信息	55,102,100.97	7.09
2	601318	中国平安	50,114,881.66	6.45
3	002707	众信旅游	39,355,000.00	5.06
4	600674	川投能源	33,664,661.61	4.33
5	300226	上海钢联	32,846,344.05	4.23
6	002081	金螳螂	30,790,188.13	3.96
7	601888	中国国旅	28,032,896.50	3.61
8	300144	宋城演艺	24,247,883.53	3.12
9	000963	华东医药	21,617,956.86	2.78
10	601398	工商银行	20,833,126.31	2.68
11	600383	金地集团	20,191,204.60	2.60
12	600588	用友软件	19,975,652.80	2.57
13	002121	科陆电子	15,151,468.44	1.95
14	002470	金正大	14,473,063.23	1.86
15	600109	国金证券	14,189,675.85	1.83
16	300369	绿盟科技	13,409,501.00	1.73
17	601288	农业银行	13,250,000.00	1.71
18	002325	洪涛股份	12,799,722.71	1.65
19	002215	诺普信	12,732,660.49	1.64
20	300227	光韵达	12,337,059.78	1.59

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	002707	众信旅游	126,611,804.70	16.29
2	600674	川投能源	43,488,880.29	5.60
3	601318	中国平安	41,152,495.87	5.30
4	300226	上海钢联	33,572,566.53	4.32
5	300369	绿盟科技	31,974,417.15	4.11
6	600271	航天信息	29,497,388.70	3.80
7	002081	金螳螂	25,000,541.81	3.22
8	601398	工商银行	22,589,193.74	2.91
9	600588	用友软件	19,601,763.18	2.52
10	600383	金地集团	18,256,433.92	2.35
11	002121	科陆电子	16,098,016.94	2.07
12	601288	农业银行	14,893,749.94	1.92
13	002325	洪涛股份	14,780,714.81	1.90
14	601186	中国铁建	14,340,000.00	1.85
15	002470	金正大	13,981,024.80	1.80
16	300227	光韵达	13,064,579.17	1.68
17	002215	诺普信	12,941,615.91	1.67
18	000024	招商地产	12,792,154.96	1.65
19	600048	保利地产	12,678,599.69	1.63
20	600490	鹏欣资源	12,366,054.45	1.59

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	904,799,291.64
卖出股票收入(成交)总额	954,160,088.21

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	73,951,854.10	9.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	144,611,000.00	18.71
	其中:政策性金融债	144,611,000.00	18.71
4	企业债券	190,416,382.80	24.63
5	企业短期融资券	40,267,000.00	5.21
6	中期票据	109,135,000.00	14.12
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	558,381,236.90	72.23

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	130223	13国开23	500,000	49,710,000.00	6.43
2	1382188	13吉利MTN1	400,000	39,728,000.00	5.14
3	140427	14农发27	300,000	33,063,000.00	4.28
4	130422	13农发22	300,000	31,032,000.00	4.01
5	041459012	14南玻CP001	300,000	30,240,000.00	3.91

8.7 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。

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:本基金本报告期未进行股指期货投资,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

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

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

注: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

本基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	291,107.60
2	应收证券清算款	11,999,983.30
3	应收股利	-
4	应收利息	10,785,812.34
5	应收申购款	1,517,484.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,594,387.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300144	宋城演艺	19,984,716.76	2.59	重大事项停牌

注:根据相关法规的规定,经与托管行协商一致,自2014年12月31日起,本管理人对旗下基金所持宋城演艺(300144)按指数收益法进行估值。详见本管理人2015年1月5日公告。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
15,308	36,081.51	10,116,187.97	1.83%	542,219,588.30	98.17%

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	3,916.52	0.0007%

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

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年4月18日)基金份额总额	937,036,422.41
本报告期期初基金份额总额	790,036,123.44
本报告期基金总申购份额	883,979,658.80
减:本报告期基金总赎回份额	1,121,680,005.97
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	552,335,776.27

§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

自2014年3月24日起,余骏先生不再担任公司副总经理,并全职担任长城基金管理有限公司子公司长城嘉信资产管理有限公司总经理职务;自2014年4月17日起,杨建华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

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人2014年11月03日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

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陆万元。

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	
国信证券	2	1,229,374,969.69	68.75%	1,119,225.04	68.75%	-
东方证券	2	405,193,051.76	22.66%	368,888.31	22.66%	-
长城证券	3	101,394,369.27	5.67%	92,309.51	5.67%	-
西部证券	2	52,116,358.73	2.91%	47,446.75	2.91%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注:1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

报告期内共新增5个专用交易单元(联讯证券新增2个交易单元、宏信证券新增1个交易单元、广州证券新增2个交易单元),截止本报告期末共计42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
国信证券	1,352,236,956.37	51.11%	3,286,361,000.00	16.03%	-	-
东方证券	1,208,935,006.53	45.70%	10,612,028,000.00	51.75%	-	-
长城证券	48,741,330.32	1.84%	845,019,000.00	4.12%	-	-
西部证券	35,682,411.63	1.35%	5,763,152,000.00	28.10%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-