长城久鑫保本混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

§1 重要提示

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	3,603,589,470.72份
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;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。
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。
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
基金保证人	中国投融资担保有限公司

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有限公司。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	262,586,592.90
2.本期利润	108,492,853.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0485
4.期末基金资产净值	3,600,365,548.78
5.期末基金份额净值	0.999

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。

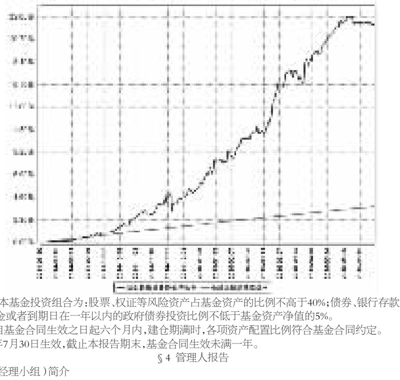
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	5.34%	0.33%	0.90%	0.01%	4.44%	0.32%

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



注:①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%。

②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本基金合同于2014年7月30日生效,截止本报告期末,基金合同生效未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、长城久鑫保本基金和长城久盈纯债分级债券型基金的基金经理	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。
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	-	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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来,国内经济复苏乏力。二季度消费增长速度继续放缓:一方面公款消费大幅下滑,另一方面居民收入增速降低。海外旅游和消费需求持续扩大,导致服务项下的贸易逆差持续扩大,抵消了货物贸易顺差带来的贡献。二季度房地产销售面积和住宅价格环比均有所上升,但二三线城市库存去化压力不容乐观,导致地产价格和销售回暖向投资端传导并不顺畅。今年以来基建成为托底经济的重要砝码,但受到融资和财政收入的双重缺口的限制,增速弱于往年。二季度CPI保持低位,PPI继续通缩,猪肉价格上涨有加速迹象,但整体拉动作用有限。

面对更大的稳增长压力,二季度货币政策和财政政策更加积极。4月央行大幅降准,流动性相对宽裕,5月降息继续释放货币政策宽松信号,6月末央行"双降"稳定资本市场。

二季度,整个债券市场先扬后抑:4月初国务院常务会议决定社保基金可投资地方债,地方债冲击的担忧有所缓解,叠加3月经济数据低迷,降息降准预期强化,长端收益率一度下行接近50BP;降准降息先后兑现,流动性确定极度宽松,短端收益率大幅下行;5月地方债开始大量发行,挤占其他利率债投资额度,中长端收益率开始上行。收益率曲线整体进一步陡峭化,期限利差显著高于历史均值。

二季度,股票市场前期在创业板和中小板上涨带动下突破5000点,但是受到市场降杠杆等因素影响,市场在6月下旬开始大幅调整,部分中小板股票跌幅几近腰斩。我们在本季度初期以较高仓位运作,5-6月份逐步将仓位降至较低水平,达到目标收益18%后,我们轻仓操作,保持净值基本稳定。积极参与新股申购,合理安排新股申购周期和申购品种;保持组合久期相对稳定,积极参与新债申购,合理把握债券波段操作机会,通过投资品种的合理配置和灵活调整,获得了较好的收益。

展望三季度,我们继续看好改革转型的前景,将积极寻找优质的个股投资机会,力求为持有人获取稳健良好的投资回报,同时,积极把握债券、新股等低风险收益机会,稳步提高组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率5.34%,本基金业绩比较基准收益率为0.90%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	46,105,687.88	1.27
	其中:股票	46,105,687.88	1.27
2	固定收益投资	1,404,368,514.78	38.60
	其中:债券	1,404,368,514.78	38.60
	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	1,440,004,280.00	39.58
	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	726,888,349.68	19.98
7	其他资产	20,482,925.89	0.56
8	合计	3,637,849,758.23	100.00

5.2 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	-	-
B	采矿业	1,635,059.25	0.05
C	制造业	11,846,886.41	0.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,560,970.30	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	225,347.22	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,881,685.60	0.44
L	租赁和商务服务业	6,955,739.10	0.19
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,105,687.88	1.28

5.3 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	000002	万 科A	1,093,780	15,881,685.60	0.44
2	000958	东方能源	309,918	9,560,970.30	0.27
3	601888	中国国旅	100,000	6,630,000.00	0.18
4	300406	九强生物	115,876	5,425,314.32	0.15
5	600271	航天信息	50,000	3,235,500.00	0.09
6	300473	德尔股份	28,645	1,901,455.10	0.05
7	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.05
8	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.03
9	603117	万林股份	34,690	325,739.10	0.01
10	603223	恒通股份	18,826	225,347.22	0.01

5.4 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	128,893,221.00	3.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	390,119,000.00	10.84
	其中:政策性金融债	390,119,000.00	10.84
4	企业债券	488,731,080.58	13.57
5	企业短期融资券	322,092,000.00	8.95
6	中期票据	40,158,000.00	1.12
7	可转债	33,258,715.60	0.92
8	其他	1,116,497.60	0.03
9	合计	1,404,368,514.78	39.01

5.5 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	041460065	14苏国信CP001	1,000,000	100,990,000.00	2.80
2	100303	10进出03	1,000,000	99,950,000.00	2.78
3	150311	15进出11	1,000,000	99,870,000.00	2.77
4	122384	15中信01	900,000	90,000,000.00	2.50
5	041456034	14滨建投CP003	700,000	70,707,000.00	1.96

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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	996,371.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,029,573.88
5	应收申购款	456,980.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,482,925.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113007	吉视转债	22,800,715.60	0.63
2	113501	洛钼转债	10,458,000.00	0.29

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300406	九强生物	5,425,314.32	0.15	新股锁定

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,114,602,563.11
报告期期间基金总申购份额	2,045,824,605.77
减:报告期期间基金总赎回份额	1,222,443,315.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	665,605,617.06
报告期期末基金份额总额	3,603,589,470.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同,本基金的第一个保本周期于2015年5月19日提前到期。本基金第二个保本周期起始日为2015年6月15日,第二个保本周期由中国投融资担保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。本基金管理人于本报告期对本基金基金合同部分内容进行了修订,修订后的基金合同自本基金第二个保本周期起始日起生效,详见本基金管理人相关公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会许可长城久鑫保本混合型证券投资基金注册的文件
2. 《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城久鑫保本混合型证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

9.3 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

长城久泰沪深300指数证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

§1 重要提示

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。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久泰沪深300指数
基金主代码	200002
前端交易代码	200002
后端交易代码	201002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末基金份额总额	904,477,854.60份
投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1)资产配置策略:本基金为增强型指数基金,股票投资以沪深300指数作为目标指数。在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。(2)股票投资策略:本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对沪深300指数的跟踪,即按照沪深300指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深300指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3)债券投资策略:本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	自基金合同生效至2011年3月31日的业绩比较基准为:95%×中信标普300指数收益率+5%×银行同业存款利率;自2011年4月1日开始业绩比较基准为:95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险,获取市场平均收益。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	311,031,474.91
2.本期利润	227,172,615.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.2148
4.期末基金资产净值	1,578,370,704.70
5.期末基金份额净值	1.7451

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。

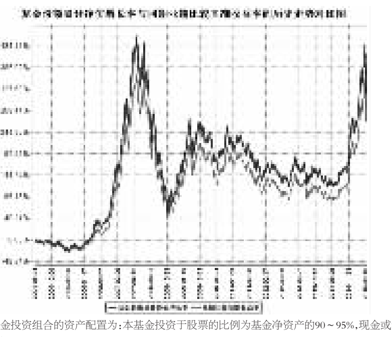
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	9.96%	2.49%	9.99%	2.48%	-0.03%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:本基金投资于股票的比例为基金净资产的90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2004年5月21日	-	15年	男,中国籍,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理公司,曾任基金经理助理、"长城安心回报混合型证券投资基金"和"长城中小盘成长股票型证券投资基金"基金经理、公司总经理助理。

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》、《长城久泰沪深300 指数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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,外部宏观经济环境相对平稳,美国经济依然相对强势,欧日仍旧维持低迷,希腊债务违约风险上升。国内宏观经济仍然呈现弱势格局,但是初步出现低位企稳态势,房地产销售有所好转,部分一线城市房价出现显著上涨,社会消费相对平稳。货币政策继续延续适度宽松态势,相继推出降准降息措施,财政政策继续托底,政策继续推动经济结构转型,鼓励大众创业、支持万众创新。证券市场方面,本季度证券市场演绎了从疯狂到幻灭的过程。进入四月份南北车引领"一带一路"和国企改革主题投资大行其道;5月份,"互联网+"转型升级持续升温,股市成为"故事汇",只要有转型的愿望、拥抱互联网的决心,市值就被高看一线,定增注入概念、管理层增持锁定价格、股权激励描绘未来的成长,这些都一步一步强化二级市场的信心,市值则一步一步膨胀到令人咂舌的地步,创业板一路冲上4000点。乱象丛生、一路上涨的证券市场最终在季度末监管部门彻查场外配资的压迫下出现流动性问题,指数快速回落。本基金严格遵守基金合同,报告期内侧重于密切跟踪目标指数的投资目标,策略基本得当。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金比较基准收益率为9.99%,本基金报告期净值收益率为9.96%。本基金年初至报告期末日均跟踪误差为 0.0571%,年化跟踪误差为0.8846%,控制在比较低的水平。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 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	1,485,268,609.91	92.70
	其中:股票	1,485,268,609.91	92.70
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	110,859,853.47	6.92
7	其他资产	6,174,351.47	0.39
8	合计	1,602,302,814.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	3,805,202.34	0.24
B	采矿业	67,604,168.95	4.28
C	制造业	498,188,251.55	31.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,141,800.84	4.13
E	建筑业	66,473,097.89	4.21
F	批发和零售业	31,704,992.60	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	63,432,097.98	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,919,934.97	5.32
J	金融业	490,115,403.82	31.05
K	房地产业	60,868,445.99	3.86
L	租赁和商务服务业	15,288,359.39	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,089,897.83	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,729,974.76	0.11
R	文化、体育和娱乐业	18,974,024.76	1.20
S	综合	4,240,412.12	0.27
	合计	1,483,576,065.79	93.99

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采掘业	1,243,249.02	0.08
C	制造业	4,930.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	238,325.10	0.02
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	-	-
J	金融业	206,040.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,692,544.12	0.11

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	698,421	57,228,616.74	3.63
2	601166	兴业银行	2,030,203	35,021,001.75	2.22
3	600016	民生银行	3,312,010	32,921,379.40	2.09
4	600000	浦发银行	1,910,599	32,403,759.04	2.05
5	600030	中信证券	1,110,173	29,874,755.43	1.89
6	600837	海通证券	1,112,423	24,250,821.40	1.54
7	601766	中国中车	1,179,765	21,660,485.40	1.37
8	000651	格力电器	310,370	19,832,643.00	1.26
9	000002	万 科A	1,262,043	18,324,864.36	1.16
10	601328	交通银行	2,212,162	18,228,214.88	1.15

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600395	盘江股份	77,562	1,218,499.02	0.08
2	002416	爱施德	11,530	238,325.10	0.02
3	601211	国泰君安	6,000	206,040.00	0.01
4	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
5	002770	科迪乳业	500	4,930.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期本基金投资的前十名证券除中信证券、海通证券外,其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据中信证券、海通证券2015年1月19日发布的公告,二者因存在为到期融资融券合约展期的问题,被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

本基金经理分析认为,长城久泰基金是一只采取指数复制策略为主的增强指数基金,复制标的指数的成分股及其权重、控制跟踪误差是本基金运作的主要目标,该行政监管措施不影响本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度对中信证券、海通证券进行投资。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	576,849.10
2	应收证券清算款	348,209.71
3	应收股利	-
4	应收利息	20,367.42
5	应收申购款	5,228,925.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,174,351.47

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600395	盘江股份	1,218,499.02	0.08	重大事项
2	002416	爱施德	238,325.10	0.02	重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,230,250,250.84
报告期期间基金总申购份额	53,907,248.86
减:报告期期间基金总赎回份额	379,679,645.10
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	904,477,854.60

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 本基金设立等相关批准文件
2. 《长城久泰沪深300 指数证券投资基金基金合同》
3. 《长城久泰沪深300 指数证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件 营业执照
6. 基金托管人业务资格批件 营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

8.3 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

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月21日

§1 重要提示

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2015年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久兆中小板300指数分级		
基金主代码	162010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年1月30日		
报告期末基金份额总额	107,408,049.48份		
投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
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		
下属分级基金简称	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级场内简称	长城久兆	中小300A	中小300B
下属分级基金交易代码	162010	150057	150058
下属分级基金报告期末基金份额总额	33,811,016.48份	29,438,813.00份	44,158,220.00份
下属分级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高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

注:根据相关法规及基金合同,自2015年6月8日起长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由"久兆稳健"(代码:150057)变更为"中小300A",将长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称"久兆积极"(代码:150058)变更为"中小300B"。基金代码和其他信息均保持不变,详见本管理人2015年6月4日公告。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 — 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	13,196,201.09
2.本期利润	-3,353,633.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0505
4.期末基金资产净值	94,077,754.07
5.期末基金份额净值	0.876

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。

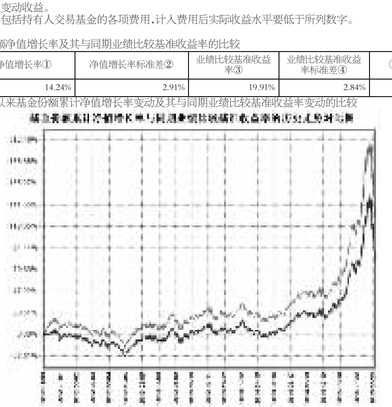
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	14.24%	2.91%	19.91%	2.84%	-5.67%	0.07%

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



注:本基金合同规定本基金投资组合为:本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%,其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300(价格)指数的成份股及其备选成份股,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月,建仓期满时,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余礼冰	长城久兆中小板300指数分级基金的基金经理	2012年4月17日	-	14年	女,中国籍,华中理工大学工学硕士。曾就职于富国基金、宝盈基金、友邦华泰基金等,2007年加入长城基金管理有限公司,曾任研究部副总经理。2012年1月至2012年4月任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"基金经理助理,自2012年4月至今任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"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》、《长城久兆中小板300指数分级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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年2季度A股市场在经历了狂热之后,于6月份始现了巨幅调整。

经济基本面方面,6月工业经济仍未见改善迹象:终端需求中仅地产一枝独秀,乘用车、家电和纺织服装依然疲弱;而与工业休戚相关的发电耗煤、铁路货运,其增速都是向下。政府仍以稳增长列为首要目标,并以地方债务置换等积极财政托底经济。但宽松货币预期引发金融市场的不稳定,阻碍调结构,稳增长与调结构间的矛盾进一步凸显。

二级市场在经过了这一轮暴跌和风险教育以后,投资环境可能会变得冷静理智一些。我们相信驱动这一轮超级牛市的三大逻辑依然成立,这三大逻辑是长期利率预期下行流动性环境宽松、国民资产配置长周期调整于金融资产、人民对国家改革转型的信心持续增强。而且,资本市场于国家改革转型和产业升级与优化资源配置的作用不可替代。我们依然相信这一轮牛市的基础依然存在,只不过中间充满了波折,尤其考虑到史无前例的杠杆资金入市,使得上涨和下跌都被放大,因而也加剧了波动和风险。

15年是中国改革的深化年。中小板300指数做为新兴产业和大消费占比较高的市场代表性指数将受益改革和经济转型,长城久兆中小板300指数分级基金做为交易型投资工具,适合于投资者做为交易品种投资。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为14.24%,本基金比较基准收益率为19.91%。本报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金自2015年4月8日起至2015年5月25日止连续33个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 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	90,270,539.74	91.95
	其中:股票	90,270,539.74	91.95
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	7,592,391.63	7.73
7	其他资产	311,086.57	0.32
8	合计	98,174,017.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	1,315,163.07	1.40
B	采矿业	848,080.30	0.90
C	制造业	64,743,798.71	68.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	438,030.37	0.47
E	建筑业	3,107,809.14	3.30
F	批发和零售业	3,754,351.74	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	175,814.03	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,797,010.52	8.29
J	金融业	2,575,924.57	2.74
K	房地产业	1,194,081.60	1.27
L	租赁和商务服务业	3,582,319.43	3.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	659,052.36	0.70
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	79,103.90	0.08
S	综合	-	-
	合计	90,270,539.74	95.95

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	002183	怡 亚 通	41,146	2,706,583.88	2.88
2	002024	苏宁云商	158,610	2,426,733.00	2.58
3	002415	海康威视	46,107	2,065,593.60	2.20
4	002450	康得新	41,878	1,281,466.80	1.36
5	002202	金风科技	59,217	1,152,954.99	1.23
6	002008	大族激光	39,236	1,126,857.92	1.20
7	002230	科大讯飞	31,842	1,112,559.48	1.18
8	002142	宁波银行	47,962	1,014,396.30	1.08
9	002456	欧菲光	28,760	970,362.40	1.03
10	002241	歌尔声学	26,612	955,370.80	1.02

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注: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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,778.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,839.54
5	应收申购款	250,468.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,086.57

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡 亚 通	2,706,583.88	2.88	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
报告期期初基金份额总额	11,699,056.36	4,496,961.00	6,745,442.00
报告期期间基金总申购份额	177,754,560.00	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	117,041,220.10	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-38,601,379.78	24,941,852.00	37,412,778.00
报告期期末基金份额总额	33,811,016.48	29,438,813.00	44,158,220.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及不定期折算(上折)调整份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 本基金设立等相关批准文件
2. 《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》
3. 《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

8.3 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