基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

2015 年度 报告摘要

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年03月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2015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	长城久富混合(LOF)
场内简称	长城久富
基金主代码	162006
交易代码	162006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年2月12日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	941,277,604.02份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007-05-18

注:本基金自2015年8月3日起由“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”,基金类别由“股票型”变更为“混合型”,并相应修改基金合同和托管协议,详见本管理人2015年8月3日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更基金名称、基金类别并相应修改基金合同条款的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	投资于具有核心竞争力的企业,分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益,力争为基金持有人实现稳定的超额回报。
投资策略	本基金投资的核心策略是“自下而上、精选个股”,同时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性。精选原则将继承基金久富以往富有成效的核心企业评价体系,以“具备核心竞争力、能够在市场中获取超额收益的企业”为主,构建均衡的投资组合。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金是较高预期收益较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金,但低于股票基金。

注:自基金合同生效至2015年9月30日本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中信金债指数收益率;自2015年10月1日起本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率。详见本管理人2015年9月30日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	洛崑崑
	联系电话	0755-23982338	95559
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-8868-666	95559
传真		0755-23982328	021-62701216

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	719,854,922.07	235,652,824.48	192,167,907.39
本期利润	549,566,251.92	256,007,616.27	146,752,401.47
加权平均基金份额本期利润	0.4877	0.1369	0.0708
本期基金份额净值增长率	32.95%	15.43%	7.53%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.4979	0.1747	0.0960
期末基金资产净值	1,409,972,009.71	1,737,892,618.10	2,282,484,771.30
期末基金份额净值	1.4979	1.1747	1.0960

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	37.35%	2.24%	12.98%	1.25%	24.37%	0.99%
过去六个月	0.21%	3.59%	-11.04%	2.01%	11.25%	1.58%
过去一年	32.95%	2.99%	7.24%	1.87%	25.71%	1.12%
过去三年	65.01%	1.98%	42.89%	1.35%	22.12%	0.63%
过去五年	37.28%	1.70%	24.90%	1.21%	12.38%	0.49%
自开放式基金合同生效起至今	167.09%	1.72%	63.51%	1.46%	103.58%	0.26%

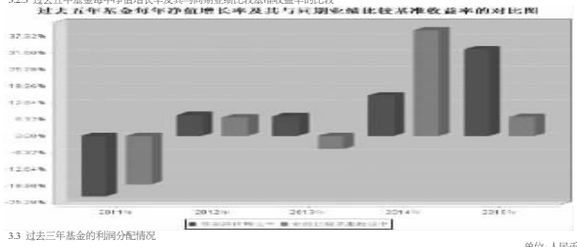
注:自基金合同生效至2015年9月30日本基金的业绩比较基准为:75%×沪深300指数收益率+25%×中信金债指数收益率;自2015年10月1日起本基金的业绩比较基准变更为:75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率,详见本管理人2015年9月30日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

3.2.2 自基金转型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本基金于2007年2月12日由封闭式基金基金久富转型而来。

②本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:股票资产占基金总资产60%-95%,债券占基金总资产0%-35%,权证投资占基金资产净值0%-3%,现金或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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.5000	38,673,982.59	33,262,035.51	71,936,018.10	注:属2014年度利润2013年实施分配。
2014	0.8000	89,893,401.35	64,891,931.52	154,785,332.87	注:本年度共利润分配两次,其中:属2013年度利润2014年实施分配合计82,912,690.18元;属2014年度利润分配合计71,872,642.69元。
2013	0.1500	15,273,828.48	14,915,985.41	30,189,813.89	注:属2012年度利润2013年实施分配。
合计	1.4500	143,841,212.42	113,069,952.44	256,911,164.86	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券股份有限公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币,2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券股份有限公司(47.0599%)、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%)、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:久富证券投资基金;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、长城久兆一年期定期开放式纯债型证券投资基金、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、长城久利保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	2009年9月22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,长城证券股份有限公司投资银行部,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“长城中小盘成长混合型证券投资基金”的基金经理,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》、《长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,我国面临的外部经济环境相对平稳。美国经济稳健复苏,美元则在全年预期加息的氛围中不断走强,并最终在年末启动了加息进程。欧洲和日本经济则在底部徘徊,强势美元和全球经济总体低迷的需求,压低了石油、铁矿石等大宗商品价格。国内宏观经济仍然呈现弱势格局。为提振经济货币政策明显走向宽松,全年多次降息降准,积极推动利率市场化,同时也采取多种货币政策工具向市场投放流动性,财政政策也更加积极,这也给人民币带来了贬值的压力,并推动央行在8月中旬推出新一轮汇改措施。证券市场方面,充足的流动性和金融创新工具的大量运用,杠杆资金大量入市,证券市场走势核心动力,除金融、险象环生,上半年始终新兴产业和“互联网+”主题大行其道,推动前业板指连创新高。年中在国家稳定市场的压力下市场剧烈震荡,并触动监管部门会同央行等有关部门联合入市干预,进入四季度后,随着场外配资清理进入尾声,主题投资再度成为市场的主旋律。全年沪深300指数收益率为5.58%,中小板指数收益率为53.7%,创业板指数收益率为84.41%。

本基金总体维持对内需和战略新兴产业中长期看好的观点,并意识到在宏观经济走出弱势之前市场的投资机会存在于主题投资有其内在的合理性,因而加大了对转型成长类个股的配置力度。

4.4.2 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32.95%,业绩比较基准收益率为7.24%。

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 2016年,我们认为外部环境随着美国经济复苏的一波三折,美元加息的节奏,欧洲、日本及主要新兴经济体的持续低迷而变得更加复杂和更多的不确定性。美元进入加息周期也给人民币汇率造成压力,给我国央行的货币政策带来一定的困扰。国内宏观经济仍将面临较大的下行压力,央行在制定货币政策时面临汇率、资金跨境流动、实体经济利率、经济增长率等复杂因素而持续艰难;中央政府力推供给侧改革,加大僵尸企业退出市场的力度,加快淘汰落后产能的步伐,长期有利于经济结构转型,短期可能引发波动。但我们认为,总体上国内货币政策逐步趋向宽松的趋势不会改变,但是边际效应在弱化,连年宽松的流动性指动债券收益率降低到非常低的水平,而追求无风险收益的资金依然乐此不疲,造成所谓“资产荒”——且出现信用风险,或者短期流动性紧张,可能带来巨大的风险,注册制的推出也将是资本市场近年来最具深远意义的制度变革,按对证券市场产生重大影响,但是短期也带来较大的不确定性。因此我们认为,经过超过两年的对新兴产业的炒作,目前该类个股从市值、估值角度都面临较大的压力,而宏观经济基本面仍无明显改善的迹象,上市公司业绩也难有超预期表现。2016年证券市场将充满变数,不确定性增加,投资难度加大,我们要稳扎稳打,深度发掘个股,紧密跟踪市场,努力为基金持有人带来满意的投资回报。

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、运行保障部总经理、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

本基金本报告期内,于2015年1月21日进行了利润分配,共分配71,936,018.10元,是对2014年度利润进行的分配。本报告期末本基金可供分配利润为468,694,405.69元,本基金已于2016年1月20日进行了利润分配,共分配94,506,131.36元,尚未分配的可供分配利润,在符合分红条件的前提下,将按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

2015年度,基金托管人在长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015年度,长城基金管理有限公司在长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为71,936,018.10元,符合基金合同的规定。

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

2015年度,由长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)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:长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

2015年12月31日

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		7,640,610.46	6,259,715.35
结算备付金		106,984,776.98	87,088,299.24
存出保证金		872,221.12	574,368.03
交易性金融资产		1,262,851,943.61	1,648,305,050.07
其中:股票投资		1,262,851,943.61	1,648,305,050.07
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收证券清算款		39,397,050.92	6,906,968.16
应收利息		49,795.81	52,106.95
应收股利		-	-
应收申购款		18,074.70	36,530.01
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,417,814,473.60	1,749,223,037.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,995,024.98	5,886,970.41
应付管理人报酬		1,747,782.86	2,230,443.88
应付托管费		291,297.16	371,740.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,945,706.62	1,967,704.06
应交税费		666,400.00	666,400.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		196,252.27	207,160.72
负债合计		7,842,463.89	11,330,419.71
所有者权益:			
实收基金		941,277,604.02	1,479,389,453.11
未分配利润		468,694,405.69	258,503,164.99
所有者权益合计		1,409,972,009.71	1,737,892,618.10
负债和所有者权益总计		1,417,814,473.60	1,749,223,037.81

注:截至2015年12月31日,基金份额净值1.4979元,基金份额总额941,277,604.02份。

7.2 利润表

会计主体:长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入		599,158,939.83	300,766,776.27
1.利息收入		2,157,312.82	2,091,113.19
其中:存款利息收入		2,122,052.98	1,883,155.29
债券利息收入		62.63	65.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,197.21	207,892.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		767,112,645.75	277,754,505.60
其中:股票投资收益		757,818,026.81	249,126,308.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益		315,777.37	121,581.25
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		8,978,841.57	28,506,615.91
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-170,288,670.15	20,354,791.79
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		177,651.41	566,365.69
减:二.费用		49,592,687.91	44,759,160.00
1.管理人报酬		23,170,596.38	29,944,181.01
2.托管费		3,861,766.12	4,990,696.79
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		22,091,170.12	9,344,611.20
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		469,155.29	479,671.00
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		549,566,251.92	256,007,616.27
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		549,566,251.92	256,007,616.27

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	1,479,389,453.11	258,503,164.99	1,737,892,618.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	549,566,251.92	549,566,251.92
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)	-538,111,849.09	-267,438,993.12	-805,550,842.21
其中:1.基金申购款	100,481,306.34	30,783,021.85	131,264,328.19
2.基金赎回款	-638,593,155.43	-298,222,014.97	-936,815,170.40
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)	-	-71,936,018.10	-71,936,018.10
五、期末所有者权益(基金净值)	941,277,604.02	468,694,405.69	1,409,972,009.71

项目	上年度可比期间 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)	2,082,626,094.81	199,858,676.49	2,282,484,771.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	256,007,616.27	256,007,616.27
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)	-603,236,641.70	-42,577,794.90	-645,814,436.60
其中:1.基金申购款	220,252,981.14	13,248,963.15	233,501,944.29
2.基金赎回款	-823,489,622.84	-55,826,758.05	-879,316,380.89
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)	-	-154,785,332.87	-154,785,332.87
五、期末所有者权益(基金净值)	1,479,389,453.11	258,503,164.99	1,737,892,618.10

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

长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”),原名为长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF),由原久富证券投资基金转型而成,依据中国证监会监督管理委员会(“中国证监会”)2007年2月1日证监基金字[2007]25号文《关于核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,久富证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金,调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同,并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”。自2007年2月12日起,《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,原《久富证券投资基金基金合同》失效。根据上述监基金字[2007]25号的核准,本基金自2007年3月5日至2007年3月6日公开集中申购,集中申购及利息总计人民币7,934,819,964.27元(已达到限量申购额),折合基金份额7,934,819,964.27份。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

集中申购资金结束日同时方原久富证券投资基金的基金份额转换日,长城基金管理有限公司按照基金转换基准日(2007年3月9日)原久富证券投资基金的份额净值,对原久富证券投资基金进行了基金份额转换,经基金托管人确认,原久富证券投资基金的基金总份额由500,000,000.00份转换为1,140,424,000.00份。

根据 2014年8月8日开始施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》以及相关基金合同的有关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,长城基金管理有限公司决定自2015年8月3日起,将“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”,基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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:75%×沪深300指数收益率+25%×中证综合债指数收益率。

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>公允价值业务处理的估价方式等事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及 其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计除以下说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致:

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发[2014]24号《关于发布《中国证券投资基金业协会信息披露工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的通知》的规定,自2015年3月25日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未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	1,262,851,943.61	89.07
	其中:股票	1,262,851,943.61	89.07
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	114,625,387.44	8.08
7	其他各项资产	40,337,142.55	2.85
8	合计	1,417,814,473.60	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	828,981,320.08	58.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,338,399.04	2.44
F	批发和零售业	14,330,000.00	1.02
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	100,339,600.00	7.12
J	金融业	48,937,000.00	3.47
K	房地产业	65,656,443.43	4.66
L	租赁和商务服务业	48,991,302.00	3.47
M	科学研究和技术服务业	30,588,297.60	2.17
N	水利、环境和公共设施管理业	15,798,073.36	1.12
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	51,674,616.10	3.66
S	综合	23,216,892.00	1.65
	合计	1,262,851,943.61	89.57

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	603008	喜临门	2,000,000	49,800,000.00	3.53
2	000673	当代东方	1,049,989	36,644,616.10	2.60
3	600271	航天信息	506,459	36,191,560.14	2.57
4	600303	曙光股份	2,234,250	34,295,737.50	2.43
5	300113	顺网科技	330,000	33,452,100.00	2.37
6	600485	信威集团	1,200,000	32,100,000.00	2.28
7	300008	上海佳豪	1,149,936	30,588,297.60	2.17
8	002228	合兴包装	1,543,237	30,123,986.24	2.14
9	601877	正泰电器	1,124,000	28,987,960.00	2.06
10	000801	四川九洲	927,600	28,690,668.00	2.03

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	300059	东方财富	120,024,594.70