长城久利保本混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3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
报告送出日期:2016年4月22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2016年04月20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2016年01月01日起至03月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	627,558,637.41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。
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
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-45,619,830.87
2.本期利润	-73,716,740.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1151
4.期末基金资产净值	1,166,296,813.20
5.期末基金份额净值	1.858

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。

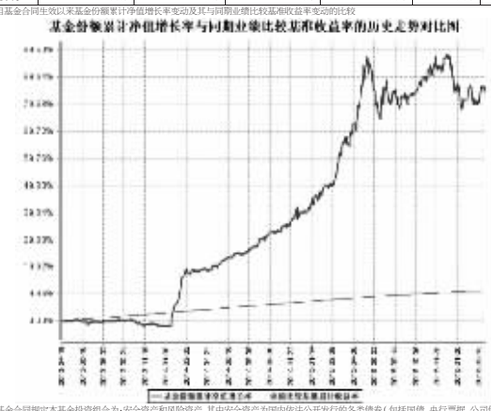
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-5.73%	0.90%	0.69%	0.01%	-6.42%	0.89%

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: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%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月内,建仓期满时,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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、长城淘金基金、长城久利保本基金、长城久益保本混合基金、长城久盈纯债分级债券型基金、长城久惠保本、长城新策略混合、长城久安保本基金的基金经理	2013年4月18日	-	9年	男,中国籍,中国人民大学经济学硕士,曾就职于中国工商银行总行信贷评估部,中国银行业监督管理委员会监管一部,中信银行总行风险管理部,2007年9月至2009年3月任基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。
储雯玉	长城稳固、长城久惠保本、长城久利保本、长城久鑫保本基金的基金经理	2015年10月15日	-	8年	女,中国籍,中央财经大学经济学学士、北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士,2008年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员、“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理。

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 管理人对投资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

16年一季度资本市场开端颇不平静,一方面供给侧改革带来的经济增长动力短期难以释放,另一方面保底线思维下政府稳增长力度加大,经济方面,年初以来补库存行情叠加开工旺季带来经济回暖预期,1.2月份金融数据放量、地产销量和投资改善、工业利润增速转正以及PMI数据回暖逐步强化这一预期。通胀方面,疏菜和猪肉价格的上涨带动CPI上行,货币政策方面,海外市场不断宽松以及美联储加息节奏放缓给予人民币贬值压力,货币政策在利率走廊和MPA两条主线下继续温度宽松。一季度多空分歧下的债券市场收益率呈现窄幅震荡,一方面利率债在短期无法证伪的基本面预期下中枢波动上行,另一方面信用利差在预性配置需求下不断走低。

二季度伊始,短期经济与物价双升的局面难以证伪,但更长期来看,基建和房地产产业链复苏的持续性存疑,过剩产能去化的实质性进展有待观察,稳增长画轴众多约束,债券市场周期拉长,收益率中枢下移是大概率事件,国债、政策性金融债、地方债供给量增幅较大,企业债、公司债等信用债发行审批加速,而银行理财、券商资管、基金专户规模持续增长,对债券的需求旺盛,债券市场供需两旺的格局将会持续,对于信用债,信用违约会成为常态,而当前信用利差的保护空间非常有限,信用债投资需要甄别风险。

一季度,我们适当缩短了组合久期,保持债券仓位80%左右,择机参与利率债波段操作,积极参与转债和新股一级申购,对于部分息差过窄、边际贡献较小的债券进行存量置换,优化组合结构;权益方面,受到股市深幅回调的影响,组合净值出现一定回撤,通过参与反弹适当减少了回撤幅度。二季度,我们将逐步降低组合仓位,合理安排组合头寸,确保平稳过渡进入下一保本期,积极参与低风险类固定收益机会,提高组合静态收益;完成下一保本期组合构建,根据安全垫构建情况灵活调整组合权益类资产仓位,以基本面确定性较强、估值相对合理、符合经济结构调整方向的个股作为主要投资标的,以期获取更好的风险调整后收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为-5.73%,本基金业绩比较基准收益率为0.69%。

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	224,941,169.07	18.89
	其中:股票	224,941,169.07	18.89
2	固定收益投资	708,960,969.62	59.53
	其中:债券	708,960,969.62	59.53
	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	227,710,941.57	19.12
	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	16,977,278.14	1.43
7	其他资产	12,357,129.37	1.04
8	合计	1,190,947,487.77	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	5,629,132.98	0.48
B	采矿业	-	-
C	制造业	156,156,175.91	13.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	12,416,222.10	1.06
F	批发和零售业		
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	7,983,000.00	0.68
J	金融业	22,199,500.00	1.90
K	房地产业	6,534,000.00	0.56
L	租赁和商务服务业	278,220.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,918,351.40	0.76
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	4,826,566.68	0.41
S	综合	-	-
	合计	224,941,169.07	19.29

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	000568	泸州老窖	549,923	13,555,601.95	1.16
2	002325	洪涛股份	999,999	12,379,987.62	1.06
3	000651	格力电器	600,000	12,234,000.00	1.05
4	000687	华讯方舟	599,978	11,939,562.20	1.02
5	002502	骅威股份	399,938	10,962,300.58	0.94
6	600568	中珠控股	600,000	9,414,000.00	0.81
7	300190	维尔利	469,140	8,918,351.40	0.76
8	600160	巨化股份	695,550	8,374,422.00	0.72
9	000666	经纬纺机	400,000	8,120,000.00	0.70
10	000801	四川九洲	300,000	8,070,000.00	0.69

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	126,924,961.00	10.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	216,921,000.00	18.60
	其中:政策性金融债	216,921,000.00	18.60
4	企业债券	206,318,542.46	17.69
5	企业短期融资券	70,012,000.00	6.00
6	中期票据	51,100,000.00	4.38
7	可转债	37,684,466.16	3.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	708,960,969.62	60.79

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	150018	15附息国债18	600,000	60,018,000.00	5.15
2	160209	16进开09	600,000	59,934,000.00	5.14
3	130240	13进开40	500,000	54,275,000.00	4.65
4	122377	14首开债	500,000	52,795,000.00	4.53
5	122406	15新湖债	505,700	52,006,188.00	4.46

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、招商银行外,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。

中信证券股份有限公司因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定,于2015年11月26日收到中国证监会立案调查通知书;中信证券泉州宝洲路证券营业部因存在员工违规为客户融资提供便利的问题,于2016年3月16日被福建证监局采取出具警示函的监管管理措施。

招商银行股份有限公司长春分行因基金销售业务存在问题,于2016年1月6日被吉林证监局采取责令改正的监管管理措施。

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,上述事项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、招商银行进行投资。

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	261,134.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,153.30
5	应收申购款	95,388.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	372,675.49

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	000651	格力电器	13,446,511.74	1.59	重大事项
2	000002	万科A	13,275,326.79	1.57	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:在基金投资股票的投资组合的股票市值和股票指数投资的股票市值合计中,因上述原因而导致流通受限情况的股票市值合计不在流通受限情况的说明中披露的,其原因分别为:

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	761,211,580.78
报告期期间基金总申购份额	193,816,088.32
减:报告期期间基金总赎回份额	295,269,465.76
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	659,758,203.34

§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

长城久泰沪深300指数证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31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:2016年4月22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2016年04月20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2016年01月01日起至03月31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	659,758,203.34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(2016年1月1日 — 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-37,019,747.42
2.本期利润	-189,200,115.43
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2165
4.期末基金资产净值	845,683,648.09
5.期末基金份额净值	1.2818

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。

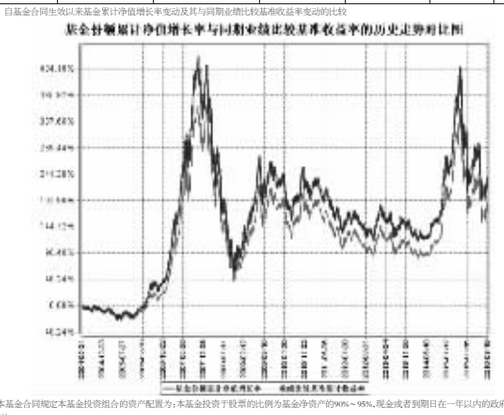
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-13.44%	2.35%	-13.02%	2.31%	-0.42%	0.04%

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	-	16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。曾就职于华夏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”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 管理人对投资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

一季度,外部宏观经济相对平稳,国内宏观经济仍然呈现弱势格局,但是在去年开始的推动房地产消化存量的政策效果开始显现,房屋新开工面积增速同比转正,二月份后经济金融迹象显著,央行在二月份未适时降准,信贷投放大超预期,中采PMI指数终于在时隔数月后重返荣枯线上方,三月份数据达到50.2,证券市场则是先抑后扬,受人民币贬值预期增强,机构调仓、大小非减持限制到期等因素的影响,市场在新年伊始就开始快速调整,而新实施的熔断机制则加剧了市场波动并很快被叫停,此后得益于美元加息预期减弱、人民币对美元汇率企稳、经济数据企稳、战略新兴板及注册制延后等利好,市场稳步反弹。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,本基金报告期净值收益率为-13.44%,本基金比较基准收益率为-13.02%。本基金年初至报告期末日均跟踪误差为0.0749%,年化跟踪误差为1.1609%,受到长期停牌个股在基金份额变动时无法及时调整以及采用指数收益法估值带来的价格差异,本报告期跟踪误差有所增大,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	797,462,958.06	94.08
	其中:股票	797,462,958.06	94.08
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	49,851,062.30	5.88
7	其他资产	372,675.49	0.04
8	合计	847,686,695.85	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	671,023.76	0.08
B	采矿业	29,102,123.73	3.44
C	制造业	263,624,674.47	31.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,376,283.43	3.71
E	建筑业	29,200,028.24	3.45
F	批发和零售业	18,987,721.05	2.25
G	交通运输、仓储和邮政业	26,251,203.73	3.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,627,842.41	5.28
J	金融业	281,522,875.98	33.29
K	房地产业	39,568,599.43	4.68
L	租赁和商务服务业	7,518,838.17	0.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,147,007.39	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,121,804.96	0.13
R	文化、体育和娱乐业	13,220,091.58	1.56
S	综合	3,887,922.73	0.46
	合计	796,828,041.06	94.22

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	-	-
C	制造业	473,042.18	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.00
F	批发和零售业	125,640.34	0.01
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	-	-
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	634,917.00	0.08

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	1,012,145	32,196,332.45	3.81
2	600016	民生银行	2,702,845	24,622,917.95	2.91
3	601166	兴业银行	1,223,526	19,001,358.78	2.25
4	600000	浦发银行	878,176	15,745,695.68	1.86
5	600036	招商银行	948,609	15,263,118.81	1.80
6	000651	格力电器	659,466	13,446,511.74	1.59
7	000002	万 科A	705,759	13,275,326.79	1.57
8	600030	中信证券	736,103	13,102,633.40	1.55
9	601328	交通银行	2,169,492	12,084,070.44	1.43
10	600519	贵州茅台	47,398	11,737,640.72	1.39

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	002791	坚朗五金	3,973	149,345.07	0.02
2	002792	通宇通讯	3,081	135,440.76	0.02
3	002788	鹭燕医药	2,663	125,640.34	0.01
4	603861	白云电器	4,056	96,735.60	0.01
5	300474	景嘉微	2,467	48,451.88	0.01

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	479,437.62
2	应收证券清算款	190,946,587.88
3	应收股利	-
4	应收利息	32,569,510.98
5	应收申购款	494.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,996,030.55

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	113008	电气转债	89,115,000.00	2.99
2	128009	歌尔转债	30,465,135.36	1.02

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	300153	科泰电源	1,893,981.06	0.06	重大事项停牌

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	3,190,559,018.06
报告期期间基金总申购份额	9,458,651.13
减:报告期期间基金总赎回份额	228,433,172.04
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	2,971,584,497.15

§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. 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

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

长城久鑫保本混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22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2016年04月20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