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:2013年8月29日

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

§1 重要提示及目录

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。本半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2013年08月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年01月01日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)	
基金简称	长城久富股票(LOF)	长城久富(场内简称)
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	2,204,405,996.03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	

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%×中信全债指数收益率。
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混合基金、债券基金与货币市场基金。

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	裴学敏
	联系电话	0755-23982338	95559
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		400-8868-666	95559
传真		0755-23982328	021-62701262

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	85,518,026.61
本期利润	31,947,407.82
加权平均基金份额本期利润	0.0152
本期基金份额净值增长率	1.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0374
期末基金资产净值	2,286,863,080.24
期末基金份额净值	1.0374

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
过去一个月	-7.81%	1.61%	-11.92%	1.41%	4.11%	0.20%
过去三个月	-4.14%	1.25%	-8.67%	1.10%	4.53%	0.15%
过去六个月	1.78%	1.20%	-8.94%	1.13%	10.72%	0.07%
过去一年	1.96%	1.11%	-6.82%	1.03%	8.78%	0.08%
过去三年	7.71%	1.24%	-7.53%	1.03%	15.24%	0.21%
自基金合同生效日起至今	64.75%	1.55%	4.20%	1.50%	60.55%	0.05%

注:从D1到Dn时间区间业绩比较基准的收益率由D0到D1区间内每个交易日收益率的合成计算而来,计算公式如下:

从D1到Dn时间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×……×(1+ Dn日业绩比较基准收益率)-1

这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下:

长城久富业绩比较基准每日收益率=沪深300指数日收益率×75%+中信全债指数日收益率×25%

指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成。

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。

§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:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、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和长城久利保本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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司总经理助理、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	-	13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"的基金经理。

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》、《长城久富核心成长股票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 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

上半年,外部环境相对稳定。美国经济复苏缓慢而有力,就业数据不断好转,量化宽松政策的退出预期更加强烈,这也导致美元走强,黄金等商品价格持续走弱。日本推出无限量的量化宽松政策后日元持续贬值。欧元区经济乏善可陈,经济仍处于衰退之中,但是也没有继续恶化的迹象。国内宏观经济继上年四季度出现短暂反弹后不断走弱,发电量、工业企业增加值、社会商品零售总额均保持低速增长,PMI重回荣枯线以下,CPI维持低位,对全年宏观经济增速的预期被不断调低。本届政府对经济增速降低的容忍度明显提高,面对不断放缓的经济增速,并没有推出新的刺激政策,而是继续通过取消和下放行政审批事项,以转变政府职能,释放经济活力,打造中国经济的升级版,同时采取措施严控金融风险,规范银行理财等表外业务以降低金融企业杠杆率。六月份,在外汇占款大幅度下降、银行间出现违约事件后央行仍冷静面对,这导致银行间资金面在月末持续紧张,并产生一定的连锁反应,最终导致A股市场出现暴跌,创出近年来的新低。自去年四季度末开始的A股的估值修复行情在二月中旬基本告一段落,在2月末后开始分化,并且这种分化的走势贯穿整个上半年,集中体现创业板指上半年涨幅达到41.72%,而同期沪深300指数下跌12.78%。大消费类和成长类个股尤其是与传媒、安防、通讯、智能终端、军工、医药等产业链相关的成长性良好、成长空间较大的个股受到资金的追捧,估值不断提升。产能过剩、景气下降、政策不明朗的周期相关的个股则持续走弱,在6月末资金面紧张时银行、地产、煤炭、建材等周期性品种再度大幅度下挫。受到政府限制三公消费影响的白酒股仍然萎靡不振。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。报告期内增加了对电子、传媒、安防等行业的配置,组合相对稳定。得益于医药行业的较高配置和该板块的良好表现,净值表现好于比较基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为1.78%,本基金业绩比较基准收益率为-8.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为,除非经济滑落到就业市场出现问题、进而引发社会动荡的后果,政府仍将继续转变政府职能、释放经济活力,降低金融体系的风险(降杠杆,纠正信贷资产的结构错配),同时继续容忍经济一定程度的放缓,不会出台大规模的刺激政策。这些政策措施长期方向正确,但是短期对经济的提振作用有限,还可能加剧经济转型产生的阵痛。基于这样的政策前提,我们判断宏观经济仍将维持低位运行的态势。银行间拆借利率经过短暂恐慌性的高企后最终将逐步恢复常态,但资金面偏紧的格局将持续长时间。证券市场由于资金紧张导致的短期大幅下挫在三季度将得到一定程度的修复,但是综合考虑经济基本面、资金面以及IPO将重启对供求关系的影响,下半年的证券市场仍然难以见到趋势性的投资机会。充分市场化的、属于结构转型未来发展方向的消费、内需型产业的景气度仍将得到延续,和过去刺激政策相关、产能过剩严重的强周期行业在去产能化完成之前仍然难以迎来景气度的拐点。我们将在市场的调整中调整持仓结构,关注估值有吸引力的家电、汽车等业绩稳定增长的行业,同时中线关注消费电子、传媒、软件等快速增长行业中孕育的结构性的投资机会。

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

公司成立了基金估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司分管估值业务副总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和研究部门、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席基金估值委员会。

基金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基金估值委员会建议应采用的估值方法及及合理的估值区间。金融工程人员根据基金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。

基金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,向基金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

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配原则的规定,本基金收益每年最多分配4次,年度收益分配比例不低于可分配收益的40%,基金收益分配后每基金份额净值不能抵于面值,如基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。

本基金2013年1月21日对2012年的利润进行了分配,共分配利润30,189,813.89元。截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为82,457,084.21元,期末可供分配基金份额利润为0.0374,将按照基金合同的约定适时向投资者分配。

§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

2013年上半年度,基金托管人在长城久富核心成长股票型证券投资基金(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

2013年上半年度,长城基金管理有限公司在长城久富核心成长股票型证券投资基金(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30,189,813.89 元,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2013年上半年度,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股票型证券投资基金(LOF)的半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		117,709,748.17	222,396,051.22
结算备付金		72,464,251.29	106,534,011.17
存出保证金		699,418.35	1,000,000.00
交易性金融资产		1,956,488,071.03	1,725,119,425.62
其中:股票投资		1,956,488,071.03	1,625,079,425.62
基金投资		-	-
债券投资		-	100,040,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		138,000,647.00	-
应收证券清算款		6,638,489.87	13,728,380.06
应收利息		224,130.29	2,489,188.21
应收股利		1,753,698.48	-
应收申购款		192,612.14	270,904.59
递延所得税资产		-	-
其他资产		50,411.43	-
资产总计		2,294,221,478.05	2,071,537,960.87
负债和所有者权益		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	5,654,021.52
应付赎回款		1,458,684.80	1,284,675.19
应付管理人报酬		2,935,482.79	2,483,708.14
应付托管费		489,247.15	413,951.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,625,340.50	803,617.16
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		183,242.57	1,706,202.98
负债合计		7,358,397.81	13,012,576.37
所有者权益:			
实收基金		2,204,405,996.03	1,991,595,409.36
未分配利润		82,457,084.21	66,929,975.14
所有者权益合计		2,286,863,080.24	2,058,525,384.50
负债和所有者权益总计		2,294,221,478.05	2,071,537,960.87

注:截至2013年6月30日,基金份额净值1.0374元,基金份额总额2,204,405,996.03份。

6.2 利润表

会计主体:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		57,560,304.65	177,338,671.59
1.利息收入		3,079,008.41	1,901,364.67
其中:存款利息收入		1,829,769.76	1,286,203.49
债券利息收入		1,058,630.14	28,356.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		190,608.51	586,805.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		107,969,322.59	-89,795,802.92
其中:股票投资收益		91,387,005.61	-99,970,259.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-562,500.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		17,144,816.98	10,174,456.44
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-53,570,618.79	265,204,248.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		82,592.44	28,861.63
减:二、费用		25,612,896.83	20,924,963.08
1.管理人报酬		16,854,998.66	15,327,411.85
2.托管费		2,809,166.43	2,554,568.66
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		5,710,092.76	2,803,531.89
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		238,638.98	239,450.68
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		31,947,407.82	156,413,708.51
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		31,947,407.82	156,413,708.51

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30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)	1,991,595,409.36	66,929,975.14	2,058,525,384.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,947,407.82	31,947,407.82
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)	212,810,586.67	13,769,515.14	226,580,101.81
其中:1.基金申购款	392,401,032.07	27,678,942.27	420,079,974.34
2.基金赎回款	-179,590,445.40	-13,909,427.13	-193,499,872.53
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)	-	-30,189,813.89	-30,189,813.89
五、期末所有者权益(基金净值)	2,204,405,996.03	82,457,084.21	2,286,863,080.24
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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)	2,116,629,486.02	-90,166,330.31	2,026,463,155.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	156,413,708.51	156,413,708.51
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)	-41,419,287.71	-344,675.77	-41,763,963.48
其中:1.基金申购款	32,971,844.55	-900,277.38	32,071,567.17
2.基金赎回款	-74,391,132.26	555,601.61	-73,835,530.65
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)	2,075,210,198.31	65,902,702.43	2,141,112,900.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨光裕 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")由原久富证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会("中国证监会")2007年1月31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上市开放式基金、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。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")。

根据上述证监基金字[2007]25号的核准,本基金自2007年3月5日至2007年3月6日(已达到限量申购额)公开集中申购。经深圳大华天诚会计师事务所验证并出具深华(2007)验字015号验资报告。于集中申购验资日(2007年3月12日),集中申购资金及利息总计人民币7,934,819,964.27元,折合基金份额7,934,819,964.27份。

集中申购验资结束日同时为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。

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%×中信全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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3号《半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。

6.4.3 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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 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,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,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,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,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;

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。

3.个人所得税

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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

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,个人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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,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。

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
交通银行	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	976,274,433.69	25.32%	213,185,465.90	12.15%
东方证券	433,906,442.18	11.25%	529,480,416.50	30.18%

6.4.8.1.2 债券交易

注:本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行过债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行过债券回购交易。

6.4.8.1.4 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过权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	886,890.32	25.38%	452,516.46	27.85%
东方证券	395,027.05	11.30%	159,916.25	9.84%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	181,207.51	12.26%	181,207.51	20.25%
东方证券	452,985.62	30.65%	224,018.43	25.03%

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上海证券交易所买(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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,854,998.66	15,327,411.85
其中:支付销售机构的客户维护费	2,924,683.28	2,906,572.09

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%/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

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前十五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,809,166.43	2,554,568.66

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前十五个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012