长城久鼎保本混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2018年第2号）

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
二〇一八年九月

长城久鼎保本混合型证券投资基金经2016年3月7日中国证券监督管理委员会证监许可[2016]445号文注册募集。基金合同于2016年7月21日生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

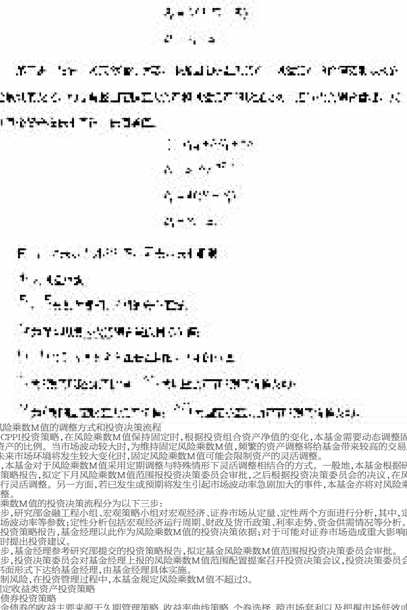
本招募说明书所载内容截止日为2018年7月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

本基金托管人中国银行股份有限公司已对本次更新的招募说明书中的投资组合报告和 业绩表现进行了复核确认。一、基金管理人

（一）基金管理人情况
1、名称：长城基金管理有限公司
2、住所：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
3、办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
4、法定代表人：何伟
5、组织形式：有限责任公司
6、设立日期：2001年12月27日
7、电话：0755-23982338 传真：0755-23982328
8、联系人：袁柳生
9、管理基金情况：目前管理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(长城中证500指数增强型证券投资基金)、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、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置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、长城久祥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、长城久安保本混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城久嘉保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金等四十五只基金。
10、客户服务电话：400-8868-666
11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币
12、股权结构：

持股单位	占总股本比例
长城证券股份有限公司	47.059%
东方证券股份有限公司	17.647%
中原信托有限公司	17.647%
北方国际信托股份有限公司	17.647%
合计	100%

（二）基金管理人主要人员情况
1.董事、监事及高管人员介绍
（1）董事
何伟先生，董事长，硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。
熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人，银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。
范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司党委委员，宝城期货有限责任公司董事长。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理，长城证券有限公司总裁助理兼纪委书记，副总经理。
杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司研究所研究员，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。
姬宏俊先生，董事，硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。
金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经理。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁，北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理，北方国际信托股份有限公司副总经理。
王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行计划资金管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。
万建华先生，独立董事，硕士。现任上海市互联网金融行业协会会长，通联支付网络服务股份有限公司董事。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券有限公司董事长)，国通证券有限责任公司（现招商证券股份有限公司）董事长），中国银联股份有限公司党委书记、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理，国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长，证通股份有限公司董事长。
徐英女士，独立董事，学士。现已退休。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理，常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事，新华资产管理股份有限公司副董事长。
鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。
（2）监事
吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师（非执业）。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计财部副总经理。2003年进入长城证券股份有限公司，任财务部总经理。
曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。
杨斌先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自1998年7月至2015年6月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。
黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。 2002 年 7 月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。
何小乐女士，监事，学士。现任长城基金管理有限公司董事会秘书。曾任职于中国农业银行四川省分行、花旗银行（中国）有限公司成都分行，自2010年10月至2018年2月担任成都华信弘俊投资管理有限公司总经理、高级合伙人。
袁柳生先生，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司综合管理部总经理。2008年6月至2014年2月任职于长城基金管理有限公司综合管理部，2014年3月至2018年4月任长城嘉信资产管理有限公司综合运营部总监。
王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理，综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。
张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。
（3）高级管理人员
何伟先生，董事长，简历同上。
熊科金先生，董事、总经理，简历同上。
彭洪波先生，副总经理兼国际业务部总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管，部门副总经理，部门总经理，公司督察长兼监察稽核部总经理，公司总经理助理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理。
杨建华先生，副总经理，投资总监兼基金管理部总经理，投资决策委员会委员，基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”基金经理，期间曾任公司总经理助理、研究部总经理。
卢盛春先生，副总经理兼机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。
车君女士，督察长、监察稽核部总经理，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。
2.本基金基金经理简历
陈良栋先生，清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。具有7年证券从业经历。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年11月27日至今任“长城保本混合型证券投资基金”和“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年3月30日至今任“长城久安保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月12日至今任“长城久益保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年8月25日至今任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2017年3月16日至今任“长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
马强先生，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城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”和 “长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年6月24 日至2017年3月16日任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2015年12月15日至2018年6月22日任“长城久鑫保本混合型证券投资基金”。现任公司固定收益部副总经理，投资决策委员会委员，自2015年12月至今任“长城新策略灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月15日至今任“长城新优选混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月28日至今任“长城久益保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月20日至今任“长城久安保本混合型证券投资基金”和“长城久润保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月26日至今任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年11月4日至今任“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自2017年7月27日至今任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理。
长城久鼎保本混合型证券投资基金历任基金经理如下：史彦刚先生自2016年7月21日至2016年12月1日担任基金经理。
3.本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下：
熊科金先生，投资决策委员会主任，公司董事、总经理。
杨建华先生，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。
何以广先生，投资决策委员会委员，公司研究部总经理、基金经理。
马强先生，投资决策委员会委员，公司固定收益部副总经理、基金经理。
4.上述人员之间不存在近亲属关系。
二、基金托管人
（一）基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566
（二）基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。
（三）证券投资基金托管情况
截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
三、相关服务机构
（一）基金份额发售机构
1.直销机构
名称：长城基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层
法定代表人：何伟
成立时间：2001年12月27日
电话：0755-23982338
传真：0755-23982328
联系人：黄念英
客户服务电话：400-8868-666
网站：www.ccfund.com.cn
2.代销机构
（1）中国银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：陈四清
联系人：宋亚平
客服电话：95566
网址：www.boc.cn
（2）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
联系人：李鸿岩
电话：010-66107913
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
（3）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
电话：0755-83198888
传真：0755-83195049
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
网站：www.cmbchina.com
（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：021-58781234
传真：021-58408842
联系人：胡迪峰
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com
（5）兴业银行股份有限公司
住所：福州市湖东路154号
法定代表人：高建平
电话：021-62677777
传真：021-62569070
联系人：陈晓瑾
客户服务电话：95561
网站：www.cib.com.cn
（6）中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人：李庆萍
联系人：丰靖
电话：010-65550827
传真：010-65541230
客户服务电话：95558
网址：http://bank.ecitic.com/
（7）中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
电话：010-56367136
传真：010-57092611
联系人：穆婷
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn
（8）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
联系人：周志杰
电话：021-61614934
网址：www.spdb.com.cn
客户服务电话：95528
（9）平安银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
法定代表人：谢永林
联系人：赵杨
电话：0755-22166574
网址：http://bank.pingan.com/
客户服务电话：95511-3
（10）东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址：东莞市南城路2号
办公地址：东莞市南城路2号
法定代表人：何沛良
联系人：杨亢
电话：0769-22866270
传真：0769-22320896
客服电话：0769-961122
网址：www.drcbank.com
（11）泉州银行股份有限公司
注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路3号
法定代表人：傅子能
联系电话：0595-22551071
联系人：董培姗
客服电话：400-8896-312
公司网站：www.qzccbank.com
（12）宁波银行股份有限公司
注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：邱艇
电话：0574-87050397
客服电话：95574
公司网站：www.nbcb.cn
（13）武汉农村商业银行股份有限公司
注册地址：武汉市江岸区建设大道618号
法定代表人：徐小建
联系人：邹君
电话：027-85497270
客服热线：96555
网站：www.whrcbank.com
（14）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
电话：010-85130577
联系人：权唐
客户服务电话：4008888108
网址：www.csc108.com
（15）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
法定代表人：王开国
电话：021-23219991
联系人：程丽辉
客户服务电话：95553,4008888001
网址：www.htsec.com
（16）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市延平路135号
法定代表人：杨德红
联系人：芮敏祺
电话：021-62580818-213
传真：021-62569400
客户服务电话：4008888666
网址：www.gtja.com
（17）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：曹晔
电话：021-33388215
传真：021-33388224
客服电话：95523/4008895523/4008000562
网址：www.swhysc.com
（18）兴业证券股份有限公司
住所：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
电话： 021-38565547
联系人：乔琳雪
网址： www.xyzq.com.cn
客户服务电话：95562
（19）长城证券股份有限公司
注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：刘阳
电话：0755-83516289
传真：0755-83515567
客户服务电话：0755-33680000，4006666888
网址：www.cgws.com
（20）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
联系人：黄婵君
电话：0755- 82960167
传真：0755-82943237
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
（21）平安证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：周一涵
电话：021-38637436
传真：021-33830395
客户服务电话：4008816168
网址：www.pingan.com
（22）中航证券有限公司
注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：王宜四
联系人：戴蕾
电话：0791-86868681
传真：0791-86770178
客服电话：400-8866-567
网址：www.avicsec.com
（23）华西证券股份有限责任公司
注册地址：四川省成都市陕西街239号
办公地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼（深圳总部）
法定代表人：张慎修
联系人：张曼
电话：010-52723273
客户服务电话：4008-888-818
网址：www.hx168.com.cn
（24）国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层
法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183333
传真：010-84183311
客户服务电话：400-818-8118
网址：www.guodu.com
（25）国盛证券有限责任公司
注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦
办公地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际大厦
法定代表人：徐丽峰
联系电话：0791-86281305
联系人：周欣玲
客户服务电话：4008222111
网址：www.gsstock.com
（26）渤海证券股份有限公司
住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
办公地址：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：王春峰
联系人：蔡霆
电话：022-28451991
传真：022-28451892
客户服务电话：400-651-5988
网址：www.ewww.com.cn
（27）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼
办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人：邱三发
联系人：林洁茹
电话：020-88836999
传真：020-88836654
客户服务电话：020-961303
网址：www.gzs.com.cn
（28）世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人：姜昧军
联系人：袁媛
电话：0755-83199511
传真：0755-83199545
客户服务电话：0755-83199599
网址：www.csco.com.cn
（29）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市市中区经七路86号
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客服电话：95538
网址：www.zts.com.cn
（30）光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：李芳芳
客服电话：4008888788、10108998
公司网址：www.ebscn.com
（31）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人：杨宝林
联系电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
联系人：吴忠超
客户服务电话：95548
公司网址：www.citicssd.com
（32）中国中投证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人：龙增来
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客服电话：400-600-8008、95532
网址：www.china-invs.cn
（33）西部证券股份有限公司
住所：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：梁承华
电话：029-87406168
传真：029-87406387
客服热线：95582
网址：www.westsecu.com.cn
（34）长江证券股份有限公司
地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客服热线：4008-888-999或95579
网址：www.95579.com
（35）国融证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路18 号
法定代表人：孔佑杰
联系人：陈文彬
电话：010-83991888
传真：010-88086637
客户服务电话：400-660-9839
网址：www.grzq.com
（36）中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
法定代表人：张佑君
联系人：马静懿
电话：010-60833889
客户服务电话：95548
网站：www.cs.ecitic.com
（37）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号A座3层
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
联系电话：010-58315221
传真：010-58568062
客服电话：010-58568118
公司网站：www.hrsec.com.cn
（38）大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：山西省太原市长治路111号世贸中心A座13层
法定代表人：董祥
联系人：薛津
客户服务热线：400-7121-212
网址：www.dtsbc.com.cn
（39）东兴证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人：徐勇力
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
传真：010-66555246
客服电话：400-8888-993
公司网址：www.dxzq.net.cn
（40）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号大成大厦6层
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-83252182
传真：010-63080978
客服电话：95321
公司网址：www.cindasc.com
（41）西南证券股份有限公司
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号
法定代表人：余维佳
联系人：张煜
电话：023-63786141
客服电话：4008096096
公司网站：www.swsc.com.cn
（42）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：秦朗
电话：010-85679888
传真：010-85679535
客服电话：400-910-1166
网址：www.cicc.com.cn
（43）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张磊
联系人：洪诚
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com
（44）申万宏源西部证券有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人：李季
联系人：李巍
电话：010-88085195
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com
（45）方正证券股份有限公司
注册地址： 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观40-43层
法定代表人：何其聪
联系人：高洋
电话：010-59355546
客服电话：95571
网址：www.foundersc.com
（46）华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
法定代表人：俞洋
电话：021-64339000
传真：021-54967032
联系人：丁晨
客服电话：95323
公司网址：www.cfsc.com.cn
（47）南京证券股份有限公司
注册地址： 南京市江东中路389号
法定代表人：步国旬
联系人：王万君
客服电话：95386
公司网站：www.njzq.com.cn
（48）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
电话：021-20333333
传真：021-50498825
联系人：王一彦
客服电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn
（49）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com
（50）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
法定代表人：陈柏青
联系人：顾祥柏
电话：13918979642
客服电话：95188
公司网址：www.fund123.cn
（51）诺亚正行基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人：汪静波
联系人：徐诚
联系电话：021-38509636
客服电话：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com
（52）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：黄妮娟
联系电话：021-54509998
客服电话：400-1818-188
公司网站：www.1234567.com.cn
（53）众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
联系电话：010-59497361
传真：010-64788016
客服电话：400-876-9988
公司网站：www.zscffund.com
（54）北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：翟飞飞
联系电话：010-62020088
客服电话：400-888-6661
公司网站：www.myfund.com
（55）北京增财基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209室
法定代表人：王昌庆
联系人：张蕾
联系电话：010-67000988
客服电话：400-001-8811
公司网站：www.zcvc.com.cn
（56）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：吴阿婷
联系电话：0755-82721106
客服电话：400-9200-022
公司网站：licaike.hexun.com
（57）上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
法定代表人：杨文斌
联系人：胡锴隽
联系电话： 021-20613635
客服电话：400-700-9665
公司网站：www.ehowbuy.com
（58）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号
法定代表人：肖雯
联系电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网站：www.yingmi.cn
（59）上海陆金所资产管理有限公司
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
客户服务热线：4008219031
公司网站：www.lufunds.com
（60）上海中正达广基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号3楼
法定代表人：黄欣
联系人：戴珉微
联系电话：021-33768132
客服电话：400-6767-523
网址： www.zhongzhengfund.com
（61）上海利得基金销售有限公司
住所：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人：李兴春
联系人：徐雪吟
联系电话：021-50583533-3011
客服电话：400-921-7755
网址：http://a.leadfund.com.cn/
（62）深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址： 深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：陈勇军
电话：0755-83999913
传真：0755-83999926
客服电话：0755-83999907
网址：www.jinqianwo.cn
（63）深圳金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路16号东方科技大厦18楼
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
联系人：张烨
电话：0755-66892301
传真：0755-66892399
客服电话：400-9500-888
网址：www.jfzinv.com
（64）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：马怡
电话：010-56282140
客服电话：400-619-9059
网址：www.fundzone.cn
（65）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人：陈超
联系人：徐伯宇
电话：010 8918 9285
传真：010-89188000
客服电话：4000988511/ 4000888816
网址：kenterui.jd.com
（66）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：钱燕飞
联系人：王峰
电话：025-66996699-887226
客服电话：95177
网址：www.snjijin.com
（67）上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人：王延富
联系人：徐亚丹
电话：13818306630
客服电话：400-821-0203
网址：www.520fund.com.cn
（68）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
法定代表人：张彦
联系人：文雯
电话：010-83363101
客服电话：400-166-1188
公司网站：8.jrj.com.cn
（69）上海挖财金融信息服务有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
联系人：李娟
电话：15002933896
客服电话：021-50810687
网址：www.wacaijijin.com
（70）江苏汇林保大基金销售有限公司
住所：江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座
法定代表人：吴言林
联系人：李跃
电话：176 1215 4686
传真：021-53086809
客服电话：025-56663409
网址：www.huilinbd.com
（71）上海云湾基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区锦康路308号世纪金融广场6号楼6楼
法定代表人：戴新装
联系人：范泽杰
客服电话：400-820-1515
公司网站：www.zhengtongfunds.com
（72）北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层
法定代表人：张冠宇
联系人：刘美薇
电话：010-85870662
传真：4008875666-129666
客服电话：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.com
（73）一路财富（北京）信息科技股份有限公司
住所：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：徐越
客服电话：400-001-1566
公司网站：www.yilucaifu.com
（74）奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
（75）杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人：陈刚
联系人：张岩
电话：0571-86655920
传真：0571-85269200
客服电话：0571-86915761
网址：www.cd121.com
（76）北京植信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人：于龙
联系人：吴鹏
电话：010-56075718
传真：010-67767615
客服电话：400-6802-123
网址：www.zhixin-inv.com
（77）上海有鱼基金销售有限公司
注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址：上海市徐汇区桂平路391号A座五层
法定代表人：林琼
联系人：徐海峥
电话：021-64389188
传真：021-64389188-102
客服电话：4007676298
网址：http://www.youyufund.com/
（78）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法定代表人：李修辞
联系人：王茜蕊
电话：15321711533
客户电话：010-59013842
网址：www.wanjiawealth.com
（79）浙江同花顺基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人：凌顺平
联系人：刘宁
电话：18668036160
客服电话：4008-773-772
公司网站：http://www.5ifund.com
（80）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
联系人：党敏
电话：021-2069-1935
传真：021-2069-1861
客服电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com
（81）大泰金石基金销售有限公司
住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
法定代表人：袁顾明
联系人：赵明
电话：021-2032-4155
传真：021-2032-4199
客服电话：400-928-2266
公司网站：www.dtfunds.com
（82）民商基金销售（上海）有限公司
住所：上海黄浦区北京东路666号H区东座6楼A31室
法定代表人：贾慧琴
联系人：邱爽
客服电话：021-5020-6003
公司网站： www.msftec.com
（83）永鑫保险销售服务有限公司
注册地址：上海自由贸易试验区世博馆路200号3层A区
办公地址：上海自由贸易试验区世博馆路200号3层A区
法定代表人：单开
联系人：曹楠
电话：13961025188
传真：021-51105888
客服电话：13961025188
网址：www.all-share.com.cn
（84）北京坤元基金销售有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内8号中粮广场B座501
办公地址：北京市东城区建国门内8号中粮广场B座501
法定代表人：李雪松
联系人：崔炜
电话：18510774953
传真：010-8526 4540
客服电话：400-818-5585
网址：http://www.kunyuanfund.com
（85）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：戚晓强
电话：010-61840688
传真：010-61840699（每日划款）
客服电话：4000-618-518
网址：www.danjuanapp.com
（86）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
联系人：张巍婧
电话：021-65370077-255
传真：021-55085991
客服电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
（87）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
联系人：吴翠
电话：010-62675657
传真：8610-62676582
客服电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
基金管理人可根据业务发展需要，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
（二）基金注册登记机构
名称：长城基金管理有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
办公地址：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层
法定代表人：何伟
成立时间：2001年12月27日
电话：0755-23982338
传真：0755-23982328
联系人：张真珍
客户服务电话：400-8868-666
（三）律师事务所与经办律师
律师事务所名称：北京市中伦律师事务所
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街甲6号SK大厦36-37层
负责人：张学兵
电话：0755-33256666
传真：0755-33206888
联系人：李雅婷
（四）会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
住所（办公地址）：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁
电话：0755-25028023
传真：0755-25026023
联系人：昌华
四、基金的名称
长城久鼎保本混合型证券投资基金
五、基金的类型和运作方式
基金的类型：保本混合型
基金的运作方式：契约型开放式
六、基金的保本
一、保本
在第一个保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于认购保本金额（差额部分即为保本赔付差额），基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内将该差额支付给基金份额持有人；第二个保本周期起的后续各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额，由基金管理人根据当时有效的《基金合同》或基金管理人与保本义务人签署的《保证合同》或《风险买断合同》的约定将该差额支付给基金份额持有人。
认购保本金额：基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。
过渡期申购的保本金额：基金份额持有人在过渡期内进行申购并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值及过渡期申购费用之和。
从上一保本周期转入的保本金额：基金份额持有人从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在折算日所代表的资产净值。
基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用保本条款。
二、保本周期
本基金的保本周期一般为3年。第一个保本周期自《基金合同》生效之日起至三个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。在第一个保本周期内，如果基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在基金份额累计净值收益率连续达到或超过保本周期目标收益率的第15个工作日当日起10个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期。如果保本周期提前到期，则第一个保本周期到期日为管理人公告的保本周期提前到期日，但保本周期到期日不晚于《基金合同》生效之日起3个公历年后的对应日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）；基金管理人将在保本周期到期前公告的到期处理规则中确定下一个保本周期的起始时间。
三、保本案例
若某投资者投资100,000元认购本基金（该认购申请被全额确认）并持有到保本周期到期，认购费率为1.0%。假定募集期间产生的利息为10.00元，持有期间基金累计分红0.04元/基金份额。则，认购份额为：
认购净金额＝100,000/（1＋1.0%）＝99,009.90元
认购费用＝100,000－99,009.90＝990.10元
认购份额＝（100,000－990.10＋10.00）/1.00＝99,019.90份
1、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为0.9000元。
保本金额＝99,019.90×1.00＋990.10＝100,010.00元
可赎回金额＝99,019.90×0.9000＝89,117.91元
持有期间累计分红金额＝99,019.90×0.04＝3,960.80元
可赎回金额＋保本周期内累计分红金额＝89,117.91＋3,960.80＝93,078.71元
即：可赎回金额＋持有期间累计分红金额＜保本金额
若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照保本金额（扣除其持有期间的累计分红金额）向该投资者支付96,049.20元（即：100,010.00－3,960.80＝96,049.20）。其中，由基金管理人赔付的保本赔付差额为6,931.29元（即：100,010.00－（89,117.91＋3,960.80）＝6,931.29）。
2、若保本周期到期日，本基金基金份额净值为1.5000元。
保本金额＝99,019.90×1.00＋990.10＝100,010.00元
可赎回金额＝99,019.90×1.5000＝148,529.85 元
保本周期内累计分红金额＝0.04×99,019.90＝3,960.80元
可赎回金额＋持有期间累计分红金额＝152,490.65元
即：可赎回金额＋持有期间累计分红金额＞保本金额
若保本周期到期日该投资者赎回基金份额，则基金管理人将按照可赎回金额向该投资者支付148,529.85元。
四、保本周期目标收益率
本基金保本周期最长为3年，在每一保本周期内均设置保本周期目标收益率，在运作期间，如本基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在满足条件之日起10个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期（提前到期日为过渡期前一个工作日，距离满足条件之日起不超过20个工作日），并进入过渡期。在过渡期内开放申购赎回，在过渡期最后一个工作日本基金净值折算为1.00元。过渡期结束后，本基金将进入下一保本周期，同时重新开始计算下一保本周期目标收益率。本基金基金合同生效后首个保本周期目标收益率为24%，此后每个保本周期目标收益率将由基金管理人届时在相关公告中披露。
五、适用保本条款的情形
1、基金份额持有人认购并持有到期的基金份额、或过渡期申购并持有到期的基金份额、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额；
2、对于前条所述持有到期的基金份额，基金份额持有人作出下列选择，均适用保本条款：
（1）保本周期到期后赎回基金份额；
（2）保本周期到期后从本基金转换到管理人管理的其他基金；
（3）保本周期到期后，本基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有基金份额；
（4）保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。
六、不适用保本条款的情形
1、在保本周期到期日，基金份额持有人认购、或过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和不低于其保本金额；
2、基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额；
3、基金份额持有人认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出的基金份额；
4、在保本周期内发生基金合同规定的基金合同终止的情形；
5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
6、在保本周期到期日之后（不包括该日）基金份额发生的任何形式的净值减少；
7、因不可抗力等原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的。
七、基金保本的保证
一、基金保本的保证
本节所述基金保本的保证责任仅适用于第一个保本周期。就第一个保本周期而言，本基金的担保人为深圳市高新投集团有限公司或《基金合同》规定的其他机构，担保人为本基金保本提供不可撤销的连带责任保证，保证范围为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于认购保本金额的差额部分，保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。
自第二个保本周期起的后续各保本周期的保本保障机制，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的《保证合同》或《风险买断合同》决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。
二、担保人基本情况
本基金第一个保本周期由深圳市高新投集团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。深圳市高新投集团有限公司有关信息如下：
名称：深圳市高新投集团有限公司
住所：深圳市深南大道7028号时代科技大厦22层、23层
办公地址：深圳市深南大道7028号时代科技大厦22层、23层
法定代表人：陶军
成立日期：1994年12月29日
组织形式：有限责任公司
注册资本：22亿元人民币
经营范围：从事担保业务；投资开发，信息咨询；贷款担保；自有物业租赁。
深圳市高新投集团有限公司成立于1994年12月，是国内最早设立的专业担保机构之一。集团目前注册资本22亿元人民币，股东为深圳市投资控股有限公司、深圳市财政金融服务中心、深圳市远致投资有限公司和深圳市中小企业服务中心，2015年8月完成新增注册资本26.5亿元，目前正在进行工商变更。核心业务：保证担保、融资担保、金融产品担保、创业投资。截至2015年8月31日，深圳市高新投集团有限公司合并报表总资产76.5亿元人民币，净资产36.9亿元人民币。
（三）担保人对外提供担保的情况
截至2015年8月31日， 深圳市高新投集团有限公司对外担保规模为469.2亿元人民币，其中融资担保51亿元、保证担保336.7亿元，保本基金68.7亿元。
四、担保人出具《长城久鼎保本混合型证券投资基金保证合同》（全文详见附件）。基金份额持有人购买基金份额的行为视为同意该《保证合同》的约定。本基金保本由担保人提供不可撤销的连带责任保证；对基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的保证范围为保本赔付差额，即在保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额的差额部分。
担保人保证期间为基金保本周期到期日起六个月止。
担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。
担保人的保证责任以《保证合同》为准。基金管理人应当保证《基金合同》中的相关内容的约定与《保证合同》的约定相符。
五、保本周期内，担保人出现足以影响其履行《保证合同》项下保证责任能力情形的，应在该情形发生之日起3个工作日内通知基金管理人。基金管理人在接到通知之日起3个工作日内通知基金托管人并应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，并在接到通知之日起5个工作日内在指定媒介上公告上述情形。当确定担保人已丧失履行《保证合同》项下保证责任能力或宣告破产的情况下，基金管理人应在接到通知之日起60日内召集基金份额持有人大会，就如下事项进行表决：
1、更换担保人；
2、变更基金类别；
3、《基金合同》终止；
4、法律法规或中国证监会规定的其他事项。
六、保本周期内更换担保人必须经基金份额持有人大会决议通过，并且担保人的更换必须符合基金份额持有人的利益。
保本周期内更换担保人的程序：
1、提名
新任担保人由基金管理人提名。
基金管理人提名的新任担保人必须符合如下条件：（1） 具有法律法规和中国证监会规定的担任基金担保人的资质和条件；（2）符合基金份额持有人的利益。
2、决议
基金份额持有人大会对被提名的新任担保人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的1/2以上（含1/2）表决通过。
3、备案
基金份额持有人大会选任新任担保人的决议自表决通过之日起生效，并自表决通过之日起5日内报中国证监会备案。
4、签订《保证合同》
在更换担保人的基金份额持有人大会决议生效后，基金管理人与新任担保人签订《保证合同》。
5、公告
基金管理人在更换担保人的基金份额持有人大会决议生效后2日内在至少一家指定媒介及基金管理人网站公告更换担保人的有关事项以及基金管理人与新任担保人签订的《保证合同》。
6、交接
原担保人职责终止的，原担保人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任担保人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任担保人应及时接收。
保本周期内更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担。在新任担保人接任之前，原担保人应继续承担保证责任。
七、如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》(应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息)。
担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该等代偿款项支付给基金份额持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。
基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日（含第20个工作日）内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。
如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人及担保人未履行《基金合同》及《保证合同》上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期后第21个工作日起，基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十四部分“争议的处理和适用的法律”约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。
八、除本部分第六款所指的“更换担保人的，原担保人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的担保人承担”以及下列除外责任情形外，担保人不得免除保证责任：
下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：
1、在保本周期到期日，按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其认购并持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的认购保本金额；
2、基金份额持有人认购，但在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出本基金的基金份额；
3、基金份额持有人在保本周期内申购或转换入的基金份额；
4、在保本周期内发生《基金合同》规定的《基金合同》终止的情形；
5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；
7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》规定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；
8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。
九、保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金继续存续并进入下一保本周期；否则，本基金变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，担保人不再为该混合型基金承担保证责任。
十、担保费由基金管理人从基金管理费收入中列支。
担保费支付方式：担保费从管理人收取的本基金管理费中列支，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。管理人应于每月收到基金管理费之后的五个工作日内向担保人支付担保费。担保人收到款项后的五个工作日内向管理人出具合法发票。
每日担保费计算公式＝担保费计算日前一日基金资产净值×1.8%×1/当年日历天数。
担保费计算期间自《基金合同》生效之日起，至担保人解除保证责任之日或保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。
十一、《保证合同》的主要内容
担保人就本基金的第一个保本周期内基金管理人对基金份额持有人认购并持有到期的基金份额所承担保本义务的履行提供不可撤销的连带责任保证。担保人保证责任的承担以本《保证合同》为准。
《保证合同》的当事人包括基金管理人、担保人和基金份额持有人。基金投资人自依《基金合同》取得基金份额，即成为基金份额持有人和《保证合同》的当事人，其购买基金份额的行为本身即表明其对《保证合同》的承认、接受和同意。
除非本《保证合同》另有约定，本《保证合同》所使用的词语或简称与其在《基金合同》中的释义部分具有相同含义。
1、保证的范围和最高限额
（1）本基金为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额提供的保本金额（即认购保本金额）为：认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。
（2）担保人承担保证责任的金额即保证范围为：保本周期到期日，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于其认购保本金额的差额部分（该差额部分即为保本赔付差额）。
（3）基金份额持有人申购或转换入，以及基金份额持有人认购，但在保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出部分不在保证范围之内，且担保人承担保证责任的最高限额不超过按《基金合同》生效之日确认的基金份额所计算的认购保本金额。
（4）保本周期到期日是指本基金保本周期（如无特别指明，保证合同所指保本周期即为本基金第一个保本周期）届满的最后一日。本基金的保本周期为3年，自《基金合同》生效之日起至3个公历年后对应日止，如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。但在保本周期内，如果基金份额累计净值收益率连续15个工作日达到或超过保本周期目标收益率，则管理人将在基金份额累计净值收益率连续达到或超过保本周期目标收益率的第15个工作日当日起10个工作日内公告本基金当前保本周期提前到期。如果保本周期提前到期，保本周期到期日为管理人公告的保本周期提前到期日，但不得晚于《基金合同》生效之日起3个公历年后的对应日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）。
2、保证期间
保证期间为基金保本周期到期日起六个月。
3、保证的方式
在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。
4、责任分担及清偿程序
（1）如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与认购并持有到期的基金份额在当前保本周期内的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》（应当载明基金管理人应向基金份额持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息）。
（2）担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该代偿款项支付给基金份额持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中后即为全部履行了保证责任，担保人无须对基金份额持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。
（3）基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日（含第20个工作日）内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。
（4）如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额与相应基金份额在当前保本周期内的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人及担保人未履行《基金合同》及《保证合同》上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自保本周期到期日后第21个工作日起，基金份额持有人可以根据《基金合同》第二十四部分“争议的处理和适用的法律”约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但基金份额持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。
5、适用法律及争议解决方式
本《保证合同》适用中华人民共和国法律。发生争议时，各方应通过协商解决；协商不成的，任何一方均可向中国国际经济贸易仲裁委员会提起仲裁，仲裁地点为北京，且仲裁裁决为终局，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。
八、保本周期到期
一、保本周期到期后基金的存续形式
保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金继续存续并进入下一保本周期，该保本周期的具体起讫日期以本基金管理人届时公告为准；如保本周期到期后，本基金未能符合上述保本基金存续条件，则本基金将按《基金合同》的约定，变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。上述变更由基金管理人和基金托管人同意后，可不经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，依照《信息披露办法》的有关规定提前在临时公告或更新的基金招募说明书中予以说明。
如果本基金不符合法律法规和基金合同对基金的存续要求，则本基金将根据基金合同的规定终止。
二、保本周期到期的处理规则
1、本基金的保本周期到期操作期间为保本周期到期日及之后3个工作日（含第3个工作日）。
2、在本基金保本周期到期操作期间，基金份额持有人可以做出如下选择：
（1）赎回基金份额；（2）将基金份额转换为基金管理人管理的其他基金；
（3）基金符合保本基金存续条件，基金份额持有人持有的基金份额根据届时基金管理人的公告转入下一保本周期；
（4）本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。
3、基金份额持有人可将其持有的所有基金份额选择上述四种处理方式之一，也可以部分选择赎回、转换转出、转入下一保本周期或继续持有变更后基金的基金份额。
4、无论持有人采取何种方式作出到期选择，均无需就其认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在保本周期到期操作期间的赎回和转换支付赎回费用和转换费用等交易费用。转换为基金管理人管理的其他基金或转为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”后的其他费用，适用其所转入基金的费用、费率体系。
5、本基金保本周期到期后，如基金份额持有人没有作出到期选择，本基金符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人继续持有本基金基金份额；如基金份额持有人没有作出到期选择，本基金不符合保本基金存续条件，则基金管理人将默认基金份额持有人选择了继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额。
6、为了保障持有到期的基金份额持有人的利益，基金管理人可在保本周期到期前30个工作日内视情况暂停本基金的日常申购和转换业务。
7、在保本周期到期操作期间，本基金将暂停办理申购和转换入业务。
8、基金赎回或转换转出采取“未知价”原则，即赎回价格或转换转出的价格以申请当日收市后本基金基金份额净值计算。
9、在保本周期到期操作期间，除暂时无法变现的基金财产外，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。
三、保本周期到期的保本条款
1、认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人，无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、还是转入下一保本周期或继续持有变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额，其基金份额都适用保本条款。
2、若认购、或过渡期申购、或从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额持有人选择在持有到期后赎回基金份额、转换到基金管理人管理的其他开放式基金，或者选择或默认选择继续持有进入下一保本周期或变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”基金份额，基金管理人均应按照本基金合同的约定履行保本义务，担保人应按照《保证合同》的约定提供不可撤销的连带责任保证。
3、无论采取何种方式作出到期选择，持有人将自行承担保本周期到期日后（不含保本周期到期日）的基金份额净值波动风险。
四、本基金转入下一保本周期的方案
保本周期届满时，基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，与基金管理人就本基金下一保本周期签订《保证合同》或《风险买断合同》，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金继续存续并进入下一保本周期。
1、过渡期
到期操作期间截止日次日起（含该日）至下一保本周期开始日前一工作日的期间为过渡期；过渡期最长不超过30个工作日。具体日期由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。
2、过渡期申购
（1）基金管理人将根据担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度确定并公告本基金过渡期申购规模上限以及规模控制的方法。
（2）过渡期申购采取“未知价”原则，即过渡期申购价格以申请当日收市后计算的本基金基金份额净值为基准进行计算。
（3）对于过渡期申购的基金份额，基金份额持有人将自行承担过渡期申购之日至过渡期最后一日（含该日）期间的基金份额净值波动风险。
（4）过渡期申购费率
过渡期申购具体费率在届时的《招募说明书》中列示。
过渡期申购费用由过渡期申购的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
（5）过渡期申购的日期、时间、场所、方式和程序等事宜由基金管理人确定并提前公告。
（6）在保本周期到期操作期间截止日，如果基金份额持有人选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额所对应的资产净值不低于本基金担保人或者保本义务人提供的下一保本周期保证额度或保本偿付额度上限，则本基金不设立过渡期申购。
（7）过渡期内，基金管理人应使基金财产保持为现金形式，基金管理人和基金托管人免收该期间的基金管理费和基金托管费。
3、下一保本周期基金资产的形成
（1）选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额
基金份额持有人在上一个保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的， 按其选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额在折算日所对应的资产净值确认下一个保本周期的保本金额并适用下一个保本周期的保本条款。
（2）过渡期申购的基金份额
投资者在过渡期内申购本基金基金份额的， 按其申购的基金份额在折算日所代表的或赎回金额确认下一个保本周期的保本金额并适用下一个保本周期的保本条款。
4、基金份额折算
过渡期最后一个工作日（即下一保本周期开始日前一工作日）为基金份额折算日。
在基金份额折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资者过渡期申购的基金份额、保本周期结束后选择或默认选择转入下一个保本周期的基金份额持有人所持有的基金份额）在其所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为1.00元的基金份额，基金份额数额按折算比例相应调整。
在基金份额持有人赎回基金份额时，持有期的计算仍以投资者认购、申购、转换转入或者过渡期申购基金份额的实际操作日期计算，不受基金份额折算的影响。
5、开始下一保本周期运作
折算日的下一个工作日为下一保本周期开始日，本基金进入下一保本周期运作。
基金份额持有人在当期保本周期的到期操作期间选择或默认选择转入下一保本周期的基金份额以及过渡期申购的基金份额，经基金份额折算后，适用下一保本周期的保本条款。
本基金进入下一保本周期后，仍使用原名称和基金代码办理日常申购、赎回等业务。
自本基金下一保本周期开始后，本基金管理人将暂停本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、基金转换等业务。暂停期限最长不超过3个月。
投资者在下一保本周期开始后的开放日申购或转换转入本基金基金份额的，相应基金份额不适用下一保本周期的保本条款。
五、转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”资产的形成
保本周期届满时，若不符合保本基金存续条件，本基金变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”。
1、如果保本周期到期日基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红金额之和低于认购保本金额，基金管理人或担保人应补足该差额（差额部分即为保本赔付差额），并将该差额计入基金份额持有人。
2、对于投资者在本基金募集期内认购的基金份额、保本周期内申购或转换转入的基金份额，选择或默认选择转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的，转入金额等于选择或默认选择转为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的基金份额在“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”基金合同生效日前一个工作日所对应的基金资产净值。
3、变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”申购的具体操作办法由基金管理人提前予以公告。
六、保本周期到期的公告
1、保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金将继续存续。基金管理人应依照相关法律法规的规定就本基金继续存续及转入下一保本周期相关事宜进行公告。
2、保本周期届满时，在不符合保本基金存续条件下，本基金将变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，基金管理人将在临时公告或“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”的招募说明书中公告相关规则。
3、在保本周期到期前，基金管理人还将进行提示性公告。
七、保本周期到期的赔付
1、在发生保本赔付的情况下，基金管理人在保本周期到期日后二十个工作日内向基金份额持有人履行保本差额的支付义务。基金管理人不能全额履行保本差额支付义务的，基金管理人应于保本周期到期日后五个工作日内向担保人发出《履行保证责任通知书》，担保人收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后五个工作日内，将需代偿的金额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中。
基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日内将保本赔付差额支付给基金份额持有人。
2、保本赔付资金到账后，基金管理人应按照《基金合同》的约定进行分配和支付。
3、发生保本赔付的具体操作细则由基金管理人提前公告。
九、基金的投资目标
（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资目标为：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。
（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资目标为：本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济增长中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。
十、基金的投资范围
（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资范围为：
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、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固定收益类资产和风险资产，其中固定收益类资产为国内依法公开发行的各类债券（包括国债、金融债、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、分离交易可转债的纯债部分等）、银行存款等；风险资产为股票、权证和中小企业私募债券等。
本基金按照CPPI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、银行存款等固定收益类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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
如法律法规或监管机构以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。
（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资范围为：
本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、银行存款、货币市场工具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，但须符合中国证监会的相关规定。
本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
如法律法规或监管机构以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。
十一、基金的投资策略
（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的投资策略为：
本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在固定收益类资产和风险资产之间的大类资产配置策略；另一层为固定收益类资产投资策略和风险资产投资策略。
1.大类资产配置策略
本基金采用固定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称为“CPPI”）建立和运用严格的动态资产配置数量模型，动态调整固定收益类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。
CPPI投资策略的基本步骤可分为以下三步：
第一步，利用CPPI模型，根据保本周期末投资组合最低目标价值（本基金的最低保本值为保本金额的100%）和合理的贴现率，确定基金当期投资于固定收益类资产的最小比例，即投资组合的安全底线。



2）风险乘数M值的调整方式和投资决策流程
根据CPPI投资策略，在风险乘数M值保持固定时，根据投资组合资产净值的变化，本基金需要动态调整固定收益类资产、风险资产的比例。当市场波动较大时，为维持固定风险乘数M值，频繁的资产调整将给基金带来较高的交易成本；另一方面，预期未来市场环境将发生较大变化时，固定风险乘数M值可能会限制资产的灵活调整。
因此，本基金对于风险乘数M值采用定期调整与特殊情形下灵活调整相结合的方式。一般地，本基金根据研究部每月提交的投资策略报告，拟定下月风险乘数M值范围报投资决策委员会审批，之后根据投资决策委员会的决议，在风险乘数M值范围内进行灵活调整。另一方面，若已发生或预期将发生引起市场波动率急剧加大的事件，本基金亦将对风险乘数M值进行及时的调整。
风险乘数M值的投资决策流程分为以下三步：
第一步，研究部金融工程小组、宏观策略小组对宏观经济、证券市场从定量、定性两个方面进行分析，其中，定量分析是预测分析市场波动率等参数；定性分析包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况等分析。研究部为本基金提出投资策略报告，基金经理以此作为风险乘数M值的投资决策依据；对于可能对证券市场造成重大影响的突发事件，研究部及时提出投资建议。
第二步，基金经理参考研究部提交的投资策略报告，拟定基金风险乘数M值范围报投资决策委员会审批。
第三步，投资决策委员会对基金经理上报的风险乘数M值范围配置提案召开投资决策会议，投资决策委员会通过会议决议后，以书面形式下达给基金经理，由基金经理具体实施。
为控制风险，在投资管理过程中，本基金规定风险乘数M值不超过3。
2. 固定收益类资产投资策略
（1）债券投资策略
本基金债券的收益主要来源于久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择、跨市场套利以及把握市场低效或失效情况下的交易机会，主要包括以下几个方面：
1）久期管理策略
本基金建立了债券分析框架和量化模型，通过预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。
本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机组分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定资产组合的平均久期。
2）收益率曲线策略
本基金将在确定资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配置原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。
3）个券选择策略
本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。
在个券基本面分析方面，本基金重点关注：信用评级良好的个券，预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面，本投资组合将重点关注估值合理的个券，信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券，经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。
4）跨市场套利
跨市场套利是指基金管理人从债券各子市场所具有的不同运行规律、不同参与主体和不同风险收益特征的差异中发掘套利机会，从而进一步增强债券组合的投资回报。本基金将在确定套利机会可行性的基础上，寻找合适的介入时机，进行一定的跨市场套利。
5）把握市场低效或失效状况下的交易机会
在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。
A.新券发行溢价策略
在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。
B.信用利差策略
不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，从而出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。
（2）可转换债券投资策略
当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。
（3）债券回购杠杆策略
本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求债券资产的超额收益。
3.风险资产投资策略
（1）股票投资策略
本基金股票重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业。根据CPPI策略，在股票投资限额之下，发挥基金管理人主动选股能力，控制股票资产下行风险，分享股票市场成长收益。
股票选择方面，本基金将充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，选择具备外延式扩张能力的优势上市公司，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，同时通过选择流动性高、风险低、具备中期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，动态优化股票投资组合，控制流动性风险和集中性风险，保证股票组合的稳定性和收益性。
（2）新股申购策略
本基金将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要是从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平，预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。
（3）权证投资策略
本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。
（4）中小企业私募债券投资策略
1）根据宏观经济环境及各行业的发展状况，优先投资于选择盈利能力稳定、经济周期波动性较弱行业中的企业，并根据行业特征、所处阶段等因素对于不同行业进行排序；
2）研究债券发行人的产业状况、市场竞争格局、行业政策、盈利能力、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，综合评价公司的长期竞争能力和运作风险；
3）运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流状况等方面进行综合评价，合理评估发行人财务风险；
4）利用债券和可获取的信贷历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率，根据债券相关条款和可类比实际投资的回收情况，估算该债券的违约损失率；
5）债券评级的具体要求债券主体评级BBB+以上（含），债项评级AA以上（含），同时考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；
6）综合发行人各方面分析结果，确定合理的信用利差水平，利用市场的相对失衡，选择溢价偏高、性价比较优的私募债品种进行投资。
基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的投资策略为：
1、大类资产配置策略
在大类资产配置中，本基金将采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险及提高基金收益的目的。
2、行业配置策略
本基金在行业配置上，采用“投资时钟理论”，对于经济周期景气进行预判，并按照行业轮动的规律进行行业配置。通过对于经济增速、通货膨胀率、以及其他宏观经济指标的分析，可以将经济周期大致划分入复苏、增长、萧条、衰退四个阶段。对应不同的阶段，不同的阶段，配置不同的大类资产及不同的行业，将取得不同的收益，并能够呈现出一定的规律性。
在衰退阶段，大多数行业的产能过剩将通货膨胀率冲击至很低位置，需求不足导致经济增速较低，企业盈利能力下降。中央银行将通过降低利率的方式来刺激经济，在这一阶段，债券将是最佳的投资类别，股票市场上，防御性的成长性行业，如消费品行业，相对较好；
在复苏阶段，随着衰退期的政策刺激，低利率逐渐刺激需求，企业利润企稳反弹，通货膨胀率低位温和反弹，经济一片欣欣向荣。此时，周期性成长行业为最佳投资类别。
随着需求的继续反弹，经济增速强劲，通货膨胀率将攀上高位，利率被动抬升，周期轮动进入增长期，强周期性行业如建筑、石油石化、房地产等行业表现较好。
为了抑制经济过热走势，利率将成为主要调控手段，企业盈利见顶，高通胀与低增长将逐步到来，此时，全行业承担着高利率带来的负担，现金是最佳投资标的，股票市场中，相对必需的消费品以及价值型行业，相对较好。
3、个股投资策略
在个股选择上，基金管理人将优选具备核心竞争力并估值合理的优势个股。主要评价维度包括：
（1）公司主营业务具备核心竞争力，核心优势突出。公司在细分行业中处于龙头位置，具备核心竞争力，比如垄断的资源优势、独特的商业模式、稳定的销售网络、卓越的品牌影响力等；
（2）公司处于快速成长期，收入、利润连续快速增长；同时从盈利模式、公司治理、人员稳定性、创新能力等多角度来分析其成长性的持续能力；
（3）个股的估值优势。针对处于不同成长阶段、不同行业的公司，运用不同的估值方法进行评估，挖掘具备安全边际的个股。
4、债券投资策略
当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。
（1）久期管理策略
本基金建立了债券分析框架和量化模型，通过预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久期，实现久期管理。
本基金将债券市场视为金融市场整体的一个有机部分，通过“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定资产组合的平均久期。当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期组合或缩短现有债券资产组合的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期组合或增加现有债券资产组合的平均久期。
债券资产投资建立的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标有GDP、CPI、PPI、固定资产投资、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量M1/M2、新增贷款、新增存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用以分析央行的货币政策，以判断市场利率变动方向；另一方面，央行货币政策对金融机构的资金流也将带来明显的影响，从而引起债券需求变动。本基金在对市场利率变动和债券需求变动进行充分分析的基础上，选择建立和调整最优久期债券资产组合。
（2）收益率曲线策略
本基金将在确定资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。
（3）个券选择策略
本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。
在个券基本面分析方面，本基金重点关注：信用评级良好的个券，预期信用评级上升的个券和具有某些特殊优势条款的个券。在个券估值方面，本投资组合将重点关注估值合理的个券，信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券，经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。
（4）跨市场套利
跨市场套利是指基金管理人从债券各子市场所具有的不同运行规律、不同参与主体和不同风险收益特征的差异中发掘套利机会，从而进一步增强债券组合的投资回报。
我国债券市场目前由交易所市场和银行间市场构成。由于其中投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场在资金面、利率期限结构、流动性等方面都存在着一定的差别。本基金将在确定套利机会可行性的基础上，寻找合适的介入时机，进行一定的跨市场套利。
（5）把握市场低效或失效状况下的交易机会
在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。
1）新券发行溢价策略
在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。
2）信用利差策略
不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，从而出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。
5、现金管理
本基金将利用银行存款、回购和短期政府债券等短期金融工具进行有效的现金流管理，在满足赎回要求的前提下，有效地在现金、回购及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具之间进行灵活配置。
6、权证投资策略
本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益，以不改变投资组合的风险收益特征为首要条件，运用有关数量模型进行估值和风险评估，谨慎投资。
此外，本基金还将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。本基金组合的新股申购（含增发新股）策略主要是从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择新股申购的参与标的、参与规模和新股的卖出时机。通过深入分析新股上市公司的基本情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。
十二、基金的业绩比较基准
（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款税后收益率。
本基金选择3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准主要考虑如下：
（1）本基金是保本基金，通过第三方担保机制的引入和通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理，力争实现基金资产的稳定增值。，其主要目标客户为低风险偏好的客户，以3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准，符合本基金的产品定位和风险收益特征。
（2）本基金保本周期最长为3年，通过保本周期内高赎回费率的设置和随持有期限递减的赎回费率结构安排，鼓励长期持有、稳健投资。以3年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准与目标客户群的预期持有期限基本一致。
（3）3年期银行定期存款税后收益率容易被广大投资人所理解和接受。
综上所述，选择3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能比较贴切地体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。
如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，不需要召开基金份额持有人大会。
（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%＋中债总财富指数收益率×45%。
沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股，较好地反映了A股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中债总财富指数的编制采用了银行间债券市场结算数据、交易所债券的成交数据、债券柜台的双边报价、银行间债券市场的双边报价以及市场成员收益率的估值数据，并参考了中国债券市场中部分核心成员的收益率估值数据，以更好地反映市场收益率水平。中债总财富指数是目前市场上较权威的债券投资业绩比较基准。
本基金是混合型证券投资基金，股票投资范围为0-95%，债券等资产投资范围为0-95%。本基金对沪深300指数和中债总财富指数分别赋予55%和45%的权重符合本基金的投资特性。
如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。
十三、基金的风险收益特征
（一）本基金在当期保本周期内或保本周期到期后转入下一个保本周期，基金的风险收益特征为：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。
（二）若本基金保本周期到期后变更为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则基金的风险收益特征为：本基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，为中高风险、中高收益的基金产品。
十四、投资组合报告
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2018年8月9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。
本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。
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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,954,519,000.00	89.28
	其中：债券	1,954,519,000.00	89.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	165,500,000.00	7.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	51,507,780.56	2.35
8	其他资产	17,789,817.36	0.81
9	合计	2,189,316,597.92	100.00

2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合
注：本基金本报告期末未持有股票投资。
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
注：本基金本报告期末未持有股票投资。
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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	495,685,000.00	22.76
	其中：政策性金融债	495,685,000.00	22.76
4	企业债券	177,402,000.00	8.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,281,432,000.00	58.84
9	其他	-	-
10	合计	1,954,519,000.00	89.75

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	160420	16农发20	3,500,000	346,640,000.00	15.92
2	111811175	18平安银行CD175	1,600,000	156,832,000.00	7.20
2	111817132	18光大银行CD132	1,600,000	156,832,000.00	7.20
3	111806143	18交通银行CD143	1,500,000	148,560,000.00	6.82
4	111809153	18浦发银行CD153	1,500,000	148,545,000.00	6.82
4	111810244	18兴业银行CD244	1,500,000	148,545,000.00	6.82
4	111818131	18华夏银行CD131	1,500,000	148,545,000.00	6.82
5	111897821	18宁波银行CD092	1,300,000	128,713,000.00	5.91

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。
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。
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。
9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
（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进行股指期货投资，期末未持有股指期货。
（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。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
（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。
（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。
（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。
11、投资组合报告附注
（1）本报告期本基金投资的前十名证券除浦发银行、兴业银行、宁波银行三家发行主体外，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。
根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）于2018年5月4日公布的行政处罚信息公开表：
上海浦东发展银行股份有限公司（简称浦发银行）因内控管理不严、违规经营等案由，于2018年2月12日被中国银监会处以罚款；
兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因内控管理不严、违规经营等案由，于2018年4月19日被银保监会处以罚款；
根据宁波银监局于2018年6月22日公布的行政处罚信息公开表，宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因违规经营于2018年6月7日被宁波银监局处以罚款。
本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。同时，本基金持有的上述银行同业存单评级良好、流动性充裕。该行政处罚措施不影响公司的长期信用基本面，主体信用和债项信用资质均良好。本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对18浦发银行CD153、18兴业银行CD244、18宁波银行CD092进行了投资。
（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的股票。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	194,852.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,594,964.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,789,817.36

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
（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。
十五、基金的业绩
过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较（截至2018年6月30日）

时间段	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
基金合同生效日（2016年7月21日）至2016年12月31日	-0.30%	0.06%	1.24%	0.01%	-1.54%	0.05%
2017年1月1日至2017年12月31日	3.61%	0.09%	2.75%	0.01%	0.86%	0.08%
2018年1月1日至2018年6月30日	0.88%	0.18%	1.36%	0.01%	-0.48%	0.17%
基金合同生效日（2016年7月21日）至2018年6月30日	4.21%	0.11%	5.35%	0.01%	-1.14%	0.10%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。
十六、基金费用概览
一、与基金运作有关的费用
（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。
若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转型为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。
基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.2%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转型为“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，则托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。
基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
在保本周期到期操作期间和过渡期间，基金管理人和基金托管人免收本基金的管理费和托管费。
上述“一、基金费用的种类中第3-7项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
二、与基金销售有关的费用
（一）申购费用
本基金在申购时收取申购费用，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。
本基金对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：
1、申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.2%
100万元(含)－300万元	0.8%
300万元(含)－500万元	0.4%
500万元以上(含)	每笔1000元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。
2、特定申购费率

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	0.24%
100万元(含)－300万元	0.16%
300万元(含)－500万元	0.08%
500万元以上(含)	每笔1000元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。
如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。
本基金申购费由申购者承担，不列入基金财产。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，申购费率最高不超过5%，具体费率以届时公告为准。
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中，
净申购金额＝申购金额/（1＋申购费率），对于500万元（含）以上的申购，净申购金额＝申购金额－固定申购费金额
申购费用＝申购金额－净申购金额
申购份数＝净申购金额/T日基金份额净值
例：投资者申购本基金100,000元，T日基金份额净值为1.1500元，其获得的基金份额计算如下：
净申购金额＝100,000/（1＋1.2%）＝98,814.23元
申购费用＝100,000－98,814.23＝1,185.77元
申购份数＝98,814.23/1.1500＝85,925.42份
即投资者缴纳申购款100,000元，获得85,925.42份本基金的基金份额。
（二）赎回费用
本基金的赎回费用按持有时间的增加而递减，费率如下：

持有期限	赎回费率
1年以内	2.0%
1年（含）－2年	1.5%
2年（含）－3年	1.0%
3年（含）以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30天的基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30天(含)但少于90天的基金份额所收取的赎回费的75%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于90天(含)但少于180天的基金份额所收取的赎回费的50%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费；对持续持有期长于180天(含)的基金份额所收取的赎回费的25%计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。
若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，转为变更后的“长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金”，赎回费率最高不超过5%，具体费率以届时公告为准。
本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，
赎回总金额＝赎回份数×赎回当日基金份额净值
赎回手续费＝赎回总金额×赎回费率
净赎回金额＝赎回总金额－赎回手续费
例：假定T日本基金的基金份额净值为1.3250元，投资者赎回其持有的100,000份基金份额，持有期10个月，则：
赎回总额＝100,000×1.3250＝132,500元
赎回费用＝132,500×2.0%＝2,650元
赎回金额＝132,500－2,650＝129,850元
即投资者赎回其持有的100,000份本基金的基金份额，获得赎回金额129,850元。
（三）转换费用
1、基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。
转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。
（1）如转入基金的申购费率＞转出基金的申购费率
转出金额＝转出基金份额×转出基金当日基金份额净值
转出基金赎回费＝转出金额×转出基金赎回费率
转入总金额＝转出金额－转出基金赎回费
转入基金申购费补差费率＝转入基金适用申购费率－转出基金适用申购费率
转入基金申购费补差＝转入总金额－转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)
转入净金额＝转入总金额－转入基金申购费补差
转入份额＝转入净金额/转入基金当日基金份额净值
基金转换费＝转出基金赎回费＋转入基金申购费补差
例：某投资者将持有的长城货币市场证券投资基金10万份基金份额转换为本基金，假设转换当日转入基金（本基金）份额净值是1.0500元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）对应赎回费率为0，申购费补差费率为1.2%，则可得到的转换份额及基金转换费为：
转出金额＝100,000×1＝100,000 元
转出基金赎回费＝0
转入总金额＝100,000－0＝100,000元
转入基金申购费补差＝100,000－100,000/(1+1.2%)＝1,185.77元
转入净金额＝100,000－1,185.77＝98,814.23元
转入份额＝98,814.23/1.0500＝94,108.79份
基金转换费＝0+1,185.77＝1,185.77元
（2）如转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率
基金转换费＝转出金额×转出基金赎回费率
例：某投资者持有本基金10万份基金份额，持有满2年，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日转出基金（本基金）份额净值是1.1500元，转出基金对应赎回费率为1.0%，申购补差费率为0，则可得到的转换份额及基金转换费为：
转出金额＝100,000×1.1500＝115,000元
转出基金赎回费＝115,000×1.0%＝1,150元
转入总金额＝115,000－1,150＝113,850元
转入基金申购费补差＝0
转入净金额＝113,850－0＝113,850元
转入份额＝113,850/1＝113,850份
基金转换费＝115,000×1.0%＝1,150元
2、对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入基金对应转出基金申购费率或转入基金申购费率为固定费用时，申购补差费用视为0。
3、转出基金赎回费的25%计入转出基金资产（基金合同或招募说明书另有规定的除外）。
4、计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。
（四）基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前3个工作日在至少一种指定媒介公告。
（五）基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。
三、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
四、费用调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒介上公告。
五、基金税收
基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。
十七、对招募说明书更新部分的说明
本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城久鼎保本混合型证券投资基金基金合同》的要求，并结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2018年3月6日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：
1、在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
2、在第一部分“绪言”中，增加了《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）。
3、在第二部分“释义”中，增加了《流动性风险规定》、流动性受限资产、摆动定价机制的内容。
4、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况、基金管理人的内部控制制度。
5、在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。
6、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构的信息。
7、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了申购和赎回的数额限制、申购和赎回的费用、申购份额与赎回金额的计算、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的情形及处理方式、基金的转换和定期定额投资的内容。
8、在第八部分“基金的保本”中，更新了保本案例的内容。
9、在第十一部分“基金的投资”中，更新了投资范围、投资限制的内容；更新了投资组合报告内容，披露截至2018年6月30日的数据。
10、在第十二部分“基金的业绩”中，披露了截至2018年6月30日本基金的业绩数据。
11、在第十四部分“基金资产的估值”中，更新了估值方法、估值程序、估值错误的处理、暂停估值的情形的内容。
12、在第十五部分“基金的费用与税收”中，更新了与基金销售有关的费用的内容。
13、在第十八部分“基金的信息披露”中，更新了公开披露的基金信息的内容。
14、在第二十二部分“基金托管协议的内容摘要”中，更新了托管协议当事人的信息、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查的内容、基金资产净值计算与复核的内容。
15、在第二十四部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司
2018年9月1日