

## 长城积极增利债券型证券投资基金

## [2015] 第二季度报告

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  
报告送达日期:2015年7月21日

§ 1 重要提示  
本基金的基金管理人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。  
本基金的基金管理人和托管人根据有关法规的要求编制和披露基金合同规定，于2015年07月17日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，确认不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本基金的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。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。  
本报告期自2015年04月01日起至06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长城积极增利债券
基金主代码	200013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月12日
报告期末基金份额总额	1,216,599,654.19份

本基金将控制组合风险和保持资产流动性的前提下，为获得超越比较基准的收益，实现基金资产的长期增长。

本基金将采用“自上而下”和“自下而上”的策略进行基金的大类资产配置，通过分析宏观经济指标、政策、货币政策、利率品种供求关系、资金需求关系、主动管理市场利差收益率，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及资产配置。

业绩比较基准 中债综合总指数

本基金的债券投资策略，其长期平均风险和预期收益水平，略高于货币市场基金。本基金为债券型基金，其风险收益特征属中低风险、中低收益的基金产品。

基金管理人 长城基金管理有限公司

基金托管人 中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

长城积极增利债券A 长城积极增利债券C

下属分级基金的交易代码

200013 200113

报告期末下属分级基金的份额总额

913,516,664.27份 303,080,989.92份

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

长城积极增利债券A 长城积极增利债券C

1. 本期已实现收益 67,416,492.47 21,293,443.72

2. 本期利润 85,974,231.53 27,790,467.55

3. 加权平均基金份额本期利润 0.0812 0.0805

4. 期末基金资产净值 1,159,440,430.66 376,916,400.65

5. 期末基金份额净值 1.268 1.244

注:①本期利润=收入-费用；②本期已实现收益扣除非经常性损益后的金额；③其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，未剔除申购、赎回费用；④本期利润不包括持有人交易基金时产生的申购、赎回费用。

⑤上述基金业报酬不包括持有人交易基金时的各项费用，计算时采用最近收益法；⑥本期利润以绝对数表示。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金期初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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 6.64% 0.58% 2.35% 0.10% 4.29% 0.48%

3.2.2 本基金成立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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 6.60% 0.58% 2.35% 0.10% 4.25% 0.48%

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 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 矿采业 - -

C 制造业 69,425.00 0.00

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 13,410.00 0.00

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 3,339,720.72 0.22

J 金融业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

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 3,442,845.72 0.22

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 601929 信达地产 220,881 3,339,720.72 0.22

2 300470 机器人 500 47,575.00 0.00

3 002776 潘东龙 500 20,290.00 0.00

4 300475 康耐特 500 15,415.00 0.00

5 002775 文利通 500 13,410.00 0.00

6 300486 东芝电梯 500 6,435.00 0.00

7 - - - -

8 - - - -

9 - - - -

10 - - - -

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五名债券投资组合

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 63,861,362.50 4.16

2 央行票据 - -

3 金融债券 619,792,527.00 40.37

4 中政性金融债券 568,537,527.00 37.03

5 企业短期融资券 704,296,840.40 45.87

6 中期票据 165,786,000.00 10.80

7 可转债 - -

8 其他 - -

9 合计 1,553,736,737.90 101.20

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权证投资明细

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 130231 131731 1,600,000 159,328.0000 10.38

2 122357 1415承2 1,100,000 113,146.0000 7.37

3 140402 14农02 800,000 85,520.0000 5.57

4 122292 13农01 700,000 74,830.0000 4.87

5 1480237 14农公投 700,000 74,599.0000 4.86

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贵金属投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 中国黄金 300,252.42 -

2 四川黄金 清算款 - -

3 金投公司 36,935,011.38 -

4 金投公司 1,078,461.43 -

5 其他应收款项 - -

6 待摊费用 - -

7 其他 - -

8 其他 - -

9 合计 38,393,723.23 -

5.9 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股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 长城积极增利债券A 1,364,143,296.70 399,592,144.15

2 长城积极增利债券C 11,089,015.41 -

3 长城积极增利债券A 586,908,301.61 107,600,173.64

4 长城积极增利债券C - -

5 长城积极增利债券A 913,516,664.27 303,080,989.92

5.10 本期应支付的托管费

5.11 本期应支付的审计费

5.12 本期应支付的评估费

5.13 本期应支付的交易费

5.14 本期应支付的税金

5.15 本期应支付的手续费

5.16 本期应支付的佣金

5.17 本期应支付的利息

5.18 本期应支付的其他费用

5.19 本期应支付的其他费用

5.20 本期应支付的其他费用

5.21 本期应支付的其他费用

5.22 本期应支付的其他费用

5.23 本期应支付的其他费用

5.24 本期应支付的其他费用

5.25 本期应支付的其他费用

5.26 本期应支付的其他费用

5.27 本期应支付的其他费用

5.28 本期应支付的其他费用

5.29 本期应支付的其他费用

5.30 本期应支付的其他费用

5.31 本期应支付的其他费用

5.32 本期应支付的其他费用

5.33 本期应支付的其他费用

5.34 本期应支付的其他费用

5.35 本期应支付的其他费用

5.36 本期应支付的其他费用

5.37 本期应支付的其他费用

5.38 本期应支付的其他费用

5.39 本期应支付的其他费用

5.40 本期应支付的其他费用

5.41 本期应支付的其他费用

5.42 本期应支付的其他费用

5.43 本期应支付的其他费用

5.44 本期应支付的其他费用

5.45 本期应支付的其他费用

5.46 本期应支付的其他费用

5.47 本期应支付的其他费用

5.48 本期应支付的其他费用

5.49 本期应支付的其他费用

5.50 本期应支付的其他费用

5.51 本期应支付的其他费用

5.52 本期应支付的其他费用

5.53 本期应支付的其他费用

5.54 本期应支付的其他费用

5.55 本期应支付的其他费用

5.56 本期应支付的其他费用

5.57 本期应支付的其他费用