

## 长城久鑫保本混合型证券投资基金

## [2015] 第三季度报告

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  
报告送出日期：2015年10月26日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及高级管理人员保证本基金报告不存在虚假记载、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约定，于2015年10月21日核对了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，确认基金账户不存在虚假记载、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，在控制风险、保证本金安全的前提下为基金份额持有人谋取最大利益。  
基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人投资本基金前请仔细阅读本基金的招募说明书。  
本基金合同中关于费用的条款已经更新。

报告期截至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称：长城久鑫保本混合型证券投资基金

基金代码：000649

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2014年7月30日

报告期末基金份额总额：3,336,006,480.00份

投资目标：本基金将严格控制风险，在确保本期滚动到期本金安全的基础上，力争实现

资产的长期增值，同时一部分资金的按揭贷款和风险资产的投资。

业绩比较基准：3年定期存款利率+0.5%

风险收益特征：本基金为债券型基金，属于较低风险、低预期收益的基金品种，预期收益

和预期风险均低于股票型基金，但高于货币市场基金和一般债券基金。

基金经理：长城基金管理有限公司

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

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

1.本期三季报收益 20,539,540.05

2.本期利润 20,722,-3,369.00

3.加权平均基金份额利润率 0.0000%

4.期末基金份额净值 3,364,328.97/3.01

5.期末基金资产净值 1.00%

注：(1)本期已实现收益扣减本期利息收入、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)本期未考虑红利再投资的情况下，本基金的资产净值增长率低于基金净值的增长率。

2.2 基金净值表现

3.2.1 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

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)

阶段 净值增长(%) 累计净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 0.00% 0.17% 0.09% 0.01% -0.19% 0.16%

3.2.2 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

报告期(2014年7月30日 - 2015年9月30日)

阶段 净值增长(%) 累计净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%)  
① -③ ② -④

过去三个季度 10.00% 33.64% 10.00% 3.64%

过去一年 33.64% 33.64%

过去三年 33.64% 33.64%

3.2.3 报告期来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 000902 中国银行 500,000 456,479.20 0.01

2 000113 中国银行 200,000 87,966,000.00 0.26

3 000666 中国平安 1,500,000 7,357,000.00 0.02

4 002123 中国银行 500,000 6,279,000.00 0.02

5 601059 中国银行 500,000 5,425,000.00 0.02

6 002550 中国银行 300,000 5,270,000.00 0.02

7 601988 中国银行 100,000 5,220,000.00 0.02

8 300496 中国银行 115,076 3,643,141.44 0.01

9 000271 中国银行 200,000 3,530,000.00 0.01

10 合计 - 10,609,974.20 0.03

3.2.4 报告期来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 100002 国家债券 500,000 549,580,100.00 17.05

2 100001 国家债券 100,000 100,000.00 0.00

3 000006 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

4 000002 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

5 000003 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

6 000004 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

7 000005 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

8 000007 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

9 000008 中国银行 100,000 94,796,000.00 2.90

10 合计 1,500,000 1,349,480.00 4.11

3.2.5 报告期来按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

序号 代码 品种名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 04150209 150g足金 2,500.00 349,775,000.00 7.45

2 122399 150gAu 1,401,410 140,417,242.00 4.42

3 150013 100g足金 1,300,000 129,426,000.00 3.86

4 150416 100gAu 1,200,000 120,036,000.00 3.50

5 150417 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

6 150418 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

7 150419 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

8 150420 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

9 150421 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

10 合计 1,500,000 1,349,480.00 4.11

3.2.6 报告期来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 代码 品种名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 04150209 150g足金 2,500,000 349,775,000.00 7.45

2 122399 150gAu 1,401,410 140,417,242.00 4.42

3 150013 100g足金 1,300,000 129,426,000.00 3.86

4 150416 100gAu 1,200,000 120,036,000.00 3.50

5 150417 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

6 150418 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

7 150419 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

8 150420 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

9 150421 100gAu 1,10,000 11,364,490.00 3.32

10 合计 1,500,000 1,349,480.00 4.11

3.2.7 报告期来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组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 161,094,620.64 1.73

2 3,060,074,26,527 16.50

3,060,074,26,527 16.50

3 3,060,074,26,527 16.50

4 3,060,074,26,527 16.50

5 3,060,074,26,527 16.50

6 3,060,074,26,527 16.50

7 3,060,074,26,527 16.50

8 3,060,074,26,527 16.50

9 3,060,074,26,527 16.50

10 3,060,074,26,527 16.50

11 3,060,074,26,527 16.50

12 3,060,074,26,527 16.50

13 3,060,074,26,527 16.50

14 3,060,074,26,527 16.50

15 3,060,074,26,527 16.50

16 3,060,074,26,527 16.50

17 3,060,074,26,527 16.50

18 3,060,074,26,527 16.50

19 3,060,074,26,527 16.50

20 3,060,074,26,527 16.50

21 3,060,074,26,527 16.50

22 3,060,074,26,527 16.50

23 3,060,074,26,527 16.50

24 3,060,074,26,527 16.50

25 3,060,074,26,527 16.50

26 3,060,074,26,527 16.50

27 3,060,074,26,527 16.50

28 3,060,074,26,527 16.50

29 3,060,074,26,527 16.50

30 3,060,074,26,527 16.50

31 3,060,074,26,527 16.50

32 3,060,074,26,527 16.50

33 3,060,074,26,527 16.50

34