

长城久惠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

本基金管理人的董事会及基金经理对本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时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的规定，于2015年10月21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。

本基金通过报纸并以书面形式向公众披露。基金托管人通过报纸并以书面形式向公众披露。

基金的过往绩效并不代表未来的表现。投资者有风险，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。

报告书中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月27日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称：长城久惠保本混合型证券投资基金

基金简称：长城久惠保本

基金代码：001363

交易账户：001363

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2015年7月27日

报告期末基金份额总额：2,069,573,000份

投资目标：

本基金通过资产配置与风格轮动，在确保保本的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于80%，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%，其中股票或者权证占基金资产的比例不超过40%。

本基金的预期收益水平：低于预期收益类别的产品。

风险特征：本基金为保本型理财产品，属证券投资基金中的风险品种，相对收益较低，但风险相对较低，是适合家庭理财和一般保守型客户。

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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

报告期(2015年7月27日 - 2015年9月30日)

1.本期已实现收益 16,441,773.06

2.本期利润 14,892,322.14

3.加权平均基金份额本期利润 0.0060

4.期末基金份额总额 2,374,420,590.03

5.期末基金资产净值 1,006

注：(1)期末可供分配收益指基金本期利润减去本期利润已实现部分后的余额，即未进行分配的利润。

(2)本基金的预期收益水平：低于预期收益类别的产品。

(3)报告期(2015年7月27日至2015年9月30日止)，本基金本报告期无定期定投。

3.2 基金合同生效以来基金净值累计增长率变化与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长(%) 净资产收益率(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) ①-③ ②-④

月度区间 0.050% 0.00% 0.046% 0.00% -0.00% 0.00%

日度区间

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 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002284 东方财富 300,000 0.014

2 000907 中国建筑 260,000 0.013

3 000909 南京银行 500,000 0.013

4 000673 通光线缆 300,000 0.013

5 002619 银泰百货 200,000 0.011

6 000603 中航动力 80,000 0.008

7 000138 中航善达 150,000 0.010

8 000121 春秋航空 25,000 0.009

9 000062 东北化塑 100,000 0.009

10 合计 3,216,971,620.00 74.60

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 国债 987,004,409.80 20.15

2 行业国债

3 企业债

4 政府债

5 金融债

6 中期票据

7 可转债

8 其他

9 合计 2,316,971,620.00 74.60

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贵金属支持证券明细

序号 代码 名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 010616 1,606,720 6.41

2 010613 1,500,000 5.02

3 122306 10,000 3.92

4 150006 10,000,000 1,100,000 3.00

5 010600 10,000,000 100,042,200.00 3.30

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明细

序号 代码 名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 本币定期存款 15,296,472.72 0.53

2 信用利差

3 信用利同

4 信用利差

5 信用利同

6 信用申银款

7 信用利同

8 信用利同

9 信用利同

10 合计 32,109,230.34

5.7 投资组合报告

5.7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

5.7.2 基金管理人运用固有资金投资贵金属支持证券的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资贵金属支持证券。

5.7.3 基金管理人运用固有资金投资股指期货、国债期货的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资股指期货、国债期货。

5.7.4 基金管理人运用固有资金投资商品期货、商品期权的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资商品期货、商品期权。

5.7.5 基金管理人运用固有资金投资黄金租赁的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资黄金租赁。

5.7.6 基金管理人运用固有资金投资商品掉期、商品互换的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资商品掉期、商品互换。

5.7.7 基金管理人运用固有资金投资货币市场基金的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资货币市场基金。

5.7.8 基金管理人运用固有资金投资融资融券的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资融资融券。

5.7.9 基金管理人运用固有资金投资权证的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资权证。

5.7.10 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.11 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.12 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.13 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.14 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.15 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.16 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.17 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.18 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.19 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.20 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.21 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.22 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.23 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.24 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.25 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.26 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.27 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.28 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.29 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.30 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.31 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.32 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.33 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.34 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.35 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.36 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.37 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.38 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.39 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.40 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.41 基金管理人运用固有资金投资公募二增产品的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资公募二增产品。

5.7.42