

# 信息披露 Disclosure

## 长城久鑫保本混合型证券投资基金

### [2016] 第四季度报告

基金管理人:长城基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
报告送出日期:2017年1月20日

#### 1 | 重要提示

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、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2017年01月18日核对了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2016年10月01日起至12月31日止。

#### 2 | 基金产品概况

代码	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	采矿业	-	-
C	制造业	65,872,173.09	3.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,071.66	0.00
E	建筑业	15,586.23	0.00
F	批发和零售业	10,717,544.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	9,485.08	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.01
J	金融业	100,793.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究、技术服务与地质勘查业	-	-
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	中国证监会核准的其他行业	-	-
合计		77,901,586.00	3.59

#### 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	代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002650	美的集团	2,000,000	39,500,721.00	1.75
2	200060	先导智能	200,000	12,504,702.00	0.60
3	002620	机器人	701,410	10,175,444.00	0.50
4	000660	深天马A	40,000	8,400,000.00	0.30
5	002621	科伦药业	21,400	8,071,074.00	0.34
6	002623	百洋股份	36,764	8,003,632.00	0.00
7	002600	苏利股份	26,007	8,007,965.00	0.04
8	000606	广誉远	12,500	234,076.00	0.01
9	003446	中化岩土	10,000	160,100.00	0.01
10	001676	中航证券	26,006	160,760.00	0.00

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	代码	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110001	国债	211,046.00	0.01
2	200001	金融债	-22,400,476.01	-22.40%
3	100001	企业债	-30,000.00	-0.00%
4	210001	公司债	2,146,190,930.57	2.14%
5	100001	资产支持证券	1,000.00	0.00%

注:①本公司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,计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

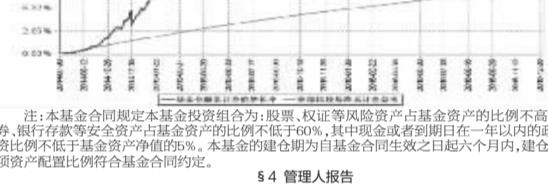
3.2.1 本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -0.08% 0.13% 0.00% -0.17% 0.12%

3.2.2 自基金合同生效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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金合同规定本基金投资组合为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等货币市场工具占基金资产的比例不高于60%,其中现金或者到期日在一年内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内,建仓期间,各项资产配置比例符合基金合同的约定。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明

基金经理王长鑫 本基金基金经理 2016年10月01日 - 男,中国科学院大学计算机科学与技术系硕士,2008年加入长城基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。

基金经理马瑞娟 本基金基金经理 2016年12月01日 - 4年 男,中国科学院大学计算机科学与技术系硕士,2008年加入长城基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理、基金经理等职务。

注:①基金经理任职日期以该基金经理开始行使管理权的日期为准;②基金经理离任日期以该基金经理不再履行管理权的日期为准;③基金经理的任职情况,由基金经理向本公司书面确认。

④本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑤本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑥本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑦本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑧本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑨本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑩本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑪本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑫本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑬本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑭本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑯本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑰本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑱本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑲本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

⑳本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉑本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉒本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉓本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉔本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉕本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉖本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉗本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉘本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉙本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉚本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉛本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉜本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉝本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉞本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉟本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。

㉟本基金从成立以来一直由王长鑫担任基金经理,马瑞娟自2016年12月1日起担任基金经理。