长城久泰沪深300指数证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年12月31日
基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2018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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年01月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月01日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	长城久泰沪深300指数
基金主代码	200002
前端交易代码	200002
后端交易代码	201002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末基金份额总额	399,805,494.14份
投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1)资产配置策略:本基金为增强型指数基金,股票投资以沪深300指数作为目标指数。在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。(2)股票投资策略:本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对沪深300指数的跟踪,即按照沪深300指数的行业配置比例构建投资组合。投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深300指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3)债券投资策略:本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险,获取市场平均收益。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2017年10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	7,848,504.25
2.本期利润	34,292,834.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0834
4.期末基金资产净值	685,424,518.22
5.期末基金份额净值	1.7144

注:①本期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。

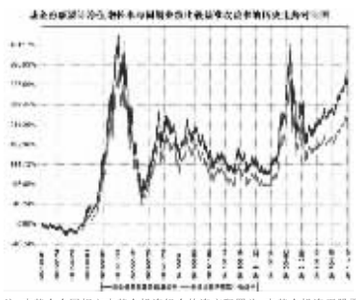
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	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
过去三个月	4.96%	0.77%	4.83%	0.76%	0.13%	0.01%

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



注:本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:本基金投资于股票的比例为基金净资产的90%~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、研究部总经理、长城久泰、长城品牌、长城久兆和长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理	2004年5月21日	-	17年	男,中国籍,北京大学力学系理学学士、北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部,长城证券股份有限公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理公司,曾任基金经理助理、"长城安心回报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"基金经理、"长城久富核心成长混合型证券投资基金"基金经理,公司总经理助理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,全球主要经济体复苏势头强劲,欧元区12月PMI数据攀升至199.7年的新高,达到60.6,美国ISM制造业PMI也持续超过次贷危机前的水平,美联储在年末进行了预期内的年内第三次加息,美国近30年来规模最大的税改法案获得通过,将对全球经济格局产生深远影响。美元走弱,人民币汇率稳步回升。良好的外部环境提供了稳定的外部需求。国内宏观经济运行平稳,体现出了一定的韧性,12月中国PMI为51.6,虽有所回落,仍继续处于扩张状态,全年均值也为51.6,达到2011年来的最高值。党的"十九大"的胜利召开为新时代中国经济发展指明了新的方向,海内外投资者对中国经济长期增长的信心在增强。证券市场运行平稳,业绩仍是驱动个股表现的核心驱动因素。得益于景气提升的基本面和有吸引力的估值水平,本报告期内食品饮料和家电行业龙头个股表现良好,这两个行业也成为本报告期表现最好的两个行业指数。本基金严格遵守基金合同,报告期内侧重于密切跟踪目标指数的投资目标,策略基本得当。本报告期基金参与新股配售也获得可观收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金比较基准收益率为4.83%,本基金报告期净值收益率为4.96%,与比较基准相比超额收益为0.13%。本基金年初至报告期末日均跟踪误差为0.0329%,年化跟踪误差为0.5096%。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对A股市场进行投资的良好工具。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5投资组合报告

5.1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	649,130,171.04	94.47
	其中:股票	649,130,171.04	94.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	37,740,574.55	5.49
8	其他资产	271,272.86	0.04
9	合计	687,142,018.45	100.00

5.2报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,561,279.20	0.23
B	采矿业	21,121,761.38	3.08
C	制造业	254,403,323.89	37.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,644,210.04	2.57
E	建筑业	24,624,001.54	3.59
F	批发和零售业	12,870,228.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	19,054,990.33	2.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,678,218.58	3.45
J	金融业	217,837,483.84	31.78
K	房地产业	31,761,232.92	4.63
L	租赁和商务服务业	6,756,113.78	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,702,341.91	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,334,123.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	4,640,559.91	0.68
S	综合	663,176.80	0.10
	合计	643,653,045.12	93.91

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	3,438,616.27	0.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,972,100.49	0.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
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	5,477,125.92	0.80

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

5.3.1报告期末指数投资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	601318	中国平安	593,845	41,557,273.10	6.06
2	600519	贵州茅台	28,398	19,807,321.02	2.89
3	600036	招商银行	594,209	17,243,945.18	2.52
4	000333	美的集团	261,336	14,485,854.48	2.11
5	000651	格力电器	284,210	12,419,977.00	1.81
6	601166	兴业银行	686,666	11,666,455.34	1.70
7	600016	民生银行	1,362,745	11,433,430.55	1.67
8	600887	伊利股份	348,936	11,232,249.84	1.64
9	000002	万科A	312,359	9,701,870.54	1.42
10	601328	交通银行	1,509,092	9,371,461.32	1.37

5.3.2报告期末积极投资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	300104	乐视网	126,418	1,937,987.94	0.28
2	600150	中国船舶	41,325	1,019,487.75	0.15
3	600666	奥瑞德	43,040	748,896.00	0.11
4	002859	洁美科技	16,665	563,277.00	0.08
5	002892	科力尔	11,000	353,760.00	0.05

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

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股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	70,091.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,765.13
5	应收申购款	192,416.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	271,272.86

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	1,937,987.94	0.28	重大事项停牌
2	600150	中国船舶	1,019,487.75	0.15	重大事项停牌
3	600666	奥瑞德	748,896.00	0.11	重大事项停牌
4	002859	洁美科技	563,277.00	0.08	新股锁定
5	002892	科力尔	353,760.00	0.05	新股锁定

5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	424,345,151.06
报告期期间基金总申购份额	8,024,199.48
减:报告期期间基金总赎回份额	32,563,856.40
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	399,805,494.14

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

注:本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.本基金设立等相关批准文件

2.《长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同》

3.《长城久泰沪深300指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

7.中国证监会规定的其他文件

9.2存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

9.3查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

网站:www.cofund.com.cn

长城久祥保本混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年12月31日
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:2018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01月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月01日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	长城久祥保本
基金主代码	001613
交易代码	001613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月9日
报告期末基金份额总额	1,137,306,301.85份
投资目标	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。
投资策略	本基金采用固定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简记为"CPPI")建立和运用严格的动态资产数量模型,动态调整安全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。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	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。
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
基金保证人	中国投融资担保股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2017年10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	19,274,146.08
2.本期利润	21,091,550.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.0113
4.期末基金资产净值	1,916,982,567.67
5.期末基金份额净值	1.064

注:①本期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。

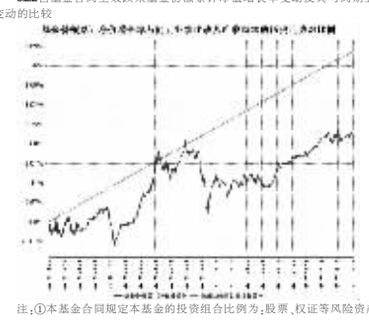
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	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
过去三个月	0.19%	0.09%	0.69%	0.01%	-0.50%	0.08%

3.2.2自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



注:①本基金合同规定本基金的投资组合比例为:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%,债券、银行存款等安全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%。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内,建仓期满时,各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡旻	长城稳健增利基金、长城久益分级债券、长城久惠保本、长城久源保本、长城久稳债券、长城增强收益债券、长城稳固收益债券、长城久利保本和长城久信债券基金的基金经理	2015年12月15日	-	7年	男,中国籍,厦门大学金融工程学士、硕士。2010年进入长城基金管理有限公司,曾任债券研究员、"长城货币市场证券投资基金"基金经理助理、"长城高金一年期理财债券型证券投资基金"、"长城少岁金理财债券型证券投资基金"、"长城保本混合型证券投资基金"、"长城新优选混合型证券投资基金"和"长城新视野混合型证券投资基金"的基金经理。
陈良栋	长城保本、长城久祥保本、长城久安保本、长城久益保本、长城久盈保本、长城久鼎保本、长城新兴产业混合基金的基金经理	2015年11月27日	-	6年	男,中国籍,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。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。
蒋劲刚	长城久惠保本、长城久鑫保本、长城久祥保本、长城久源保本和长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理	2017年5月9日	-	19年	男,中国籍,天津大学材料系工学学士、天津大学管理学院工学硕士。曾就职于深圳市华为技术有限公司、海南富岛资产管理有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司,历任运行保障部交易室交易员、交易主管、研究部行业研究员、机构理财部投资经理、长城消费增值混合型证券投资基金的基金经理。长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久安保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定,不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,对同向交易的价差进行事后分析,定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为,本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内,结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的现象。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

2017年四季度,国内经济表现出超预期的韧性,金融数据和经济数据整体表现平稳,通胀数据略超市场预期。国外经济方面,四季度全球经济持续复苏,通胀预期升温,10年美债收益率小幅上行。市场预期和市场情绪方面,债券市场投资者对经济增长韧性和金融监管的预期有所提升,债券市场利空情绪蔓延,相关利空消息接踵而至,叠加资金面时点性冲击和利率债供求阶段性失衡,导致利率债出现大幅度上行。以10年期利率债为例,四季度10年期国债上行30BP左右,10年期国开债上行60BP左右。

固定收益部分,四季度我们继续优化组合结构,将组合中期限短和收益低的债券卖出,增配收益较高期限匹配的同业存单,组合在保持合理的杠杆及久期同时,提高了总体的静态收益。在权益投资部分,根据目前安全垫情况保持较低仓位运行,其中个别持仓较大品种进行获利了结,整体波段操作积累收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.19%,业绩比较基准收益率为0.69%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5投资组合报告

5.1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	31,293,746.28	1.95
	其中:股票	31,293,746.28	1.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,116,655,611.10	69.75
	其中:债券	1,116,655,611.10	69.75
	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	369,531,881.66	23.08
	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	66,900,000.62	4.18
8	其他资产	16,520,960.74	1.03
9	合计	1,600,902,200.40	100.00

5.2报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	28,101,746.28	2.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,192,000.00	0.27
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	31,293,746.28	2.67

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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300088	长信科技	1,000,000	7,830,000.00	0.67
2	002376	新北洋	603,200	6,701,552.00	0.57
3	601222	林洋能源	500,000	5,070,000.00	0.43
4	000530	大冷股份	794,180	4,193,270.40	0.36
5	000501	鄂武商A	200,000	3,192,000.00	0.27
6	600285	羚锐制药	200,000	1,860,000.00	0.16
7	002217	合力泰	150,000	1,500,000.00	0.13
8	603823	百合花	36,764	629,399.68	0.05
9	002860	星帅尔	7,980	317,524.20	0.03
10	-	-	-	-	-

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,994,000.00	5.13
	其中:政策性金融债	59,994,000.00	5.13
4	企业债券	761,822,611.10	65.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,248,000.00	1.73
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	254,977,000.00	21.78
9	其他	19,614,000.00	1.68
10	合计	1,116,655,611.10	95.39

注:"其他"为地方政府债。

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	136228	16国电02	1,050,000	102,343,500.00	8.74
2	136047	15国君G1	1,000,000	98,620,000.00	8.42
3	136041	15渝信01	1,000,000	98,600,000.00	8.42
4	112296	15东北债	910,000	89,908,000.00	7.68
5	136304	16鞍金01	900,000	87,615,000.00	7.48

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投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2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。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1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。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3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。

5.11投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

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股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	146,236.55
2	应收证券清算款	2,831,277.40
3	应收股利	-
4	应收利息	13,542,947.39
5	应收申购款	499.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,520,960.74

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002860	星帅尔	317,524.20	0.03	新股锁定

5.11.6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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,530,750,922.10
报告期期间基金总申购份额	27,803.24
减:报告期期间基金总赎回份额	393,472,423.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,137,306,301.85

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2影响投资者决策的其他重要信息

注:本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会许可长城久祥保本混合型证券投资基金注册的文件

2.《长城久祥保本混合型证券投资基金基金合同》

3.《长城久祥保本混合型证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

7.中国证监会规定的其他文件

9.2存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

9.3查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅,如有疑问,可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

网站:www.cofund.com.cn

长城久安保本混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年12月31日
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:2018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规定,于2018年01月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月01日起至12月31日止。

§2基金产品概况

基金简称	长城久安保本
基金主代码	002296
交易代码	002296
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016