长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)上市交易公告书

基金管理人：长城基金管理有限公司　基金托管人：交通银行股份有限公司　注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所　上市时间：2007 年 5 月 18 日　公告日期：2007 年 5 月 15 日

一、重要声明与提示

长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号＜上市交易公告书的内容与格式＞》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2007 年 2 月 28 日《中国证券报》以及长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）上的《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

二、基金概览

1、基金简称：长城久富

2、交易代码：162006

3、基金份额总额：9,922,632,504.82 份（截止：2007 年 5 月 11 日）

4、基金份额净值：1.1688 元（截止：2007 年 5 月 11 日）

5、本次上市交易份额：1,543,827,244 份（截止：2007 年 5 月 11 日）

6、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

7、上市交易日期：2007 年 5 月 18 日

8、基金管理人：长城基金管理有限公司

9、基金托管人：交通银行股份有限公司

三、基金的集中申购、日常申购与上市交易

（一）本基金上市前基金集中申购、日常申购情况

1、基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会 2007 年 2 月 1 日证监基金字[2007]25 号文核准

2、基金运作方式：上市契约型开放式

3、基金合同期限：不定期

4、集中申购发售日期：2007 年 3 月 5 日至 2007 年 3 月 6 日

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：交易所（场内）和柜台（场外）

7、发售机构：

（1）深圳证券交易所（场内）发售机构

已具有基金代销业务资格的深交所会员：广发证券、国泰君安证券、国信证券、招商证券、银河证券、联合证券、中信证券、海通证券、申银万国证券、广东证券、西南证券、华龙证券、大同证券、民生证券、山西证券、北京证券、长江证券、万通证券、广州证券、兴业证券、天同证券、华泰证券、渤海证券、金通证券、万联证券、国元证券、湘财证券、东吴证券、东方证券、光大证券、天一证券、上海证券、国联证券、浙商证券、平安证券、华安证券、东北证券、天和证券、南京证券、长城证券、东海证券、泰阳证券、国海证券、第一证券、中原证券、中银国际证券、财富证券、国都证券、恒泰证券、华西证券、东莞证券、西北证券、国盛证券、新时代证券、齐鲁证券、华林证券、宏源证券、中金公司、广发华福证券、世纪证券、德邦证券、第一创业证券、信泰证券、金元证券、江南证券、西部证券、中信建投证券、财通证券。

（2）柜台（场外）发售机构

1）直销机构：长城基金管理有限公司。

2）代销银行：交通银行、中国建设银行、招商银行、华夏银行、兴业银行。

3）其他代销机构：渤海证券、长城证券、东方证券、国都证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、广州证券、海通证券、江南证券、联合证券、平安证券、世纪证券、申银万国证券、天相投资、兴业证券、中信建投证券、招商证券、中国银河证券。

8、验资机构名称：深圳大华天诚会计师事务所

9、集中申购资金总额及入账情况：本次集中申购净申购额为 7,933,111,394.97 元人民币；集中申购资金在基金验资确认日之前产生的利息共计 1,712,093.18 元人民币，其中 1,708,569.30 元折算成基金份额分别计入各基金份额持有人基金帐户，归基金份额持有人所有；其余 3,523.88 元的尾差作为基金资产归基金所有。上述集中申购资金及利息已于 2007 年 3 月 12 日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的基金托管专户。

11、基金合同生效日：2007 年 2 月 12 日。

12、原基金份额转换日：2007 年 3 月 12 日。

（二）原有基金久富份额的转换情况

基金管理人已于 2007 年 3 月 12 日对投资者持有的原久富证券投资基金（以下简称"基金久富"）进行了基金份额转换操作。经基金托管人确认，转换基准日（3 月 9 日）基金份额净值为 2.2808 元，精确到小数点后第 7 位为 2.2808480 元（第 7 位以后舍去），基金管理人按照 1:2.2808480 的转换比例将基金久富的基金财产进行了转换。转换后，基金份额净值变为 1.00 元，相应地，原基金久富每 1 份基金份额转换为 2.2808480 份，基金份额计算结果保留到整数位，所产生的误差归入基金资产。原基金久富的基金总份额由 500,000,000.00 份转换为 1,140,424,000.00 份。

（三）本基金上市前基金日常申购情况

1、本基金日常申购开放日：2007 年 3 月 19 日。

2、截至 2007 年 5 月 11 日，日常申购份额 847,388,540.55 份。

（四）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2007】66 号

2、上市交易日期：2007 年 5 月 18 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：长城久富

5、交易代码：162006

6、本次上市交易份额：1,543,827,244 份（截止 2007 年 5 月 11 日）。

7、基金资产净值的披露：包括开放式基金每日收市后对基金资产净值进行的估值和基金上市交易时间的净值揭示两部分。

基金管理人每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金净值传给深交所，深交所于次日通过行情系统揭示。根据《基金法》，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此基金管理人对公布的基金净值负责。交易时间内基金管理人将实时计算的基金份额参考净值传给深交所，深交所通过行情系统实时揭示。基金份额参考净值的揭示仅为投资者的交易提供参考，基金管理人、基金托管人并不对其准确性负责。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

截至 2007 年 5 月 11 日的场内基金份额持有情况：

场内基金份额持有人户数：23,552 户

平均每户持有的场内基金份额：65,549.73 份

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有 885,847,993 份，占 57.38%

场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例：个人持有 657,979,251 份，占 42.62%

场内基金前十名持有人情况：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	备注(占场内总份额比例)
1	中国人寿保险股份有限公司	112,111,947.00	7.26%
2	中国人寿保险（集团）公司	110,647,241.00	7.17%
3	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	96,795,320.00	6.27%
4	太平人寿保险有限公司	74,303,646.00	4.81%
5	新华人寿保险股份有限公司	66,009,844.00	4.28%
6	UBS AG	34,523,937.00	2.24%
7	银河－渣打－CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	33,902,244.00	2.20%
8	宝钢集团有限公司	31,817,830.00	2.06%
9	华泰证券－招行－华泰紫金 2 号集合资产管理计划	28,123,162.00	1.82%
10	国信－中行－国信"金理财"经典组合基金集合资产管理计划	21,841,688.00	1.41%
合计		610,076,859.00	39.52%

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基本信息

名称：长城基金管理有限公司

法定代表人：杨光裕

总经理：关林戈

成立时间：2001 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 10000 万元

注册地址：深圳市深南中路 2066 号华能大厦 25 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

设立批准文号：中国证券监督管理委员会 证监会金字[2001]55 号

企业法人营业执照注册号：4403011080138

经营范围：基金管理业务、发起设立基金

持续期间：持续经营

股东及其出资比例：

持股单位	占总股本比例
长城证券有限责任公司	40%
西北证券有限责任公司	15%
东方证券股份有限公司	15%
中原信托投资有限公司	15%
北方国际信托投资股份有限公司	15%
合计	100%

电话：0755－83662688

传真：0755－83662600

联系人：汪晨

2、经营概况

基金管理业务情况简介：

截至 2006 年 12 月 31 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、五只开放式基金，公募基金管理资产规模约 116 亿元。

内部组织结构及职能、人员情况：

公司设立了投资决策委员会、风险控制与审计委员会、资格审查与薪酬委员会等专业委员会。投资决策委员会主要负责对公司所管理的基金资产进行投资决策和风险监控。风险控制与审计委员会，负责公司内部控制的监督、审查和公司的审计工作。资格审查与薪酬委员会负责公司董事、监事、高级管理人员及相关人员的资格审查，董事、监事的提名和公司薪酬体系审订，对公司高级管理人员及其它相关人员进行考核、评价及奖惩。

公司设有十一个一级部门：基金管理部、固定收益部、市场开发部、北京管理总部、上海管理总部、深圳管理总部、创新业务部、信息技术部、运行保障部、监察稽核部、综合管理部。各部门主要职能如下：

基金管理部：负责公司基金的投资管理；行业和公司研究。

固定收益部：负责固定收益产品的投资、研究。

市场开发部：负责营销策划、媒体宣传、客户服务、与监管部门及托管行的沟通工作。

北京管理总部、上海管理总部、深圳管理总部：负责所辖区域内直销和渠道的开发、维护。

创新业务部：负责公司产品设计；养老金、特定客户证券投资资产管理等创新业务研究、资格申报、客户开发等。

运行保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、集中交易。

监察稽核部：负责揭示、控制公司各项业务风险，督促公司内部管理制度的执行，处理日常法律事务、信息披露事务。

信息技术部：负责公司信息系统的开发、维护。

综合管理部：负责公司人力资源管理、办公管理、行政后勤工作。

信息披露负责人及咨询电话：彭洪波 0755－23982104

截至到 2006 年 12 月 31 日，公司共有员工 66 人，具有硕士以上学历的员工占 72%，博士以上学历的占 18%，10%的员工具有海外学习和从业经历。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。

3、本基金基金经理

项志群先生，1969 年生，1992 年毕业于哈尔滨工业大学，获工学学士学位。

项志群先生于 1992－1995 年在航天 CAD 工程有限公司从事软件开发工作；1995－1997 年在经易期货有限公司工作，担任交易主管；1997－2001 年在海南证券有限公司工作，任交易部副经理。

项志群先生 2001 年 11 月进入长城基金管理有限公司，从事集中交易、基金投资工作，曾任交易主管，现任久富证券投资基金经理。

项志群先生多年从事证券投资研究工作，具有 11 年证券从业经历。在长城基金任职期间，项志群先生表现出了良好的专业素养和业务水平，其管理的久富证券投资基金取得了良好的投资业绩。项志群先生严格遵守证券投资基金从业人员执业准则及中国证监会关于基金投资的有关规定，具有良好的职业操守和专业精神。

（二）基金托管人

1、基本情况

名称：交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

法定代表人：蒋超良

成立日期：1987 年 3 月 30 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

注册资本：458.04 亿元人民币

联系人：曹榕

电话：021－68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行，自 1987 年重新组建以来，交通银行各项业务和机构建设持续健康发展，目前在我国 138 个大中城市设有分支行，全行员工 5 万余人，截至 2005 年末，资产总额为 14234.39 亿元人民币，实现税后利润 92.49 亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名，交通银行按资产总额排名世界 1000 家大银行中第 73 位。2005 年 6 月 23 日，交通银行成功在香港主板市场上市，成为首家在境外上市的内地商业银行。1998 年被《欧洲货币》评为中国最佳银行，1999 年被《环球金融》评为中国最佳银行，2005 年被《金融亚洲》评为中国最佳银行。

交通银行总行设资产托管部，现有员工 60 余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006 年 1 月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

阮红女士，交通银行资产托管部总经理，复旦大学企业管理专业博士研究生学历，高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验，在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任科员、交通银行办公室秘书处主任科员、交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、交通银行办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、党委委员，2006 年 1 月至今任交通银行资产托管部总经理。

3、基金托管业务经营情况

截止 2006 年底，交通银行共托管证券投资基金 35 只，包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、湘财合丰系列基金(成长、周期、稳定)、鹏华普天系列基金(债券、收益)、海富通精选基金、博时现金收益证券投资基金、易方达 50 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、鹏华中国 50 开放式证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、华安宝利证券投资基金、国联优质成长证券投资基金、银河银富货币市场证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、湘财风险预算混合型证券投资基金、万家公用事业证券投资基金、天治核心成长股票型证券投资基金、汇丰晋信2016 生命周期开放式证券投资基金、巨田货币市场基金、汇丰晋信龙腾股票型开放式证券投资基金等基金，托管了 2 只 QFII 基金——日兴中国人民币国债母基金、日兴 AM 中国人民币 A 股母基金，同时交通银行也是全国社会保障基金两家托管行之一。托管总规模近 1000 亿元。

（三）基金验资机构

会计师事务所名称：深圳大华天诚会计师事务所

注册地址：深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 B 座 11 楼

负责人：李秉心

经办注册会计师：李秉心、徐海宁

电话：0755－82900952

传真：0755－82900965

联系人：何慧仪

电话：0755－82900952

传真：0755－82900965

六、基金合同摘要

（一）前言

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"）的运作，保护基金份额持有人的合法权益。订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称 "《销售办法》")、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称 "《信息披露办法》")和其他有关法律法规及相关规定。订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）有关本基金的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证投资于本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得本基金基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

（二）基金合同当事人及其权利义务

1、基金管理人的权利

1）依法募集基金，办理基金备案手续；

2）自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

4）根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；

5）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

6）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用；

7）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

8）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

9）自行担任基金注册登记人或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

10）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

11）在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资；

12）依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

13）按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

14）在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

15）依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

16）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

17）选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

18）法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

2、基金管理人的义务

1）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2）办理基金备案手续；

3）自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

6）配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

7）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立，对所管理的不同基金分别管理、分别记账，进行证券投资；

8）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金财产；

9）接受基金托管人依法进行的监督；

10）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

11）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予保密，不得向他人泄露；

13）按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14）按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

15）不谋求对上市公司的控股和直接管理；

16）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会，或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17）按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18）进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

19）编制中期和年度基金报告；

20）确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

21）组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

22）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

23）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

24）基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

25）不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

26） 公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；

27）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

28）法律法规及基金合同规定的其他义务。

3、基金托管人的权利

1）依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

2）依照基金合同的约定获得基金托管费；

3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

4）在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

5）依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

6）依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

7）法律法规、基金合同规定的其它权利。

4、基金托管人的义务

1）以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

3）建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

4）除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7）按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

8）保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予以保密，不得向他人泄露；

9）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

10）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

11）对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

12）按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

13）根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；

14）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15） 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回、基金转换转出款项；

16）按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17）按照规定监督基金管理人的投资运作；

18）参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19）面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

20）基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

21）因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

22）不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

23）法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

1）分享基金财产收益；

2）参与分配清算后的剩余基金财产；

3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7）监督基金管理人的投资运作；

8）对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9）法律法规、基金合同规定的其它权利。

6、基金份额持有人的义务

1）遵守基金合同；

2）缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；

3）在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

4）不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法利益的活动；

5）执行生效的基金份额持有人大会决议；

6）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

7）法律法规及基金合同规定的其他义务。

（三）基金份额持有人大会

本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人或基金份额持有人合法的授权代表共同组成。

1、召开事由

有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

（1）终止基金合同；

（2）转换基金运作方式；

（3）更换基金托管人；

（4）更换基金管理人；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

（6）本基金与其它基金的合并；

（7）变更基金类别；

（8）变更基金投资目标、范围或策略；

（9）变更基金份额持有人大会程序；

（10）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。

以下情况不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低基金管理费率、基金托管费率；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

（4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

（5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

（6）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

2、召集人和召集方式

（1）除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

（2）基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（3）代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

（5）基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、通知

（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

1）会议召开的时间、地点和方式；

2）会议拟审议的主要事项；

3）会议形式；

4）议事程序；

5）有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；

6）授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；

7）表决方式；

8）会务常设联系人姓名、电话；

9）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

10）召集人需要通知的其他事项。

（2）采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

（3）如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

4、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席。通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

1）现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

① 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

② 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

① 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

② 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

③ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

④ 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

3）对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案)，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4）单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。

5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

（2）议事程序

1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

2）通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

（3）基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

6、表决

（1）基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

（2）基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下小项规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2）特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

（3）基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

（4）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（5）基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

（1）现场开会

1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

3）如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

（2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

（1）基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应自核准或备案后 2 日内在至少一种指定媒体公告。

9、法律法规或监管机关对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

（四）收益分配原则

1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2、如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

4、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担；

6、本基金收益每年最多分配 4 次，年度收益分配比例不低于可分配收益的 40%；

7、本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（五）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（六）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、因基金的证券交易或结算而产生的费用；

4、基金合同生效以后的信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效以后的会计师费和律师费；

7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（七）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的年管理费率为 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H ＝E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

本基金的年托管费率为 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H ＝E×年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（六）款第 3 至第 7 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（八）基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金总资产 60%－95%，债券占基金总资产 0%－35%，权证投资占基金资产净值 0%－3%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金股票资产中，不低于 80%的资金将投资于具有核心成长优势的上市公司发行的股票。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（九）基金的投资限制

1、禁止用本基金财产从事以下行为

（1）承销证券；

（2）向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

（5）向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

（6）买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

2、基金投资组合比例限制

（1）持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%，并按有关规定履行信息披露义务；

（3）本基金股票投资比例为 60%－95%；

（4）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（5）在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

（6）在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（7）基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；

（8）权证投资比例遵照相关法律法规的规定执行；

（9）资产支持证券投资比例遵照相关法律法规的规定执行；

（10）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

（十）基金资产净值的计算方式和公告

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

基金合同生效后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露交易日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体上。

（十一）基金合同的终止与基金财产的清算

1、有下列情形之一的，本基金合同终止：

（1）基金份额持有人大会决定终止；

（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；

（3）因重大违法、违规行为，被中国证监会责令终止的；

（4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、清算程序

（1）基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

（2）基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

（3）基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

（4）对基金财产进行评估和变现；

（5）基金清算组作出清算报告；

（6）会计师事务所对清算报告进行审计；

（7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（8）将基金清算结果报告中国证监会；

（9）公布基金清算公告；

（10）对基金剩余财产进行分配。

（十二）争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

（十三）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）集中申购期间、开放日常申购日至上市交易公告书公告前未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取集中申购费或日常申购费。

本基金集中申购后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

长城久富核心成长股票型证券投资基金 2007 年 5 月 11 日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产：	期末数
银行存款	1,338,809,166.24
清算备付金	1,119,903,586.25
交易保证金	3,394,155.50
应收证券清算款	0.00
应收股利	1,523,005.07
应收利息	5,253,072.53
应收申购款	9,157,332.91
其他应收款	0.00
股票投资市值	9,127,762,793.24
其中：股票投资成本	7,591,538,636.53
债券投资市值	24,168,628.40
其中：债券投资成本	21,831,865.62
权证投资市值	15,942,282.90
其中：权证投资成本	6,330,134.38
配股权证	0.00
买入返售证券	0.00
待摊费用	0.00
其他资产	0.00
资产合计	11,645,914,023.04
负债：	
应付证券清算款	38,207,231.75
应付赎回款	0.00
应付赎回费	0.00
应付管理人报酬	5,186,498.81
应付托管费	864,416.46
应付销售服务费	0.00
应付佣金	2,669,634.51
应付利息	0.00
应付收益	0.00
未交税金	0.00
其他应付款	1,250,000.00
卖出回购证券款	0.00
短期借款	0.00
预提费用	212,697.80
其他负债	
负债合计	48,390,479.33
持有人权益：	
实收基金	9,922,632,504.82
未实现利得	1,612,262,350.84
未分配收益	62,628,688.05
持有人权益合计	11,597,523,543.71
负债与持有人权益总计	11,645,914,023.04

八、基金投资组合

截止到 2007 年 5 月 11 日，长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）的投资组合如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

资产项目	金额(人民币元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	2,458,712,752.49	21.11%
股票投资市值	9,127,762,793.24	78.38%
债券投资市值	24,168,628.40	0.21%
权证投资市值	15,942,282.90	0.14%
其他资产	19,327,566.01	0.17%
合计	11,645,914,023.04	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

分类	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	7,528,145.00	0.06%
B 采掘业	396,496,529.79	3.42%
C 制造业	4,778,325,001.41	41.20%
C0 食品、饮料	865,173,463.70	7.46%
C1 纺织、服装、皮毛	102,947,471.40	0.89%
C2 木材、家具	13,697,544.96	0.12%
C3 造纸、印刷	4,005,846.00	0.03%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	960,374,480.99	8.28%
C5 电子	55,343,618.98	0.48%
C6 金属、非金属	503,277,216.98	4.34%
C7 机械、设备、仪表	1,849,746,036.42	15.95%
C8 医药、生物制品	383,895,686.22	3.31%
C99 其他制造业	39,863,635.76	0.34%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	279,948,121.27	2.41%
E 建筑业	101,181,797.20	0.87%
F 交通运输、仓储业	296,886,899.96	2.56%
G 信息技术业	354,878,234.02	3.06%
H 批发和零售贸易	190,815,913.35	1.65%
I 金融、保险业	1,628,465,287.28	14.04%
J 房地产业	309,963,947.76	2.67%
K 社会服务业	250,444,291.96	2.16%
L 传播与文化产业	388,435,442.82	3.35%
M 综合类	144,393,181.42	1.25%
金额合计：	9,127,762,793.24	78.70%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比
000568	泸州老窖	11,379,324	445,045,361.64	3.84%
600036	招商银行	19,475,079	421,635,460.35	3.64%
600143	金发科技	13,835,575	414,513,827.00	3.57%
600030	中信证券	7,213,764	403,826,508.72	3.48%
600037	歌华有线	19,007,118	374,250,153.42	3.23%
601318	中国平安	4,816,711	302,537,617.91	2.61%
600000	浦发银行	10,000,000	292,900,000.00	2.53%
600050	中国联通	28,606,180	185,368,046.40	1.60%
600786	东方锅炉	3,332,912	161,646,232.00	1.39%
600150	XD沪东重	1,805,299	160,473,028.11	1.38%

（四）报告期末按券种分类的债券投资组合：

序号	券种分类	市值（元）	占基金资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	0.00	0.00%
3	企业债	24,168,628.40	0.21%
4	可转换债	0.00	0.00%
5	央行票据	0.00	0.00%
	合 计	24,168,628.40	0.21%

（五）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细：

序号	债券代码	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	126005	07武钢债	24,168,628.40	0.21%

（六）报告期末按市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：

截至 2007 年 5 月 11 日，基金久富未持有资产支持证券。

（七）本基金本期未持有处于转股期的可转换债券。

（八）投资组合报告附注

（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。

（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的股票。

（3）其他资产的构成：

序号	其他资产	金额(人民币元)
1	交易保证金	3,394,155.50
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	1,523,005.07
4	应收利息	5,253,072.53
5	应收申购款	9,157,332.91
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
	合计	19,327,566.01

九、重大事件揭示

本基金暂无其他对基金份额持有人有较大影响的重大事件

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准长城久富核心成长股票型证券投资基金募集的文件；

（二）《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》；

（三）《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

（四）《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）托管协议》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

长城基金管理有限公司
二○○七年五月十五日