长城安心回报混合型证券投资基金 2008年半年度报告摘要

报告期间：2008年1月1日至6月30日　基金管理人：长城基金管理有限公司　基金托管人：中国农业银行　披露日期：2008年8月29日

第一节 重要提示

长城安心回报混合型证券投资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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2008年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、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。

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。

本报告期财务会计报告未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

第二节 基金简介

（一）基金基本情况

基金名称：长城安心回报混合型证券投资基金

基金简称：长城回报

基金代码：200007

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年08月22日

报告期末基金份额总额：16,195,934,046.15份

（二）基金投资基本情况

投资目标：以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率2倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。

投资策略：分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用"注重收益、关注成长、精选个股"的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。

业绩比较基准：银行一年期定期存款（税前）利率的2倍。

风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，主要投资于具有持续分红能力或持续成长潜力的优势企业以及当期收益率较高的债券品种，其风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金。

（三）基金管理人

名称：长城基金管理有限公司

信息披露负责人：彭洪波

联系电话：0755-23982338

传真：0755-23982328

电子邮箱：support@ccfund.com.cn

（四）基金托管人

名称：中国农业银行

信息披露负责人：李芳菲

联系电话：010-68435588

传真：010-68424181

电子邮箱：lifangfei@adchina.com

（五）信息披露方式

基金选定的信息披露报纸名称：证券时报、中国证券报、上海证券报

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：www.ccfund.com.cn

基金半年度报告置备地点：深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

第三节 主要财务指标和基金净值表现

下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。

（一）主要财务指标

单位：人民币元

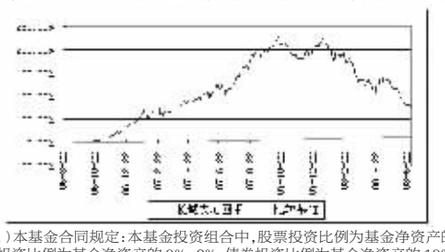
序号	主要财务指标	报告期（2008年1月1日—2008年6月30日）
1	本期利润	-7,267,841,680.33
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-1,576,810,048.04
3	加权平均份额本期利润	-0.4386
4	期末可供分配利润	2,713,409,350.35
5	期末可供分配份额利润	0.1675
6	期末基金资产净值	9,907,686,454.74
7	期末基金份额净值	0.6117
8	加权平均净值利润率	-51.62%
9	本期份额净值增长率	-41.86%
10	份额累计净值增长率	78.80%

（二）基金净值表现

1、长城安心回报基金本报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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
过去一个月	-17.86%	2.53%	0.70%	0.02%	-18.56%	2.51%
过去三个月	-23.24%	2.48%	2.06%	0.02%	-25.30%	2.46%
过去六个月	-41.86%	2.40%	4.13%	0.02%	-45.99%	2.38%
过去一年	-15.54%	2.08%	7.83%	0.02%	-23.37%	2.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	78.80%	1.92%	12.37%	0.02%	66.43%	1.90%

2、长城安心回报基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：（1）本基金合同规定：本基金投资组合中，股票投资比例为基金净资产的10%－85%；权证投资比例为基金净资产的0%-3%；债券投资比例为基金净资产的10%－85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的5%以上。本基金在投资运作中按照相关法律法规规定，严格遵守了基金合同的约定。

（2）本基金业绩比较基准的选择符合基金合同、基金招募说明书的规定。

第四节 管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人简介

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司，由长城证券有限责任公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于2001年12月27日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券有限责任公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托投资股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007年10月12日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金和长城品牌优选股票型证券投资基金。

2、基金经理简介

杨建华先生，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、长城证券有限责任公司投资银行部。2001年10月进入长城基金管理公司基金投资部任基金经理助理，自2004年5月21日至今任"长城久泰中信标普300指数证券投资基金"基金经理，自2007年9月25日至今兼任"长城安心回报混合型证券投资基金"基金经理。

长城安心回报混合型证券投资基金历任基金经理如下：杨毅平先生自2006年8月22日该基金成立日起至2008年5月16日任该基金基金经理。

（二）基金运作遵规守信情况声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城安心回报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。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况，本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整，有效地保护了基金持有人利益。

（三）公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况

本报告期本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序，保证各基金获得了公平的交易机会。

2、本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为混合型基金，以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率2倍的回报为目标，投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

3、异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为，未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

（四）投资策略和业绩表现说明及解释

本报告期内，国际国内经济形势错综复杂。国际上，不断攀升的油价触动着所有人的神经，美国次贷危机波及范围越来越大，并对美国乃至全球经济和金融秩序的冲击都超出了大多数人的预期；再看国内，从紧的调控政策进一步引发了投资者国内宏观经济的忧虑，加之突如其来的一月份南方冰雪灾害、"512"汶川特大地震灾害和六月份南方地区肆虐的洪涝灾害，更加重了投资者对经济前景的担忧，对上市公司盈利预期也愈发悲观，此外限售股解禁带来的短期供求失衡的预期，投资者信心受到多重打击，市场估值重心不断下移，尽管出现调降印花税利好刺激的反弹，但也不过是昙花一现，上半年总体上看，市场基本上没有什么像样的投资机会，尽管我们在年初预见到今年投资的难度很大，但是市场调整的幅度和力度都大大超出了我们的预期，仓位成为基金业绩表现的重要因素，本基金配置的行业和个股与宏观经济走势关联度偏高，并且和同类基金相比仓位偏重，本基金本报告期净值损失较大。本报告期净值增长率为－41.86%。

（五）宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

尽管遇到了国内外诸多不确定性因素的困扰，上半年中国经济依然增长态势依旧，根据国家统计局公布的数据，上半年GDP增长为10.4%，继续保持平稳快速增长，CPI为7.9%呈现逐月回落态势，因此，考虑到政府对国内外复杂形势把握能力的提高、综合运用各种经济手段日趋成熟，我们有理由对下半年乃至未来数年国内经济继续充满信心，对经济增长的信心也必将逐步反应到资本市场层面，证券市场经过深幅调整后整体估值已经非常具有吸引力，如果国内宏观经济如我们预期的那样以更稳健、更可持续的增长速度前行，国际市场情况不再恶化，下半年将面临一定的个股投资机会。本基金将加强对上市公司的研究，积极寻找盈利增长确定、估值安全边际较高的品种蕴含的投资机会，努力控制投资风险，争取为持有人获得良好的投资回报。

第五节 托管人报告

在托管长城安心回报混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》、《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》的约定，对长城安心回报混合型证券投资基金管理人——长城基金管理有限公司2008年1月1日至2008年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人认为，长城基金管理有限公司在长城安心回报混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长城安心回报混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行托管业务部

2008年8月19日

第六节 财务会计报告(未经审计)

（一）长城回报基金财务报表

1、长城回报基金本报告期末及上年度末的比较式资产负债表

长城安心回报混合型证券投资基金

资产负债表

2008年6月30日

单位：人民币元

项目	2008年6月30日	2007年12月31日
资 产：		
银行存款	51,448,599.77	1,546,884,296.18
结算备付金	5,770,308.98	21,947,832.75
存出保证金	3,236,561.85	500,000.00
交易性金融资产	9,109,552,085.55	16,567,982,183.91
其中：股票投资	7,540,206,241.75	14,731,163,607.31
债券投资	1,569,345,843.80	1,836,818,576.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	2,430,388.80	358,812.46
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	723,331,089.75	-
应收利息	31,432,568.42	24,322,948.59
应收股利	2,244,345.84	-
应收申购款	1,951,657.69	33,574,202.83
其他资产	-	-
资产总计	9,931,397,606.65	18,195,570,276.72
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	3,105,980.39
应付赎回款	2,869,232.70	88,111,966.93
应付管理人报酬	13,332,661.22	21,909,356.02
应付托管费	2,222,110.21	3,651,559.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,323,256.56	8,083,396.10
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	963,891.22	933,190.07
负债合计	23,711,151.91	125,795,448.86
所有者权益：		
实收基金	7,194,277,104.39	7,628,543,022.95
未分配利润	2,713,409,350.35	10,441,231,804.91
所有者权益合计	9,907,686,454.74	18,069,774,827.86
负债和所有者权益总计	9,931,397,606.65	18,195,570,276.72

附：本期末基金份额净值0.6117元，基金份额总额16,195,934,046.15份。

2、长城回报基金本报告期及上年度可比期间的比较式利润表

长城安心回报混合型证券投资基金

利润表

2008年半年度

单位：人民币元

项目	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日
一、收入	-7,093,525,473.19	821,055,552.51
1.利息收入	33,601,493.07	3,621,676.61
其中：存款利息收入	4,496,617.26	1,250,058.35
债券利息收入	29,104,875.81	2,371,618.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
2.投资收益	-1,438,731,152.80	794,397,147.24
其中：股票投资收益	-1,496,653,115.46	789,733,276.57
债券投资收益	3,910,457.20	-147,815.47
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	623,835.29	82,844.11
股利收益	53,387,670.17	4,728,842.03
3.公允价值变动收益	-5,691,031,632.29	19,860,806.60
4.其他收入	2,635,818.83	3,175,922.06
二、费用	174,316,207.14	30,253,969.48
1.管理人报酬	105,535,760.37	13,786,841.47
2.托管费	17,589,293.41	2,297,806.93
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	48,488,782.12	13,871,125.28
5.利息支出	2,479,964.60	78,953.10
其中：卖出回购金融资产支出	2,479,964.60	78,953.10
6.其他费用	222,406.64	219,232.70
三、利润总额	-7,267,841,680.33	790,801,593.03

3、长城回报基金本报告期及上年度可比期间的所有者权益（基金净值）变动表

长城安心回报混合型证券投资基金

所有者权益（基金净值）变动表

2008年半年度

单位：人民币元

项目	2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,628,543,022.95	10,441,231,804.91	18,069,774,827.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	-	-7,267,841,680.33	-7,267,841,680.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-434,265,918.56	-459,980,774.23	-894,246,692.79
其中：1.基金申购款	606,356,996.91	717,362,864.37	1,323,719,861.28
2.基金赎回款	-1,040,622,915.47	-1,177,343,638.60	-2,217,966,554.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	7,194,277,104.39	2,713,409,350.35	9,907,686,454.74

长城安心回报混合型证券投资基金

所有者权益（基金净值）变动表

2007年半年度

单位：人民币元

项目	2007年1月1日至2007年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,121,015,300.15	271,133,202.41	2,392,148,502.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	-	790,801,593.03	790,801,593.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,375,508,849.55	-527,884,284.20	-1,903,393,133.75
其中：1.基金申购款	495,244,048.32	142,098,535.53	637,342,583.85
2.基金赎回款	-1,870,752,897.87	-669,982,819.73	-2,540,735,717.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-64,034,876.09	-64,034,876.09
五、期末所有者权益（基金净值）	745,506,450.60	470,015,635.15	1,215,522,085.75

（二）长城回报基金财务报表附注

货币单位：人民币元

附注1. 主要会计政策和会计估计

本期财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报表相一致。

附注2.税项变更

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从2008年4月24日起，将证券（股票）交易印花税税率由3‰调整为1‰。本基金本报告期内于2008年4月24日前适用3‰的证券（股票）交易印花税税率，从2008年4月24日起适用1‰的证券（股票）交易印花税税率。

附注3. 本报告期内重大会计差错的内容和更正金额

本基金本报告期无重大会计差错和更正金额。

附注4. 关联方关系及交易

1. 关联方关系：

关联方名称	关联关系	发生的变化
长城基金管理有限公司	本基金管理人、本基金注册登记机构	无
中国农业银行	本基金托管人	无
长城证券有限责任公司	本基金管理人的主要股东	无
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东	无
中原信托有限公司	本基金管理人的股东	无
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东	无
景顺长城基金管理有限公司	本基金管理人主要股东控制的机构	无

2. 关联方交易：

（1）本基金通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

项目	关联方名称	2008年1月1日至2008年6月30日		2007年1月1日至2007年6月30日	
		金额	占项目总额比例(%)	金额	占项目总额比例(%)
股票成交量	长城证券有限责任公司	4,626,135,899.75	34.41	1,314,013,030.79	22.60
债券成交量	长城证券有限责任公司	20,250,074.53	28.79	18,588,000.00	5.81
债券回购成交量	长城证券有限责任公司	440,000,000.00	51.16	-	-
权证成交量	长城证券有限责任公司	3,072,350.16	79.56	-	-
发生的应付佣金	长城证券有限责任公司	3,932,192.54	34.74	1,077,290.39	22.92

* 本基金对关联方席位交易佣金的计算方式及佣金比率与其他非关联方交易佣金的计算方式及佣金比率一致。

** 佣金协议的服务范围：

除进行证券交易外，还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

（2）本期发生的应付关联方报酬

关联方名称	项目	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	管理费	105,535,760.37	13,786,841.47	年费率1.5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
中国农业银行	托管费	17,589,293.41	2,297,806.93	年费率0.25%	
合计		123,125,053.78	16,084,648.40		

（3）与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金在本报告期内，未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

（4）各关联方投资本基金的情况

A.本基金管理人本期投资本基金的情况

本基金管理人本期及上年可比期间均未投资本基金，本期末及上年可比期末也未持有本基金份额。

B.基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期末及上年可比期末均未持有本基金。

（5）关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	2008年6月30日	2007年6月30日
中国农业银行	银行存款	51,448,599.77	30,372,220.97

（6）从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日
中国农业银行	存款利息收入	4,324,493.24	1,116,446.06

（7）关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	2008年6月30日	2007年6月30日
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	13,332,661.22	1,558,263.59
应付托管费	中国农业银行	托管费	2,222,110.21	259,710.60
应付交易费用	长城证券有限责任公司	佣金	920,349.10	407,524.43
应收利息	中国农业银行	存款利息	139,654.87	46,942.59
合计			16,614,775.40	2,272,441.21

附注5. 流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至2008年6月30日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下：

（1）因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601958	金钼股份	2008.04.11	2008.07.17	网下认购	16.57	17.02	70,231	1,163,727.67	1,195,331.62
002237	恒邦股份	2008.05.12	2008.08.20	网下认购	25.98	40.97	912	23,693.76	37,364.64
002244	滨江集团	2008.05.21	2008.08.29	网下认购	20.31	15.68	10,809	219,530.79	169,485.12
002251	步步高	2008.06.11	2008.09.19	网下认购	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
002255	海陆重工	2008.06.18	2008.09.25	网下认购	10.46	19.64	19,865	207,787.90	390,148.60
002257	立立电子	2008.06.30	-	网上认购	21.81	21.81	26,500	577,965.00	577,965.00
002258	利尔化学	2008.06.30	2008.07.08	网上认购	16.06	16.06	15,500	248,930.00	248,930.00
126016	08宝钢债	2008.06.20	2008.07.04	分离交易可转债认购	76.27	75.08	126,900	9,678,900.89	9,527,652.00
580024	宝钢CWB1	2008.06.20	2008.07.04	分离交易可转债认购	1.4800	1.1970	2,030,400	3,011,099.11	2,430,388.80

（2）期末持有的暂时停牌股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600348	国阳新能	2008.06.30	股东大会	45.11	2008.07.01	45.59	870,130	42,605,392.18	39,251,564.30
000024	招商地产	2008.06.30	公开增发审核	14.94	2008.07.01	14.50	450,000	13,949,905.50	6,723,000.00

第七节 投资组合报告

（一）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	权益类投资	7,540,206,241.75	75.92
	其中：股票	7,540,206,241.75	75.92
2	固定收益类投资	1,569,345,843.80	15.80
	其中：债券	1,569,345,843.80	15.80
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	2,430,388.80	0.02
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	57,218,908.75	0.58
6	其他资产	762,196,223.55	7.67
7	合计	9,931,397,606.65	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

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	38,282,056.80	0.39
B	采掘业	449,206,072.08	4.53
C	制造业	3,924,622,386.23	39.61
C0	食品、饮料	754,096,885.15	7.61
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	842,889,043.82	8.51
C5	电子	56,743,561.00	0.57
C6	金属、非金属	1,021,937,620.40	10.31
C7	机械、设备、仪表	984,124,306.04	9.93
C8	医药、生物制品	264,830,969.82	2.67
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	69,233,001.64	0.70
F	交通运输、仓储业	26,189,771.51	0.26
G	信息技术业	116,865,216.84	1.18
H	批发和零售贸易	49,746,647.24	0.50
I	金融、保险业	2,537,919,223.24	25.62
J	房地产业	304,099,567.95	3.07
K	社会服务业	5,430,000.00	0.05
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	18,612,298.22	0.19
	合计	7,540,206,241.75	76.10

（三）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	600036	招商银行	36,175,091	847,220,631.22	8.55
2	600000	浦发银行	22,114,166	486,511,652.00	4.91
3	000568	泸州老窖	14,116,935	424,778,574.15	4.29
4	600016	民生银行	67,089,405	382,409,608.50	3.86
5	600596	新安股份	5,179,846	313,069,892.24	3.16
6	601166	兴业银行	8,516,152	216,906,391.44	2.19
7	600519	贵州茅台	1,543,424	213,887,697.92	2.16
8	601318	中国平安	4,205,144	207,145,393.44	2.09
9	000792	盐湖钾肥	2,219,100	195,547,092.00	1.97
10	000001	深发展A	9,677,658	187,069,129.14	1.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）的半年度报告正文。

（四）报告期内投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额（元）	占期初基金资产净值的比例（%）
1	600036	招商银行	581,061,671.35	3.22
2	600016	民生银行	427,818,780.11	2.37
3	600050	中国联通	417,382,714.88	2.31
4	000002	万 科A	362,932,746.94	2.01
5	601318	中国平安	288,963,879.49	1.60
6	000568	泸州老窖	268,679,815.48	1.49
7	600019	宝钢股份	258,162,376.41	1.43
8	600005	武钢股份	245,167,813.80	1.36
9	600596	新安股份	218,600,250.10	1.21
10	600015	华夏银行	187,097,378.72	1.04
11	601898	中煤能源	172,571,385.04	0.96
12	600585	海螺水泥	161,566,106.74	0.89
13	600143	金发科技	155,355,012.79	0.86
14	600048	保利地产	140,353,375.88	0.78
15	600031	三一重工	137,108,851.68	0.76
16	600150	中国船舶	136,845,907.77	0.76
17	600519	贵州茅台	135,441,541.10	0.75
18	601398	工商银行	132,244,991.75	0.73
19	600660	福耀玻璃	124,552,844.46	0.69
20	601628	中国人寿	122,878,981.27	0.68

2、本报告期内累计卖出价值前20名股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额（元）	占期初基金资产净值的比例（%）
1	600050	中国联通	449,875,303.75	2.49
2	601398	工商银行	418,190,280.33	2.31
3	000792	盐湖钾肥	328,642,191.16	1.82
4	601318	中国平安	314,968,532.78	1.74
5	601939	建设银行	293,336,498.16	1.62
6	600028	中国石化	278,604,473.48	1.54
7	601006	大秦铁路	268,533,202.99	1.49
8	600875	东方电气	238,203,286.00	1.32
9	600016	民生银行	214,622,298.98	1.19
10	600029	南方航空	192,195,973.11	1.06
11	000983	西山煤电	191,004,744.64	1.06
12	600026	中海发展	186,802,171.70	1.03
13	601919	中国远洋	186,713,626.60	1.03
14	601628	中国人寿	140,202,293.26	0.78
15	600030	中信证券	135,795,862.93	0.75
16	601666	平煤天安	128,582,708.69	0.71
17	601328	交通银行	127,081,665.69	0.70
18	601088	中国神华	114,578,984.84	0.63
19	601857	中国石油	113,855,581.05	0.63
20	600362	江西铜业	103,970,109.86	0.58

注：本表中累计卖出金额按实际证券清算款计算。

3、报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入：

项目	金额(元)
报告期内买入股票总成本	7,062,003,934.63
报告期内卖出股票总收入	7,064,909,621.14

注：本表中报告期累计卖出股票总收入按实际证券清算款计算。

（五）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	591,068,191.80	5.97
2	央行票据	968,750,000.00	9.78
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,527,652.00	0.10
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,569,345,843.80	15.84

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010112	21国债(2)	3,802,790.00	366,969,235.00	3.70
2	0701127	07央行票据127	3,000,000.00	288,630,000.00	2.91
3	0801031	08央票31	3,000,000.00	288,240,000.00	2.91
4	010110	21国债(0)	2,330,480.00	224,098,956.80	2.26
5	0701128	07央行票据128	2,000,000.00	199,700,000.00	2.02

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	备注
1	580024	宝钢CWB1	2,030,400	2,430,388.80	0.02	因认购可分离交易可转债被动持有的权证

注：本基金本报告期末共持有一只权证。

（九）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股票。

3、其他资产的构成：

序号	项目	金额（元）
1	存出保证金	3,236,561.85
2	应收证券清算款	723,331,089.75
3	应收股利	2,244,345.84
4	应收利息	31,432,568.42
5	应收申购款	1,951,657.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	762,196,223.55

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期持有权证情况

①本报告期被动持有权证情况

权证代码	权证名称	获得数量（份）	获得成本（元）	备注
580019	石化CWB1	853,248	2,426,363.58	投资分离交易可转债取得权证
580021	青啤CWB1	164,430	496,222.22	
580024	宝钢CWB1	2,030,400	3,011,099.11	

②本报告期主动投资权证情况

本基金本报告期未主动投资任何权证。

6、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。

第八节 基金份额持有人户数、持有人结构

1、本报告期末基金份额持有人户数

序号	项目	户数（户）/份额（份）