

# 长城稳固收益债券型证券投资基金更新的招募说明书

## 摘要(2016 年第 2 号)

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一六年九月

长城稳固收益债券型证券投资基金经 2013 年 8 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1117 号文注册募集。基金合同于 2015 年 1 月 28 日生效。

### 重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书；基金的过往业绩并不预示其未来表现，本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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，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基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2016 年 7 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

本招募说明书中与托管业务相关的更新信息已经本基金托管人中国工商银行股份有限公司复核。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人情况

- 1、名称：长城基金管理有限公司
- 2、住所：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 3、办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
- 4、法定代表人：何伟
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2001 年 12 月 27 日 7、电话：0755-23982338 传真：0755-23982328
- 8、联系人：袁江天
- 9、管理基金情况：目前管理久嘉证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置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、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益

定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安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、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金等三十八只基金。

10、客户服务电话：400-8868-666

11、注册资本：壹亿伍仟万元人民币

12、股权结构：

持股单位 占总股本比例

长城证券股份有限公司 47.059%

东方证券股份有限公司 17.647%

中原信托有限公司 17.647%

北方国际信托股份有限公司 17.647%

合计 100%

(二) 基金管理人主要人员情况

1. 董事、监事及高管人员介绍

(1) 董事

何伟先生，董事长，硕士。现任长城证券股份有限公司总裁、党委副书记。曾任职于北京兵器工业部计算机所、深圳蛇口工业区电子开发公司、深圳蛇口百佳超市有限公司等公司，1993年2月起历任君安证券有限公司投资二部经理、总裁办主任、公司总裁助理兼资产管理公司常务副总经理、营业部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理，华富基金管理有限公司（筹）拟任总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、公司副总裁。

熊科金先生，董事、总经理，硕士。曾任中国银行江西信托投资公司证券业务部负责人，中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券总部负责人，华夏证券有限公司江西管理总部总经理，中国银河证券有限责任公司基金部负责人、银河基金管理有限公司筹备组负责人，银河基金管理有限公司副总经理、总经理。

范小新先生，董事，博士，高级经济师。现任长城证券股份有限公司副总经理、党委委员、纪委书记。曾任重庆市对外经济贸易委员会副处长，西南技术进出口公司总经理助理，重庆对外经贸委美国公司筹备组组长，中国机电产品进出口商会法律部副主任，华能资本服务有限公司总经理工作部副经理。

杨玉成先生，董事，硕士。现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，东方金融控股（香港）有限公司董事长，上海东方证券资产管理有限公司董事。曾任上海财经大学财政系教师，君安证券有限公司证券投资部总经理助理，上海大众科技创业（集团）股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，上海申能资产管理有限公司董事、副总经理，东方证券股份有限公司财务总监、副总经理，申能集团财务有限公司董事、总经理。

姬宏俊先生，董事，硕士。现任中原信托有限公司副总裁。曾任河南省计划委员会老干部处副处长、投资处副处长，发展计划委员会财政金融处副处长，国家开发银行河南省分行信贷一处副处长。

金树良先生，董事，硕士。现任北方国际信托股份有限公司总经济师。曾任职于北京大学经济学院国际经济系。1992年7月起历任海南省证券公司副总裁、北京华宇世纪投资有限

公司副总裁、昆仑证券有限责任公司总裁、北方国际信托股份有限公司资产管理部总经理及公司总经理助理兼资产管理部总经理、渤海财产保险股份有限公司常务副总经理及总经理、北方国际信托股份有限公司总经理助理。

王连洲先生，独立董事，现已退休。中国《证券法》、《信托法》、《证券投资基金法》三部重要民商法律起草工作的主要组织者和参与者。曾在中国人民银行总行印制管理局工作，1983年调任全国人大财经委员会，历任办公室财金组组长、办公室副主任、经济法室副主任、研究室负责人、巡视员。

万建华先生，独立董事，硕士。现任证通股份有限公司董事长。曾任中国人民银行资金管理司处长，招商银行总行常务副行长兼上海分行行长(期间兼任长城证券股份有限公司董事长、国通证券有限责任公司(现招商证券股份有限公司)董事长)，中国银联股份有限公司总裁，上海国际集团总经理，国泰君安证券股份有限公司董事长。

徐英女士，独立董事，学士。现任新华资产管理股份有限公司副董事长。曾任北京财贸学院金融系助教、讲师，海南汇通国际信托投资公司副总经理、常务副总经理，长城证券股份有限公司总经理、董事长、党委书记，景顺长城基金管理有限公司董事长、中国证券业协会理事。

鄢维民先生，独立董事，学士。现任深圳市证券业协会常务副会长兼秘书长、深圳上市公司协会副会长兼秘书长。曾任江西省社会科学院经济研究所发展室副主任，深圳市体改委宏观调控处、企业处副处长，深圳市证券管理办公室公司审查处处长，招银证券公司副总经理。

## (2) 监事

吴礼信先生，监事会主席，会计师、中国注册会计师(非执业)。现任长城证券股份有限公司董事会秘书、财务总监。曾任安徽省地矿局三二六地质队会计主管，深圳中达信会计师事务所审计一部部长，大鹏证券有限责任公司计财综合部经理，大鹏证券有限责任公司资金结算部副总经理，第一创业证券有限责任公司计划财务部副总经理。2003年进入长城证券股份有限公司，任财务部总经理。

曾广炜先生，监事，高级会计师。现任北方国际信托股份有限公司总经理助理兼风险控制部总经理。曾任职于中国燕兴天津公司、天津开发区总公司、天津滨海新兴产业公司，2003年1月起历任北方国际信托股份有限公司信托业务四部副总经理、证券投资部副总经理、财务中心总经理、风险控制部总经理。

张令先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司稽核总部总经理。历任中国纺织机械股份有限公司财务会计、副科长、科长、副总会计师、上海浦发银行信托证券部科长、副总经理、东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理。

黄魁粉女士，监事，硕士。现任中原信托有限公司固有业务部总经理。2002年7月进入中原信托有限公司。曾在信托投资部、信托综合部、风险与合规管理部、信托理财服务中心工作。

袁江天先生，监事，博士。现任长城基金管理有限公司总经理助理兼董事会秘书、综合管理部总经理。曾任职于广西国际信托投资公司投资管理部、国海(广西)证券有限责任公司投资银行部、证券营业部、总裁办、北方国际信托投资股份有限公司博士后工作站。

王燕女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司财务经理、综合管理部副总经理。2007年5月进入长城基金管理有限公司，曾在运行保障部登记结算室从事基金清算工作，2010年8月进入综合管理部从事财务会计工作。

张静女士，监事，硕士。现任长城基金管理有限公司监察稽核部法务主管。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监察稽核部监察稽核员。

## (3) 高级管理人员

何伟先生，董事长，简历同上。

熊科金先生，董事、总经理，简历同上。

彭洪波先生，副总经理兼运行保障部总经理、信息技术部总经理，硕士。曾就职于长城证券股份有限公司，历任深圳东园路营业部电脑部经理，公司电子商务筹备组项目经理，公司审计部技术主审。2002年3月进入长城基金管理有限公司，历任监察稽核部业务主管、部门副总经理、部门总经理、公司督察长兼监察稽核部总经理、公司总经理助理兼运行保障部总经理。

桑煜先生，副总经理兼市场开发部总经理、广州管理部总经理，学士。曾任职于中国建设银行山东省分行、中国建设银行总行基金托管部。2002年8月进入长城基金管理有限公司，历任市场开发部业务主管、运行保障部副总经理、运行保障部总经理、市场开发部总经理、综合管理部总经理、公司总经理助理。

杨建华先生，副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理，硕士。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳和君创业有限公司、长城证券股份有限公司。

2001年10月进入长城基金管理有限公司工作，历任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理、“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理。

卢盛春先生，副总经理兼机构理财部总经理，硕士。曾就职于中国人民银行江西省分行、交通银行海南分行、海通证券股份有限公司、富国基金管理有限公司、西北证券有限责任公司、华商基金管理有限公司（筹备组）。2003年进入长城基金管理有限公司，历任上海分公司总经理、北京分公司总经理、公司总经理助理。

车君女士，督察长、监察稽核部总经理，硕士。曾任职于深圳本鲁克斯实业股份有限公司，1993年起先后在中国证监会深圳监管局市场处、机构监管处、审理执行处、稽查一处、机构监管二处、党办等部门工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、正处级调研员等职务。

## 2. 本基金基金经理简历

钟光正先生，经济学硕士。曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司、广发银行总行资金部、招商银行总行资金交易部。2009年11月进入长城基金管理有限公司，曾任债券研究员，自2010年2月24日至2011年10月18日任“长城货币市场证券投资基金”基金经理，自2010年2月24日至2011年11月13日任“长城稳健增利债券型证券投资基金”基金经理，现任公司固定收益部总经理、投资决策委员会委员。自2011年4月12日起任“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自2012年8月2日起任“长城保本混合型证券投资基金”基金经理，自2013年9月6日起任“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自2015年1月28日起任“长城稳固收益债券型证券投资基金”基金经理，自2015年11月9日起任“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月20日起任“长城久利保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年6月21日起任“长城久源保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月14日起任“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理。

储雯玉女士，中央财经大学经济学学士、北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。具有8年证券从业经历。2008年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员，“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理。自2015年5月11日至今任“长城稳固收益债券型证券投资基金”基金经理，自2015年8月11日至今任“长城久惠保本混合型证券投资基金”基金经理，自2015年10月15日至今任“长城久鑫保本混合型证券投资基金”和“长城久利保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月12日至今任“长城久润保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月21日至今任“长城久源保本混合型证券投资基金”基金经理。

3.本公司公募基金投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

熊科金先生,投资决策委员会主任,公司董事、总经理。

杨建华先生,投资决策委员会执行委员,公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、基金经理。

钟光正先生,投资决策委员会委员,公司固定收益部总经理、基金经理。

吴文庆先生,投资决策委员会委员,公司研究部总经理、基金经理。

4.上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一)基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:洪渊

### (二)主要人员情况

截至2016年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工190人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### (三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2016年6月,中国工商银行共托管证券投资基金587只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

## 三、相关服务机构

### (一)基金份额发售机构

#### 1.直销机构

名称:长城基金管理有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心40-41层

法定代表人:何伟

成立时间:2001年12月27日

电话:0755-23982338

传真:0755-23982328

联系人：黄念英

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)

## 2. 代销机构

### (1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

联系人：李鸿岩

电话：010-66107913

网址：[www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### (2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：张静

电话：010-66275654

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

### (3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

电话：010-66596688

传真：010-66594946

联系人：宋亚平

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

### (4) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83198888

传真：0755-83195109

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

### (5) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：常振明

联系人：丰靖

电话：010-65550827

传真：010-65541230

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com/>

(6) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：唐苑

传真：021-63604199

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

客户服务电话：95528

(7) 深圳农村商业银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

办公地址：深圳市罗湖区 3038 号合作金融大厦

法定代表人：李伟

联系人：王璇

联系电话：0755-25188269

传真：0755-25188794

客服电话：4001961200

公司网站：[www.961200.net](http://www.961200.net)

(8) 东莞农村商业银行股份有限公司

注册地址：东莞市南城路 2 号

办公地址：东莞市南城路 2 号

法定代表人：何沛良

联系人：杨亢

电话：0769-22866270

传真：0769-22320896

客服电话：0769-961122

网址：[www.drcbank.com](http://www.drcbank.com)

(9) 泉州银行股份有限公司

注册地址：福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人：傅子能

联系电话：0595-22551071

联系人：董培姗

客服电话：400-8896-312

公司网站：[www.qzccb.com](http://www.qzccb.com)

(10) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

客服电话：95574

公司网站：[www.nbcb.cn](http://www.nbcb.cn)

(11) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：010-85130577

联系人：权唐

客户服务电话：4008888108

网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（12）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

联系人：程丽辉

电话：021-23219991

传真：021-23219100

客户服务电话：95553、4008888001

网站：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

（13）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客户服务电话：0755-33680000，4006666888

网站：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

（14）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系人：田徽

电话：010-66568047

客户服务电话：4008-888-888

网站：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

（15）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565

网站：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

（16）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-33830395

客户服务电话：4008816168



网站: [www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(17) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

联系人: 曹晔

电话: 021-33388215

传真: 021-33388224

客服电话: 95523/4008895523/4008000562

网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

(18) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人: 杜庆平

联系人: 蔡霆

电话: 022-28451991

传真: 022-28451892

客户服务电话: 400-651-5988

网站: [www.bhzq.com](http://www.bhzq.com)

(19) 中航证券有限公司

注册地址: 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人: 王宜四

联系人: 戴蕾

电话: 0791-86868681

传真: 0791-86770178

客服电话: 400-8866-567

网站: [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(20) 华西证券股份有限公司

注册地址: 四川省成都市陕西街 239 号

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼

法定代表人: 张慎修

联系人: 张曼

电话: 010-52723273

传真: 0755-83025991

客户服务电话: 4008-888-818

公司网站: [www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

(21) 广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址: 广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼

法定代表人: 邱三发

联系人: 林洁茹

电话: 020-88836999

传真: 020-88836654

客户服务电话: 020-961303

网站: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(22) 世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：姜味军

联系人：袁媛

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

客户服务电话：0755-83199599

网站：[www.csc.com.cn](http://www.csc.com.cn)

(23) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李炜

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

网址：[www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(24) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

联系电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：95548

公司网址：[www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

(25) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：郑向溢

电话：0755-82558038

传真：0755-82558355

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

客服热线：4008001001

(26) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(27) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话：400-600-8008、95532

网址：www.china-invs.cn

(28) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：029-87406649

传真：029-87406387

客服热线：029—87419999

网址：www.westsecu.com.cn

(29) 长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服热线：4008-888-999 或 95579

网址：www.95579.com

(30) 华宝证券有限责任公司

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川

电话：021-68778790

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

网址：www.cnhbstock.com

(31) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客户服务电话：95548

网站：www.cs.ecitic.com

(32) 国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311

客户服务电话：400-818-8118

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

(33) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：山西省太原市长治路111号世贸中心A座13层

法定代表人：董祥

联系人：薛津

客户服务热线：400-7121-212

网址：[www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(34) 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555246

客服电话：400-8888-993

公司网站：[www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn)

(35) 信达证券股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(36) 西南证券股份有限公司

办公地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

公司网站：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

(37) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888  
传真：020-87557985  
客服电话：95575 或致电各地营业网点  
公司网站：www.gf.com.cn

(38) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层  
法定代表人：李学东  
电话：010-85679888  
传真：010-85679535  
联系人：秦朗  
客服电话：400-910-1166  
网站：www.cicc.com.cn

(39) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层  
法定代表人：张磊  
联系人：洪成  
电话：0755-23953913  
传真：0755-83217421  
客服电话：400-990-8826  
公司网站：www.citicsf.com

(40) 申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
法定代表人：李季  
联系人：李巍  
传真：010-88085195  
客户服务电话：4008-000-562  
网址：www.hysec.com

(41) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号  
办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号  
法定代表人：冉云  
联系人：刘婧漪  
电话：028-86690057  
客户服务电话：4006-600109  
网址：www.gjzq.com.cn

(42) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼  
法定代表人：薛峰  
联系人：童彩平  
电话：0755-33227950  
传真：0755-33227951  
客服电话：4006-788-887

公司网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(43) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 朱晓超

联系电话: 021-60897840

客服电话: 4000-766-123

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(44) 上海天天基金销售有限公司

办公地址: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人: 其实

联系人: 高莉莉

联系电话: 020-87599121

客服电话: 400-1818-188

公司网站: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(45) 众升财富(北京)基金销售有限公司

办公地址: 北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人: 李招弟

联系人: 付少帅

联系电话: 010-59497361

传真: 010-64788105

客服电话: 400-808-0069

公司网站: [www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(46) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址: 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人: 闫振杰

联系人: 翟飞飞

联系电话: 010-62020088

客服电话: 400-888-6661

公司网站: [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(47) 北京增财基金销售有限公司

办公地址: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人: 王昌庆

联系人: 张蕾

联系电话: 010-67000988

客服电话: 400-001-8811

公司网站: [www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(48) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

联系人: 吴阿婷

联系电话: 0755-82721106

客服电话: 400-9200-022

公司网站: [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(49) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

法定代表人：杨文斌

联系人：胡轶隼

联系电话：021-20613635

客服电话：400-700-9665

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(50) 上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：燕斌

联系人：凌秋艳

联系电话：021-52822063-8105

客服电话：4000-466-788

公司网站：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(51) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号

法定代表人：肖雯

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

公司网站：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

(52) 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务热线：4008219031

公司网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(53) 上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

客服电话：4006767523

网址：[www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

(54) 上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：盛大

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-067-6266

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(55) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址： 深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期 418 室

法定代表人： 齐小贺

联系人： 陈勇军

电话:0755-83999913

传真:0755-83999926

客服电话： 0755-83999907

网址： [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

（56） 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址： 深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

办公地址： 深圳市南山区南山街道科苑路 18 号东方科技大厦 18F

法定代表人： 何昆鹏

联系人： 张烨

电话： 0755-84034499

传真： 0755-84034477

客服电话： 400-9500-888

网址： [www.jfzinv.com](http://www.jfzinv.com)

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）基金注册登记机构

名称： 长城基金管理有限公司

注册地址： 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

法定代表人： 何伟

成立时间： 2001 年 12 月 27 日

电话： 0755-23982338

传真： 0755-23982328

联系人： 张真珍

客户服务电话： 400-8868-666

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所名称： 北京市中伦律师事务所

注册地址： 北京市朝阳区建国门外大街甲 6 号 SK 大厦 36-37 层

负责人： 张利国

经办律师： 刘洪蛟、李雅婷

电话： 0755-23993388

传真： 0755-86186205

联系人： 李雅婷

（四）会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所名称： 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所（办公地址）： 北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

执行事务合伙人： Ng Albert Kong Ping 吴港平

电话： 010-58153000

传真： 010-85188298

签章注册会计师： 昌华、周刚

联系人： 李妍明

四、基金的名称



本基金名称：长城稳固收益债券型证券投资基金

## 五、基金的类型

基金类型：债券型

基金运作方式：契约型开放式。

## 六、基金的投资目标

本基金将在有效控制风险的前提下，通过对固定收益类资产及权益类资产的主动投资管理  
及合理配置，力争使基金资产获得长期稳定的投资回报

## 七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、企业债、公司债、央行票据、  
地方政府债、商业银行金融债与次级债、政策性金融债、中期票据、资产支持证券、可转  
债（含分离交易可转债）、短期融资券、中小企业私募债、质押及买断式回购及银行存款  
等固定收益类投资工具，国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证  
监会核准上市的股票)、权证等权益类资产，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，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品  
种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：债券资产投资比例不低于基金资产的 80%；股票及权证等权益类  
资产投资比例不高于基金资产的 20%，其中，权证资产的比例不超过基金资产的 3%；现金  
或者到期日在 1 年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

## 八、基金的投资策略

### 1、大类资产配置策略

本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政  
政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、债券品  
种、股票市场、及现金类资产的收益风险特征，在基准配置比例的基础上，动态调整各大  
类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。

### 2、固定收益资产投资策略

本基金投资组合在进行固定收益类资产的投资时，主要通过分析宏观经济形势、财政政策、  
货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和  
动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。本基金将在科学的大类资产配置及  
券种配置、完整的信用评价系统和严格的投资风险管理基础上获取基准收益，同时争取获  
得超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。固定收益类投资部分的超额  
收益主要通过以下几种策略实现：

#### (1)久期管理策略

本基金建立了债券分析框架和量化模型，预测利率变化趋势，确定投资组合的目标平均久  
期，实现久期管理。本基金的分析框架包括宏观经济指标和货币金融指标，分析金融市场  
中各种关联因素的变化，从而判断债券市场趋势。宏观经济指标包括 GDP、CPI、PPI、固  
定资产投资、工业增加值、进出口贸易；货币金融指标包括货币供应量、新增贷款、新增  
存款、超额准备金率。宏观经济指标和货币金融指标将用于估计央行货币政策，以考察央  
行调整利率、存款准备金率，进行公开市场操作和窗口指导等操作对市场利率的影响程度。  
当预测利率和收益率水平上升时，建立较短平均久期组合或缩短现有固定收益类资产组合  
的平均久期；当预测利率和收益率水平下降时，建立较长平均久期组合或增加现有固定收  
益类资产组合的平均久期。本基金将在对市场利率变动进行充分分析的基础上，选择建立  
和调整最优久期固定收益类资产组合。

#### (2)收益率曲线策略

本基金将在确定固定收益类资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，以及

收益率曲线斜率和曲度的预期变化，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。

### (3)个券选择策略

利率产品和信用产品是债券市场构成的两个方面，在对利率产品和信用产品的资产配置上，本基金将综合对宏观周期、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢价，结合市场情绪，动态调整信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。具体在个券选择方面，本基金将在信用风险管理基础上重点关注：预期信用评级上升的个券、具有某些特殊优势条款的个券、估值合理的个券、信用利差充分反映债券发行主体的风险溢价要求的个券、经风险调整后的收益率与市场收益率曲线比较具有相对优势的个券。本基金将通过对个券基本面和估值的研究，选择经信用风险或预期信用风险调整后收益率较高的个券，收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势的个券。

### (4)把握市场低效或失效状况下的交易机会

在市场低效或失效状况下，本基金将根据市场实际情况，积极运用各类套利以及优化策略对固定收益类资产投资组合进行管理与调整，捕捉交易机会，以获取超额收益。

#### 1)新券发行溢价策略

在特殊市场环境下新券发行利率可能远高于市场合理收益率，在发行时认购新券可能获得超额收益。

#### 2)信用利差策略

不同信用等级的债券存在合理的信用利差，由于短期市场因素信用利差可能暂时偏离均衡范围，将会出现短期交易机会。通过把握这样的交易机会可能获得超额收益。

#### 3)套利策略

套利策略包括跨市场套利和跨期限套利。跨市场套利是指利用同一只固定收益类投资工具在不同市场（主要是银行间市场与交易所市场）的交易价差进行套利，从而提高固定收益类资产组合的投资收益。跨期限套利是指当短期回购利率低于长期回购利率时，可通过短期融资、长期融券实现跨期限套利。

### (5)可转换债券投资策略

当正股价格处于特定区间内时，可转换债券将表现出股性、债性或者股债混合的特性。本基金将对可转换债券对应的正股进行分析，从行业背景、公司基本面、市场情绪、期权价值等因素综合考虑可转换债券的投资机会，在价值权衡和风险评估的基础上审慎进行可转换债券的投资，创造超额收益。

### (6)中小企业私募债投资策略

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

本基金投资于单只中小企业私募债的比例不得超过本基金资产净值的10%。未来法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。

在中小企业私募债选择时，本基金将采用公司内部债券信用评级系统对信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。在此基础上，本基金重点关注中小企业私募债的发行要素、担保机构等发行信息对债项进行增信。

本基金将根据相关法律法规要求披露中小企业私募债的投资情况。

### (7)债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，

积极参与债券回购交易，放大固定收益类资产投资比例，追求固定收益类资产的超额收益。

### 3、权益资产投资策略

本基金将重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。在股票选择方面，充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，选择具备外延式扩张能力的优势上市公司，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，同时将根据行业、公司状况的变化，基于估值水平的波动，动态优化股票投资组合。在安全边际方面，将加强个股下行风险的策略判断，并对于因市场阶段性有效性降低时出现的套利机会保持敏感性。

本基金的权证投资策略主要体现为深入分析权证标的证券基本面，在合理估值的基础上，结合期权定价模型选择市场定价合理的权证进行投资，具体包括价值发现策略、杠杆策略、波动性溢价策略、买入保护性认沽权证策略等。

随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金将在遵循该产品风险收益特征的前提下，积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富投资标的以及组合投资策略。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $90\% \times$ 中债综合财富指数收益率 $+10\% \times$ 沪深 300 指数收益率。

中债综合财富指数由中央国债登记结算有限责任公司编制和维护。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融机构债、短期融资券、中央企业债等债券，综合反映了债券市场整体价格和回报情况。该指数以债券托管量市值作为样本券的权重因子，每日计算债券市场整体表现，是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一，适合作为本基金的固定收益投资部分业绩基准。

沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，较好地反映了 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准，适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

### 十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为中等风险、中等收益的基金产品。

### 十一、投资组合报告

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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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。

本投资组合报告数据截至 2016 年 6 月 30 日止，本报告中财务资料未经审计。

#### 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	13,511,280.00	9.16
---	------	---------------	------

其中：股票 13,511,280.00 9.16  
 2 固定收益投资 123,845,591.70 83.98  
 其中：债券 123,845,591.70 83.98  
 资产支持证券 --  
 3 贵金属投资 --  
 4 金融衍生品投资 --  
 5 买入返售金融资产 --  
 其中：买断式回购的买入返售金融资产 --  
 6 银行存款和结算备付金合计 2,105,548.63 1.43  
 7 其他资产 8,004,367.75 5.43  
 8 合计 147,466,788.08 100.00

2、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 --  
 B 采矿业 --  
 C 制造业 3,005,800.00 2.39  
 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 --  
 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 1,491,880.00 1.18  
 J 金融业 9,013,600.00 7.16  
 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 13,511,280.00 10.73

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 600109 国金证券 420,000 5,661,600.00 4.49  
 2 000776 广发证券 200,000 3,352,000.00 2.66  
 3 000068 华控赛格 210,000 2,032,800.00 1.61  
 4 600850 华东电脑 52,000 1,491,880.00 1.18  
 5 600233 大杨创世 50,000 973,000.00 0.77  
 6 -----  
 7 -----  
 8 -----  
 9 -----

10-----

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 49,070,177.60 38.96

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 74,775,414.10 59.36

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 可转债 --

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 123,845,591.70 98.32

5、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 010107 21 国债(7) 180,220 19,478,177.60 15.46

2 010303 03 国债(3) 160,000 16,592,000.00 13.17

3 122367 14 财富债 120,000 12,613,200.00 10.01

4 122126 11 庞大 02 121,630 12,390,448.10 9.84

5 122443 15 桂金债 100,000 10,351,000.00 8.22

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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。

9.3 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。

10、投资组合报告附注

10.1 本报告期内本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。

10.2 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。

10.3 其他资产的构成：

序号 名称 金额(元)

- 1 存出保证金 125,285.61
- 2 应收证券清算款 5,998,073.28
- 3 应收股利 -
- 4 应收利息 1,878,796.19
- 5 应收申购款 2,212.67
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 8,004,367.75

10.4 报告期末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。

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

10.6 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。

## 十二、基金的业绩

过往一定阶段长城稳固收益基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

(截至 2016 年 6 月 30 日)

长城稳固收益债券 A

时间段 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

基金合同生效日至 2015 年 12 月 31 日 9.90% 0.44% 7.28% 0.26% 2.62% 0.18%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 -0.27% 0.24% -0.09% 0.20% -0.18% 0.04%

基金合同生效日至 2016 年 6 月 30 日 9.60% 0.38% 7.19% 0.24% 2.41% 0.14%

长城稳固收益债券 C

时间段 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

基金合同生效日至 2015 年 12 月 31 日 9.40% 0.44% 7.28% 0.26% 2.12% 0.18%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 -0.37% 0.23% -0.09% 0.20% -0.28% 0.03%

基金合同生效日至 2016 年 6 月 30 日 9.00% 0.38% 7.19% 0.24% 1.81% 0.14%

基金的过往业绩并不预示其未来表现，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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 十三、基金费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、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)基金销售服务费；
- (4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

- (6)基金份额持有人大会费用；
- (7)基金的证券交易费用；
- (8)基金的银行汇划费用；
- (9)按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## 2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.75%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### (2)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### (3)基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类中第(4)–(8)项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## (二)与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

本基金 A 类基金份额在申购时收取申购费用，A 类基金份额的申购费率随申购金额的增加而递减，投资者可以多次申购本基金，申购费率按每笔申购申请单独计算。C 类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费，销售服务费年费率为 0.4%。

本基金 A 类基金份额自 2015 年 3 月 13 日起对通过直销柜台申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。具体如下：

#### (1) 申购费率

申购金额（含申购费） A 类基金份额

申购费率

100 万元以下 0.8%

100 万元(含)–300 万元 0.5%

300 万元(含)–500 万元 0.3%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

注：上述申购费率适用于除通过本公司直销柜台申购的养老金客户以外的其他投资者。

(2) 特定申购费率

申购金额（含申购费） A 类基金份额

申购费率

100 万元以下 0.16%

100 万元(含)–300 万元 0.10%

300 万元(含)–500 万元 0.06%

500 万元以上(含) 每笔 1000 元

注：上述特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金份额的养老金客户，包括基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。

如未来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

2、赎回费用

持有期 A 类基金份额

赎回费率 C 类基金份额

赎回费率

30 天以内 0.75% 持有期限在 30 日以内的基金份额，赎回费率为 0.75%；持有期限超过 30 日（含 30 日）的基金份额，不收取赎回费用。

30 天(含)–1 年 0.1%

1 年(含)–2 年 0.05%

2 年以上(含) 0

注：上表中，1 年按 365 天计算。

3、转换费用

(1)基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差二部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转入份额保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归转入基金财产所有。

①如转入基金的申购费率>转出基金的申购费率

转出金额=转出基金份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费=转出金额×转出基金赎回费率

转入总金额=转出金额–转出基金赎回费

转入基金申购费补差费率=转入基金适用申购费率–转出基金适用申购费率

转入基金申购费补差=转入总金额–转入总金额/(1+转入基金申购费补差费率)

转入净金额=转入总金额–转入基金申购费补差

转入份额=转入净金额/转入基金当日基金份额净值

基金转换费=转出基金赎回费+转入基金申购费补差



例：某投资者（非养老金客户）持有长城货币市场证券投资基金 10 万份基金份额，决定转换为本基金 A 类基金份额，假设转换当日本基金 A 类基金份额的份额净值是 1.100 元，转出基金（长城货币市场证券投资基金）份额净值是 1.000 元，转出基金对应赎回费率为 0，申购补差费率为 0.8%，则可得到的转换份额及基金转换费计算如下：

转出金额 =  $100,000 \times 1 = 100,000$  元

转出基金赎回费 = 0

转入总金额 =  $100,000 - 0 = 100,000$  元

转入基金申购费补差 =  $100,000 - 100,000 / (1 + 0.8\%) = 793.65$  元

转入净金额 =  $100,000 - 793.65 = 99,206.35$  元

转入份额 =  $99,206.35 / 1.100 = 90,187.59$  份

基金转换费 =  $0 + 793.65 = 793.65$  元

②如转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率

基金转换费用 = 转出金额  $\times$  转出基金赎回费率

例：某投资者（非养老金客户）持有 10 万份本基金 A 类基金份额，持有期为 100 天，决定转换为长城货币市场证券投资基金，假设转换当日本基金 A 类基金份额的份额净值是 1.150 元，转出基金对应赎回费率为 0.1%，申购补差费率为 0，则可得到的转换份额及基金转换费计算如下：

转出金额 =  $100,000 \times 1.15 = 115,000$  元

转出基金赎回费 =  $115,000 \times 0.1\% = 115$  元

转入总金额 =  $115,000 - 115 = 114,885$  元

转入基金申购费补差 = 0

转入净金额 =  $114,885 - 0 = 114,885$  元

转入份额 =  $114,885 / 1 = 114,885$  份

基金转换费 =  $115,000 \times 0.1\% = 115$  元

(2)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率的基金)，以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用；如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时，申购补差费用视为 0。

(3)转出基金赎回费的 25%计入转出基金资产（基金合同或招募说明书另有规定的除外）。

(4)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行，对于通过本公司网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务，按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

4、本基金申购费由申购者承担，不列入基金财产。申购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25%归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金

份额持有人大会决议通过。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上公告。

#### (五)基金税收

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及《长城稳固收益债券型证券投资基金基金合同》的要求，并结合本基金管理人对基金实施的投资管理活动，对 2016 年 3 月 11 日刊登的本基金的招募说明书进行了更新，更新的主要内容如下：

- 1、在“重要提示”中，更新了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期。
- 2、在第三部分“基金管理人”中，更新了基金管理人情况及主要人员情况。
- 3、在第四部分“基金托管人”中，更新了基金托管人的信息。
- 4、在第五部分“相关服务机构”中，更新了代销机构信息。
- 5、在第七部分“基金份额的申购与赎回”中，更新了基金转换和定期定额投资的内容。
- 6、在第八部分“基金的投资管理”中，更新了投资组合报告内容，披露截至 2016 年 6 月 30 日的的数据。
- 7、在第九部分“基金的业绩”中，披露了截至 2016 年 6 月 30 日本基金的业绩数据。
- 8、在第二十一部分“其他应披露的事项”中，披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司

2016 年 9 月 9 日