

# 长城久盈纯债分级债券型证券投资基金更新的招募说明书

## 摘要

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

二一七年十二月

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金经 2014 年 7 月 23 日中国证券监督管理委员会《关于核准长城久盈纯债分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]738 号文）注册募集。基金合同于 2014 年 10 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，并经中国证监会核准。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 2017 年 10 月 27 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

本招募说明书更新情况说明中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人中国建设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、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金等四十三只基金。

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党委委员，宝城期货有限责任公司董事长。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，长城证券股份有限公司纪委书记、副总经理。

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。现任上海市互联网金融行业协会会长，通联支付网络股份有限公司董事。曾任中国人民银行资金管理处处长，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党委书记、总裁，上海国际集团党委副书记、副董事长、总经理，国泰君安证券股份有限公司党委书记、董事长，证通股份有限公司董事长。

徐英女士，独立董事，学士。现已退休。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，新华资产管理股份有限公司副董事长。

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、天津滨海新区新兴产业公司，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。

杨斌先生，监事，硕士。现任东方证券股份有限公司首席风险官、合规总监。曾就职于中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处，自1998年7月至2015年5月先后于上海证监局稽查处、案件审理处、案件调查一处、机构监管一处、期货监管处、法制工作处等部门任职，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长、处长。

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，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、信息技术部总经理。

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、研究部总经理、投资决策委员会委员、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、长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，期间曾任公司总经理助理。

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

蔡旻先生，FRM，厦门大学金融工程学士、硕士。具有7年证券从业经历。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，长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、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基金经理。自2015年5月11日至今任长城稳健增利债券型证券投资基金基金经理，自2015年12月15日至今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日至今任长城久盈纯债分级债券型证券投资基金和长城久惠保本混合型证券投资基金基金经理，自2016年6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，自2016年11月11日至今任长城久稳债券型证券投资基金基金经理，自2017年7月27日至今任长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金和长城久信债券型证券投资基金基金经理。

长城久盈纯债分级债券型证券投资基金历任基金经理如下：史彦刚先生自2014年10月28日至2016年6月29日担任本基金的基金经理。

## 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，投资决策委员会委员，公司副总经理、投资总监兼基金管理部总经理、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）基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》2016中国最佳银行，《环球金融》2016中国最佳消费者银行、2016亚太区最佳流动性管理银行，《机构投资者》人民币国际化服务钻石奖，《亚洲银行家》中国最佳大型零售银行奖及中国银行业协会年度最具社会责任金融机构奖。本集团在英国《银行家》2016年世界银行1000强排名中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二) 主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玘，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## (三) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持以客户为中心的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》中国最佳托管银行、中国最佳次托管银行、最佳托管专家QFII等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家最佳托管银行。

## 三、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### (1) 长城基金管理有限公司深圳直销中心



地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

电话：0755-23982244

传真：0755-23982259

联系人：黄念英

(2) 长城基金管理有限公司北京直销中心

地址：北京市西城区金融街 7 号英蓝国际金融中心大厦 916、917 室

电话：010-88091157

传真：010-88091075

联系人：王玲

(3) 长城基金管理有限公司上海直销中心

地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 1804 室

电话：021-51150756

传真：021-51150756

联系人：邱文勋

(4) 网上直销

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅本公司网站相关信息。

网址：<https://etrade.ccfund.com.cn/etrading/>

## 2、代销机构

(1) 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)

(2) 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

联系人：宋亚平

客服电话：95566

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(3) 招商银行股份有限公司

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)

(4) 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

(5) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

电话：010-66223588

传真：010-66226045

联系人：孔超

客户服务电话：95526

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

(6) 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

电话：0769-22866270

传真：0769-22320896

联系人：杨亢

客服电话：0769-961122

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

(7) 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

联系人：董培姗

联系电话：0595-22551071

客服电话：400-8896-312

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

(8) 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)

(9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

电话：010-56367136

传真：010-57092611

联系人：穆婷

客户服务电话：95568

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

（10）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：冯博

电话：021-50979511

传真：021-50979375

客户服务电话：95511-3

网址：<http://bank.pingan.com/>

（11）武汉农村商业银行股份有限公司

住所：武汉市江岸区建设大道 618 号

法定代表人：徐小建

联系人：邹君

联系电话：027-85497270

客服热线：96555

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

（12）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](http://www.ebscn.com)

（13）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)

（14）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：王常青

电话：010-85130577

联系人：权唐

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

客户服务电话：4008888108

（15）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

（16）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

客户服务电话：4008-888-818

公司网站：www.hx168.com.cn

（17）申万宏源证券股份有限公司

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

（18）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

（19）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

（20）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

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

(21) 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)

(22) 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)

(23) 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：高涛

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](http://www.china-invs.cn)

(24) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号大成大厦 6 层

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-83252182

传真：010-63080978

客服电话：95321

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

(25) 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

电话：010-66568450

联系人：宋明

客户服务电话：4008-888-888

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

(26) 广州证券有限责任公司

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：刘东

联系人：林洁茹

电话：020-88836999

传真：020-88836654

客户服务电话：020-961303

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

(27) 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 027-85808318

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

(28) 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：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务电话：4008209898

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

(29) 西部证券股份有限公司

住所：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：梁承华

电话：029-87406168

传真：029-87406387

客服热线：95582

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

(30) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际大厦

法定代表人：徐丽峰

联系电话：0791-86281305

联系人：周欣玲

客户服务电话：4008222111

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

(31) 渤海证券股份有限公司

住所: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址: 天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人: 王春峰

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.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

(32) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市淮海中路 98 号

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 王开国

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 沈笑天

客服电话: 95553、4008888001

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

(33) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人: 杨德红

联系人: 芮敏祺

电话: 021-38676666

传真: 021-38670666

客户服务热线: 4008888666

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

(34) 中国国际金融有限公司

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](http://www.cicc.com.cn)

(35) 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: 95310

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

(36) 方正证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层

法定代表人：何其聪

联系人：高洋

联系电话：010-59355546

客服电话：95571

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

(37) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：俞洋

电话：021-64339000

传真：021-54967032

联系人：丁晨

客服电话：95323

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

(38) 南京证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 389 号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

客服电话：95386

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

(39) 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

地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 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)

(40) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：陈柏青

联系人：顾祥柏

电话：13918979642

客服电话：95188

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

(41) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：徐诚

联系电话：021-38509636

客服电话：400-821-5399

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

(42) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址: 北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址: 北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人: 闫振杰

联系人: 马林

联系电话: 010-59601366-7024

客服电话: 4008188000

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

(43) 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)

(44) 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)

(45) 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)

(46) 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)

(47) 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)



(48) 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)

(49) 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：李兴春

联系人：徐雪吟

联系电话：021-50583533-3011

客服电话：400-921-7755

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

(50) 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)

(51) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：黄妮娟

联系电话：021-54509998

客服电话：400-1818-188

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

(52) 深圳金斧子投资咨询有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼

法定代表人：赖任军

联系人：张焯

电话：0755-66892301

传真：0755-66892399

客服电话：400-9500-888

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

(53) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：陈超

联系人：徐伯宇

电话：01089189285

传真：010-89188000

客服电话：4000988511/4000888816

网址：kenterui.jd.com

（54）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：马怡

电话：010-56282140

客服电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

（55）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：钱燕飞

联系人：王峰

电话：025-66996699-887226

客服电话：955177

网址：www.snjjjin.com

（56）上海万得投资顾问有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：王廷富

联系人：徐亚丹

电话：13818306630

客服电话：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

（57）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人：张彦

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

（58）上海挖财金融信息服务有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：胡燕亮

联系人：李娟

电话：15002933896

客服电话：021-50810687

网址：www.wacaijijin.com

（59）江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：江苏省南京市中山东路9号天时国际商贸大厦11楼E座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：17612154686

传真：021-53086809

客服电话：025-56663409

网址：www.huilinbd.com

(60) 上海云湾投资管理有限公司

住所：上海市浦东新区锦康路308号世纪金融广场6号楼6楼

法定代表人：戴新装

联系人：范泽杰

客服电话：400-820-1515

公司网站：www.zhengtongfunds.com

(61) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司

注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号泰康金融中心38层

法定代表人：张冠宇

联系人：刘美薇

电话：010-85870662

传真：4008875666-129666

客服电话：400-819-9868

网址：www.tdyhfund.com

(62) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司

住所：北京西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：徐越

客服电话：400-001-1566

公司网站：www.yilucaifu.com

(63) 奕丰金融服务（深圳）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（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TANYIKKUAN

联系人：叶健

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

基金管理人可根据业务发展需要，选择其他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：张学兵

电话：0755-33256666

传真：0755-33206888

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：NgAlbertKongPing 吴港平

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：李妍明

## 四、基金的名称

本基金名称：长城久盈纯债分级债券型证券投资基金

## 五、基金的类型和运作方式

本基金类型：债券型

本基金运作方式：契约型

## 六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

## 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，包括国内依法发行上市的国债、金融债券、次级债券、可转换债券(含分离交易可转债)、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、质押及买断式回购、协议存款、通知存款、定期存款、资产支持证券等金融工具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)。

本基金不直接参与股票、权证投资，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起90个交易日内卖出。

本基金的投资组合比例为：债券的投资比例不低于基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。

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。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金采用自上而下的策略进行基金的大类资产配置，主要通过对宏观经济运行周期、财政政策、货币政策、利率走势、证券市场估值水平等可能影响资本市场的重要因素进行研究和预测，分析债券市场、债券品种、现金等大类资产的预期风险和收益，动态调整基金大类资产的投资比例，以控制系统性风险。本基金将择机利用债券回购交易放大组合债券资产杠杆，在严格控制信用风险、流动性风险的基础上增强基金整体收益。

### 2、固定收益类资产投资策略

本基金通过综合分析宏观经济形势、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。本基金具体投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、债券回购杠杆策略等。

#### （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、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。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

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对等方面的分析结果，考察信用产品相对利率产品的信用溢酬，结合市场情绪，动态调整利率产品和信用产品的配置比例，获取超越业绩基准的超额收益。本基金将主要依托公司内部的债券信用评级系统对持有债券的信用评级进行持续跟踪，防范信用风险。

#### （4）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。

#### （5）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。

#### （6）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。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数。

中国债券综合全价指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的中国债券综合全价指数作为业绩比较基准。

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

出现更加适用于本基金的业绩比较基准时，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混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。从投资者具体持有的基金份额来看，在基金合同生效后每个分级运作期内，由于基金收益分配的安排，久盈 A 份额将表现出低风险、低收益的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额；久盈 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额。

#### 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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 11 月 20 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。

1、本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。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	--	--
---	------	----	----

其中：股票	--	--	--
-------	----	----	----

2	基金投资	--	--
---	------	----	----

3	固定收益投资	1,268,021,552.90	97.70
---	--------	------------------	-------

其中：债券	1,268,021,552.90	97.70	
-------	------------------	-------	--

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	5,031,907.71	0.39
---	--------------	--------------	------

8	其他资产	24,837,019.65	1.91
---	------	---------------	------

9	合计	1,297,890,480.26	100.00
---	----	------------------	--------

#### 2、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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	25,946,100.00	2.53
---	------	---------------	------

2	央行票据	--	--
---	------	----	----

3	金融债券	418,198,000.00	40.81
---	------	----------------	-------

其中：政策性金融债	293,685,000.00	28.66	
-----------	----------------	-------	--

4	企业债券	585,981,452.90	57.19
---	------	----------------	-------

5	企业短期融资券	--	--
---	---------	----	----

6	中期票据	171,157,000.00	16.70
---	------	----------------	-------

7	可转债（可交换债）	--	--
---	-----------	----	----

8	同业存单	66,739,000.00	6.51
---	------	---------------	------



9 其他 --

10 合计 1,268,021,552.90 123.75

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	170215 17 国开 15	1,000,000	100,430,000.00	9.80
---	-----------------	-----------	----------------	------

2	1623005 16 联合财险	1,000,000	94,570,000.00	9.23
---	-----------------	-----------	---------------	------

3	136859 16 鲁通 02	800,000	79,384,000.00	7.75
---	-----------------	---------	---------------	------

4	112478 16 奥燃 03	800,000	78,168,000.00	7.63
---	-----------------	---------	---------------	------

5	170210 17 国开 10	700,000	68,593,000.00	6.69
---	-----------------	---------	---------------	------

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股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金为债券型基金，不得参与股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金为债券型基金，不得参与股指期货交易。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

注：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。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

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。

11、投资组合报告附注

11.1

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。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	11,548.57
---	-------	-----------

2	应收证券清算款	-
---	---------	---

3	应收股利	-
---	------	---

4	应收利息	24,825,471.08
---	------	---------------

5	应收申购款	-
---	-------	---

6	其他应收款	-
---	-------	---

- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 24,837,019.65

#### 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。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

过往一定阶段本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

(截至 2017 年 9 月 30 日)

时间段 净值增长率 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率标准差 -- --

基金合同生效日（2014 年 10 月 28 日）至 2014 年 12 月 31 日 0.80% 0.28% 0.45% 0.18% 0.35% 0.10%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 26.19% 0.57% 4.19% 0.08% 22.00% 0.49%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 7.65% 0.21% -1.63% 0.09% 9.28% 0.12%

2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日 -1.18% 0.30% -2.26% 0.07% 1.08% 0.23%

基金合同生效日（2014 年 10 月 28 日）至 2017 年 9 月 30 日 35.32% 0.39% 0.63% 0.09% 34.69% 0.30%

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）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、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、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。

### （二）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 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \times \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，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% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 3、基金销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

久盈 A 的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提；久盈 B 自 2014 年 10 月 28 日至 2015 年 1 月 4 日按前一日基金资产净值的 0.4% 年费率计提销售服务费，自 2015 年 1 月 5 日起不再计提销售服务费。

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 4—9 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。

### （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）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《长城久盈纯债分级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 2017 年 6 月 10 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、更新了重要提示的内容，明确了招募说明书所载内容截止日期与有关财务数据、净值表现截止日期等信息。
- 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，更新了代销机构的信息。
- 5、在第十一部分基金的投资中，更新了投资组合报告内容，披露截至 2017 年 9 月 30 日的的数据。
- 6、更新了第十二部分基金的业绩数据，披露了截至 2017 年 9 月 30 日本基金的业绩数据。

7、更新了第二十四部分其他应披露的事项，并披露了本期已刊登的公告事项。

长城基金管理有限公司

2017年12月9日