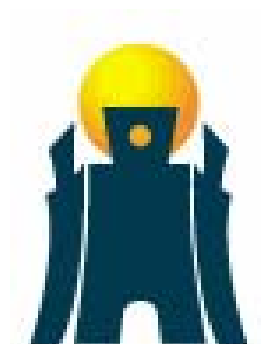


长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF) (原久富证券投资基金转型) 二〇〇七年半年度报告



报告期间：2007 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：交通银行股份有限公司

披露日期：2007 年 8 月 25 日

第一节 重要提示及目录

（一）重要提示

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)由原久富证券投资基金转型而成。依据中国证监会2007年1月31日证监基金字[2007]25号文核准的久富证券投资基金基金份额持有人大会决议,久富证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金、调整存续期限、终止上市、调整投资目标、范围和策略、修订基金合同和招募说明书,并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金”。《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》自久富基金终止上市之日即2007年2月12日起生效,原《久富证券投资基金基金合同》自同一起失效。

长城久富核心成长股票型证券投资基金管理人—长城基金管理有限公司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—交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年8月17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,投资者在做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。原久富证券投资基金本报告期自2007年1月1日至2007年2月11日止,长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)本报告期自2007年2月12日起至2007年6月30日止。

（二）目录

第一节 重要提示及目录	2
（一）重要提示	2
（二）目录	3
第二节 基金简介	5
（一）基金基本情况	5
（二）基金投资基本情况	5
（三）基金管理人	6
（四）基金托管人	6
（五）信息披露方式	7
（六）注册登记机构	7
第三节 主要财务指标和基金净值表现	7
（一）主要财务指标（2007年1月1日—2007年6月30日）	7
（二）基金净值表现	8
第四节 管理人报告	9
（一）基金管理人及基金经理情况	9
（二）本报告期基金运作遵规守信情况声明	10
（三）报告期内投资策略和业绩表现说明及解释	10
（四）宏观经济、证券市场及行业走势简要展望	11
第五节 托管人报告	12
第六节 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)财务会计报告（未经审计）	12
（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)半年度会计报表	12
（二）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)半年度会计报表附注	14
第七节 久富证券投资基金财务会计报告（未经审计）	30
（一）久富证券投资基金半年度会计报表	30
（二）久富证券投资基金半年度会计报表附注	32
第八节 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)投资组合报告	40
（一）期末基金资产组合情况	40
（二）期末按行业分类的股票投资组合	40
（三）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细	41
（四）报告期内投资组合的重大变动	44
（五）按券种分类的债券组合	46
（六）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	46
（七）期末按市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	46
（八）投资组合报告附注	46
第九节 久富证券投资基金投资组合报告	47
（一）期末（2007年2月11日）基金资产组合情况	47

（二）期末（2007 年 2 月 11 日）按行业分类的股票投资组合.....	47
（三）期末（2007 年 2 月 11 日）按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	48
（四）报告期内（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）投资组合的重大变动.....	49
（五）按券种分类的债券组合.....	50
（六）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.....	51
（七）期末按市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.....	51
（八）投资组合报告附注.....	51
第十节 基金份额持有人户数、持有人结构	52
第十一节 开放式基金份额变动	53
第十二节 重大事件揭示	54
第十三节 备查文件目录	58

第二节 基金简介

（一）基金基本情况

1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

基金简称：长城久富

交易代码：162006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2007年2月12日

报告期末基金份额总额：7,585,953,664.21份

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2007年5月18日

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

2、原久富证券投资基金

基金简称：基金久富

交易代码：184720

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：2001年12月18日

报告期末（2007年2月11日）基金份额总额：5亿份

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：2002年4月18日

终止上市日期：2007年2月12日

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

（二）基金投资基本情况

1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

投资目标：投资于具有核心竞争力的企业，分享其在中国经济高速、平稳增长背景下的持续成长所带来的良好收益，力争为基金持有人实现稳定的超额回报。

投资策略：本基金投资的核心策略是“自下而上、精选个股”，同时根据市场偏好适度配置主题类资产以保持组合的均衡性。精选原则将继承基金久富以往富有成效的核心企业评价体系，以“具备核心竞争力、能够在市场中获取超额收益的企业”为主，构建均衡的投资组合。

业绩比较基准： $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中信全债指数收益率}$ 。

风险收益特征：本基金是较高预期收益较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

2、原久富证券投资基金

投资目标：本基金属于价值型投资基金，主要投资于价值被低估的股票，通过组合投资，在注重流动性和规避投资风险的前提下，谋求基金资产的稳定增长。

投资策略：由于存在不同的市场，且即使在同一市场也存在市场的细分，本基金注重股票相对投资价值的研究，主要投资于股票价格明显低于市场合理预期价值（价格）的公司股票。本基金在分析价值是否低估时主要依据市盈率指标，但是不排除使用其他指标。

基金业绩比较基准：无

基金风险收益特征：无

（三）基金管理人

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41层

邮政编码：518026

法定代表人：杨光裕

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：交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

邮政编码：200120

法定代表人：蒋超良

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：zhangyd@bankcomm.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、上海证券报、中国证券报

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

（六）注册登记机构

名称：中国证券登记结算公司深圳分公司

办公地址：深圳市深南中路1093号中信大厦18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（2007 年 1 月 1 日—2007 年 6 月 30 日）

单位：人民币元

序号	主要财务指标	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日	
		转型后	转型前
		(2007. 2. 12-2007. 6. 30)	(2007. 1. 1-2007. 2. 11)
1	基金本期净收益	533, 210, 720. 19	124, 777, 075. 99
2	基金份额本期净收益	0. 0706	0. 2496
3	期末可供分配基金收益	469, 507, 081. 89	433, 392, 141. 67
4	期末可供分配基金份额收益	0. 0619	0. 8668
5	期末基金资产净值	9, 754, 641, 983. 03	1, 356, 386, 249. 92
6	期末基金份额净值	1. 2859	2. 7128

7	基金加权平均净值收益率	6.01%	9.65%
8	本期基金份额净值增长率	39.25%	14.92%
9	基金份额累计净值增长率	39.25%	172.70%

（二）基金净值表现

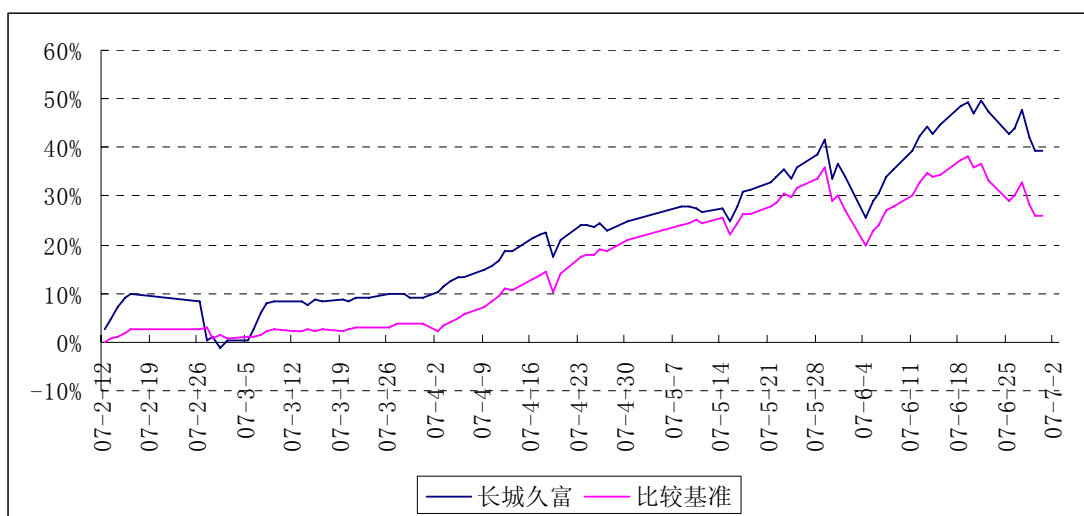
1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

（1）长城久富本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	1.80%	2.49%	-3.16%	2.29%	4.96%	0.20%
过去三个月	27.65%	2.04%	21.39%	1.90%	6.26%	0.14%
07-2-12 至 07-6-30	39.25%	1.99%	26.06%	1.59%	13.19%	0.40%

（2）长城久富净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

（2007年2月12日至2007年6月30日）



注：

（1）基金久富于2007年2月12日由封闭式基金转为开放式基金，并更名为长城久富。

（2）本基金合同规定，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%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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。

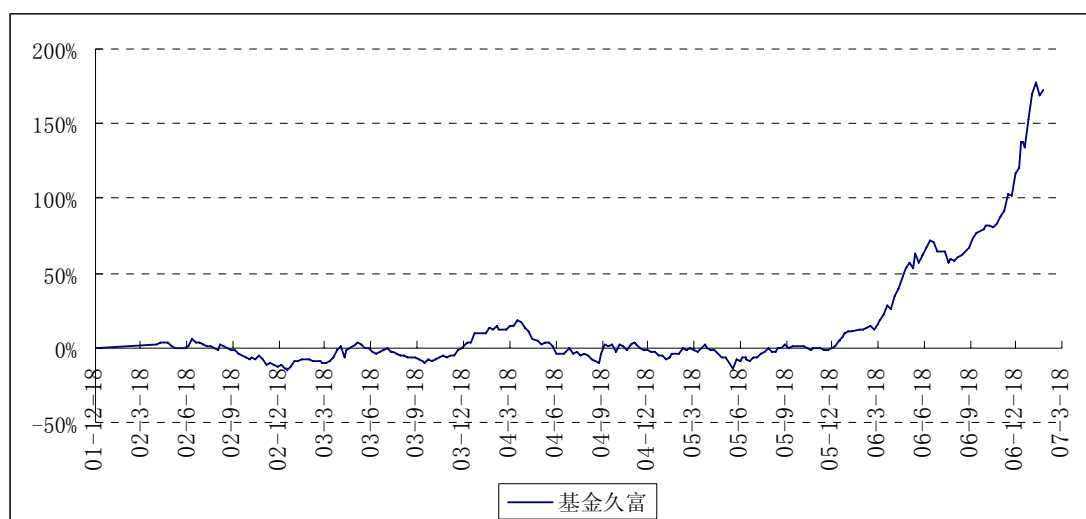
2、原久富证券投资基金

(1) 基金久富本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
07-1-5 至 07-2-9	14.92%	4.37%	—	—	—	—
06-7-7 至 07-2-9	58.50%	3.07%	—	—	—	—
06-1-6 至 07-2-9	161.44%	3.05%	—	—	—	—
04-1-2 至 07-2-9	164.01%	2.76%	—	—	—	—
原封闭式基金基 金合同生效以来 至 07-2-9	172.70%	2.54%	—	—	—	—

(2) 基金久富净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

(自成立以来至 2007 年 2 月 9 日)



注：基金久富无业绩比较基准。

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由长城证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、西北证券有限责任公司、北方国际信托投资股份有限公司、中原信托投资有限公司共同发起设立，经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，2001 年 12 月 27 日在深圳注册成立，注册资

本为 1 亿元人民币。公司经营范围是发起设立基金、管理基金及中国证监会批准的其他业务。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、长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）。

2、基金经理简介

项志群先生，生于 1969 年，哈尔滨工业大学计算机工程及其应用系工学学士。曾就职于航天 CAD 开发有限公司程序员、经易期货有限公司证券业务室、海南省证券公司交易管理部，2001 年 11 月进入长城基金管理有限公司，曾任集中交易室交易主管，自 2005 年 3 月 26 日起至今任“久富证券投资基金”基金经理，该基金现转型为“长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）”。

“久富证券投资基金”历任基金经理如下：许良胜先生自 2001 年 12 月 18 日该基金成立日起至 2005 年 3 月 25 日任该基金基金经理。

（二）本报告期基金运作合规守信情况声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长股票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，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）报告期内投资策略和业绩表现说明及解释

2007 年上半年久富基金经历了转型、募集、建仓等过程，因此净值表现是不连续和分段的，净值增长约 60%，同期中标 300 指数上涨 85.4%，较指数表现要差。报告期内，虽然变动较大，但久富的核心投资策略没有变化，依然坚持了我们以往的投资理念，但期间的操作则是我们需要反思与总结的重点部分。上半年，市场的主基调基本是在极为乐观的情绪与预期的驱使下勇往直前，总体估值迅速上升，特别是在我们重点建仓的二季度，很难用合适的价格买到我们可以信赖的长期资产，因此在操作策略的制定与执行方面存在着较大的波动，由初期的类指数化投资到重点投资为主的变化短暂而仓促，同时在重点投资的集中度等方面的处理也比较被动这是我们非常遗憾的事，虽然其间的主要过程就是建仓与为应对赎回而主动

建仓，但操作绩效乏善可陈，主要问题在于我们对于市场偏好没有以往关注，而是重点在调研上市为长期投资作准备。因为期内的估值水平的变化实在是无法用正常与连贯性思维加以评估，因此我们的工作重心唯有落在寻找与确认长期可投资资产上面。

在当前市况下，我们只能把投资者委托的资金投到长期目标上，因此目标的长期价值及盈利能力是我们关注的核心，同时目标的抗风险能力与市场整合能力决定了目标在估值方面的稳定性与弹性，而且在目前整体经济高速发展的前提下，公司在战略制定、执行与修订能力的重要性凸现出来，因此对目标公司在以往治理结构、创新能力、抗风险能力、市场整合能力等要素的基础上，增加对公司发展战略的认知，以及随时关注其执行与反馈情况。

我们的核心策略依然秉承自下而上精选个股原则，注重长、中、短期的资产类配置，我们的组合是建立在这一基础之上的，因此即便是目前市场的波动较大，但我们不会有大的变化，但因为估值偏高，所以二季度我们在短期类资产的配置上比较弱化，在减持过程中我们也是以清理短期资产为主，目前组合基本是中、长期类资产配置，这也是我们在市场偏好方面弱化的主要原因。同时对于组合的中、长期表现我们信心依旧，虽然上年变动较大业绩不连续且表现难如人意，但我们认为只需要些时间，对于中国的资本市场我们坚定的中长期看好，短期波动是我们的机会，也希望我们的基金持有人都增加些信心与耐心，在我国经济的黄金发展期内不要因市场波动而错失分享市场发展的黄金机会。

总的来说，上半年我们对投资理念的坚持还是获得了一定的回报，但在牛市的行情里显得效率不高，另一方面，我们组合的持续性延续了一贯的原则，但在波动性上因以长期资产为主，没有进行波段操作，因此波动基本与市场同步，表现较以往要差，这将是今后要修正的重点。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

对于目前的市场，我们认为重点还是在如何看待宏观经济格局的变化趋势与资本市场的价值评估这两方面。对此我们认为：1、宏观调控是持续而富有力度的，但调控最终目标还是在经济结构，因此经济大波动的可能性不大，对整体经济形势依然看好；2、资本市场处于最具吸引力的时期牛市格局难以改变；3、汇率改革稳中求进，我国的核心竞争力“成本优势”并未受到大的冲击，升值是资本市场中长期的主体；4、经济中的矛盾目前体现在要素价格的快速上涨，而且加重了结构性矛盾，特别是土地、矿产等资源的价格上涨难以控制，需要在制度变革方面加以突破，特别是物业税、燃油税、资源税、环境税等应该及时加以试点、制定、实行，特别是物业税应及早推出，不宜等到房贷总额较大时再推出；5、创新将是整个社

会的主题，同时节能减排成为产业结构调整的重要驱动因素，对此我们将加大关注与支持力度；6、最需要关注各种该出而未出的税制进程。

对于证券市场而言，市场的结构性问题依然存在，还是在投资者理念与结构，战略投资者层次的建设，制度的完备，市场的开放程度以及创新追求等方面，因此依然会有较大的波动性，同时需要时间与耐心，我们强调用成长性来平滑当前的高估值。我们看好消费及服务、电力设备、机械、新材料、基础建设等行业；节能减排与高成长性的中小企业有明显的投资机会；房地产投资短期看好，长期谨慎；而医药在整顿后有可能存在超出预期的投资机会。

第五节 托管人报告

2007 年上半年，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007年上半年，长城基金管理有限公司在本基金投资运作、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，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。托管人根据证监会的有关规定，对基金存在持有个别股票市值占基金资产净值超过10%的情况，对基金管理人进行了提示，基金管理人根据规定进行了调整。

2007 年上半年，由长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

第六节 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)财务会计报告（未经审计）

（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF) 半年度会计报表

1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007 年 6 月 30 日资产负债表

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款		857,698,468.11
清算备付金		631,835,675.36

交易保证金		3,385,827.94
应收证券清算款		0.00
应收股利		44,344.11
应收利息	1	442,426.96
应收申购款		6,434,548.53
其他应收款		0.00
股票投资市值		8,375,308,385.03
其中：股票投资成本		6,208,675,017.17
债券投资市值		4,150,129.94
其中：债券投资成本		3,443,668.76
权证投资市值		2,200,868.16
其中：权证投资成本		0.00
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		9,881,500,674.14
负债：		
应付证券清算款		0.00
应付赎回款		104,983,575.49
应付赎回费		395,664.88
应付管理人报酬		12,825,063.61
应付托管费		2,137,510.60
应付销售服务费		0.00
应付佣金	3	5,054,179.73
应付利息		0.00
应付收益		0.00
未交税金		0.00
其他应付款	4	1,250,000.00
卖出回购证券款		0.00
短期借款		0.00
预提费用	5	212,696.80
其他费用		0.00
负债合计		126,858,691.11
持有人权益：		0.00
实收基金	6	7,585,953,664.21
未实现利得	7	1,699,181,236.93
未分配收益		469,507,081.89
持有人权益合计		9,754,641,983.03
负债及持有人权益总计		9,881,500,674.14
附注：每份基金份额净值		1.2859

2、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007年2月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间经营业绩表

单位：人民币元

项 目	注释	2007年2月12日--2007年6月30日
一、收入		
1、股票差价收入	8	537,704,893.07
2、债券差价收入	9	1,916,085.16
3、权证差价收入	10	10,898,946.57
4、债券利息收入		55,149.00
5、存款利息收入		10,708,442.25
6、股利收入		26,055,057.89
7、买入返售证券收入		0.00
8、其他收入	11	4,474,820.30
收入合计		591,813,394.24
二、费用		
1、基金管理人报酬		49,322,577.30
2、基金托管费		8,220,429.53
3、基金销售服务费		0.00
4、卖出回购证券支出		0.00
5、利息支出		0.00
6、其他费用	12	1,059,667.22
其中：上市年费		22,848.82
信息披露费		114,245.49
审计费用		22,848.82
费用合计		58,602,674.05
三、基金净收益		533,210,720.19
加：未实现利得		1,746,546,588.95
四、基金经营业绩		2,279,757,309.14

3、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007年2月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间收益分配表

单位：人民币元

项目	注释	2007年2月12日--2007年6月30日
本期基金净收益		533,210,720.19
加：期初基金净收益		433,392,141.67
本期损益平准金		-42,018,940.86
可供分配基金净收益		924,583,921.00
加：以前年度损益调整		0.00
减：本期已分配基金净收益	13	455,076,839.11

其中：本期已分配基金净收益		300,000,000.00
本期因基金转型拆分折算而转为份额的收益		155,076,839.11
期末基金净收益		469,507,081.89

4、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF) 2007年2月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日止期间基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	注释	2007年2月12日--2007年6月30日
一、期初基金净值		1,356,386,249.92
二、本期经营活动：		
已实现基金净收益		533,210,720.19
未实现利得		1,746,546,588.95
经营活动产生的基金净值变动数		2,279,757,309.14
三、本期基金单位交易：		
基金申购款		10,149,428,558.83
其中：因转型拆分份额折算产生的变动数		640,424,000.00
基金赎回款		-3,575,853,295.75
基金单位交易产生的基金净值变动数		6,573,575,263.08
四、本期向持有人分配收益：		
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		-455,076,839.11
其中：本期因基金转型拆分折算而转为份额的收益		-155,076,839.11
五、期末基金净值		9,754,641,983.03

(二) 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)半年度会计报表附注

1、基金的基本情况

长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)的前身为久富证券投资基金,后经久富证券投资基金 2007 年 1 月 15 日召开的基金份额持有人大会通过,并经中国证监会证监基金字[2007]25 号《关于核准久富证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准及深圳证券交易所深证复[2007]11 号《关于同意久富证券投资基金终止上市并转型为上市开放式基金的批复》的同意,久富证券投资基金终止上市权利登记日为 2007 年 2 月 9 日,终止上市日为 2007 年 2 月 12 日。原《久富证券投资基金基金合同》于终止上市日起失效,《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》于同一日(2007 年 2 月 12 日)起生效,同时基金久富更名为长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)。基金久富于基金合同失效前一日经审计的基金资产净值为 1,356,386,249.92 元,于长城久富核心成长股票型证券投资基

金（LOF）基金合同生效日转入长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）。长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）为契约型开放式，存续期限不定。长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）的基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司，基金注册登记人为中国证券登记结算公司深圳分公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）的投资范围为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。

2、财务报表编制基准

本基金财务报表依照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号-半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号-会计报表附注的编制及披露》及基金合同的规定编制和披露。

3、本报告所采用的主要会计政策和会计估计：

(1). 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。惟本期会计报表的实际编制期间为 2007 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日。

(2). 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

(3). 记账基础和计价原则

本基金以权责发生制为记账基础，以历史成本为计价原则，期末股票、债券和权证按市值计价。

(4). 基金资产的估值原则

本基金资产的估值原则系依据《证券投资基金会计核算办法》和《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）基金合同》制定。

估值对象为基金所持有的股票、债券和银行存款等。

本基金本次报告之基金资产的估值日为 2007 年 6 月 30 日，惟证券市价以 2007 年 6 月 29 日（星期五）市场交易收盘价为准。

银行存款、清算备付金，是指本基金存放于银行及中国证券登记结算有限责任公司的货币资金，按本金估值，并按本金与所适用的利率逐日计提利息并计入“应收利息”科目。

上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值；已上市但流通受限制的新股按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

未上市股票应区分以下情况处理：送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；首次公开发行的股票，按成本估值。

证券交易所交易的债券以不含息价格计价，按估值日证券交易所挂牌的市场交易收盘价计算后的净价估值；该日无交易的，以最近交易日净价估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息。

银行间市场交易和未上市流通的债券以不含息价格计价，按成本估值，并按债券面值与票面利率扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券持有期间内逐日计提利息。

上市流通的权证以估值日证券交易所挂牌的该权证市场收盘价估值，该日无交易的，以最近一个交易日市场收盘价估值。

处于未上市期间的权证或者不存在活跃市场的权证，例如权证发行至上市日之间等情况，按行业确定的公允价格估值。

因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资按公允价估值。

配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值，如果收盘价等于或低于配股价，则不估值。

如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人可以根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

基金资产按上述原则估值后，按所估价值与成本的差额，计入“未实现利得”科目。

按上述原则估值后计算出的本基金资产总额减去本基金负债总额后的余额即为基金在估值日的净值，将前述基金净值除以当日之基金总份额，即为每基金份额净值。

(5). 股票投资的成本计价方法

股票投资按取得时的实际成本计价, 出售成本采用移动加权平均法计算。当日有买入和卖出时, 先计算成本后计算买卖股票价差。

①买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资按成交日应支付的全部价款入帐。

a. 上交所买入股票成本: 由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成。

b. 深交所买入股票成本: 由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成。

②卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

③上海股票的佣金是按买卖股票成交金额的1%减去经手费及证管费计算。深圳股票的佣金是按买卖股票成交金额的1%减去经手费计算。

(6). 债券投资的成本计价方法

① 买入

a. 买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资, 按应支付的全部价款入账, 如果应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 作为应收利息单独核算, 不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资, 后于权证实际取得日按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本后, 调整债券投资成本。

b. 买入银行间同业市场交易和非上市流通的债券于实际支付价款时确认为债券投资, 按实际支付的全部价款入帐, 如果应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 作为应收利息单独核算, 不构成债券投资成本。

c. 买入返售证券: 通过证券交易所进行的融券业务, 按成交日成交金额确认买入返售证券投资; 通过银行间市场进行融券业务, 按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

② 卖出

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入; 卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售证券交易所交易的债券的成本按移动加权平均法于成交日结转, 出售银行间同业市场交易和非上市流通的债券的成本按移动加权平均法于实际收到全部价款时结转。

③ 债券买卖不计佣金。

(7). 权证投资的成本计价方法

①买入权证于成交日确认为权证投资, 按成交日应支付的全部价款（包括买入金额、买

入经手费、买入证管费、买入结算费）入账。

②由股权分置改革而被动获得的权证在股权分置改革方案实施后的股票复牌日记录所获分配的权证数量，该等权证初始成本为零。

③因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

④卖出权证于成交日确认权证差价收入。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

⑤权证买卖暂不计佣金。

(8). 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已发生的影响每基金份额净值小数后五位，应分摊计入本期和以后各期的费用。按其受益期限在1年内（含1年）逐日平均摊销入费用。

(9). 实收基金

实收基金为对外发行的基金总份额，每份基金份额面值为1元。由于申购（转入）和赎回（转出）引起的实收基金变动于基金申购（转入）确认日及基金赎回（转出）确认日确认。

(10). 未实现利得

未实现利得包括因投资估值及配股权证而产生的未实现估值增值（减值）和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购（转入）或赎回（转出）基金单位时，申购（转入）或赎回（转出）款中包含的按未实现利得占基金资产净值比例计算的金额，于基金申购（转入）确认日或基金赎回（转出）确认日确认。

(11). 损益平准金

损益平准金指在申购（转入）或赎回（转出）基金单位时，申购（转入）或赎回（转出）款中包含的按累计未分配基金净损益占基金净值比例计算的金额，于基金申购（转入）确认日或基金赎回（转出）确认日确认，并于期末全额转入未分配基金净损益。

(12). 收入的确认和计量

A. 股票差价收入：于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

B. 债券差价收入：卖出证券交易所上市债券于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出银行间同业市场交易债券于实际收

到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

C. 权证差价收入：于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

D. 股权分置改革而获得的由非流通股股东支付的现金对价：于股权分置改革方案实施后的股票复牌日冲减股票投资成本，不确认为收入。

E. 债券利息收入：按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除应由债券发行单位代扣代缴的个人所得税后在债券实际持有期内逐日计提入账。

F. 存款利息收入：包括银行存款与清算备付金利息，按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

G. 股利收入：按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

H. 买入返售证券收入：按融出金额与成交利率，在融券期限内采用直线法逐日计提入账。

I. 其他收入：在实际收到时确认收入。

(13). 费用的确认和计量

A. 基金管理人报酬：基金管理人报酬根据《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定按前一日的基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提入账。

B. 基金托管费：基金托管费根据《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提入账。

C. 卖出回购证券支出：卖出回购证券支出按融入资金额及成交利率，在融资期限内采用直线法逐日计提入账。

D. 其他费用

发生的其他费用如果影响每基金份额净值小数点后第五位的，即发生的其他费用大于基金净值十万分之一，应采用待摊或预提的方法，计入基金损益；发生的其他费用如果不影响每基金份额净值小数点后第五位的，即发生的其他费用小于基金净值十万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

(14). 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则为：本基金的每份基金份额享有同等分配权；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；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；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；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；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%；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。

(15). 税项

A. 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字〔1998〕55号、财税〔2001〕61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》和财税（2002）128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》规定：以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税；根据财政部、国家税务总局财税字（2004）78号文《关于证券投资基金税收征策的通知》，自2004年1月1日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税。

B. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字〔1998〕55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》规定：对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；根据财政部、国家税务总局财税字（2004）78号文《关于证券投资基金税收征策的通知》，自2004年1月1日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财税〔2005〕103号文《财政部、国家税务总局关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

C. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税（2002）128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》规定，基金管理人运用基金买卖股票按照2%的税率征收印花税；根据财政部、国家税务总局财税（2005）11号的规定，自2005年1月24日起买卖股票印花税率为0.1%；根据财政部、国家税务总局财税（2007）84号文的规定，自2007年5月30日起买卖股票印花税率为0.3%。

根据财税〔2005〕103号文《财政部、国家税务总局关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

D. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税（2002）128号文《关于开放式证券投资基金有关税收

问题的通知》规定：对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2005〕102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及财税〔2005〕107 号文《有关个人所得税政策的补充通知》，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额。

根据财税〔2005〕103 号文《财政部、国家税务总局关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

4、本报告期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的内容和更正金额。

5、关联方

(1)关联方关系

关联公司名称	与本基金关系	发生的变化
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人	无
交通银行	本基金托管人	无
长城证券有限责任公司	本基金发起人及本基金管理人的主要股东、租赁交易席位	无
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位	无
西北证券有限责任公司	本基金管理人的股东	从 2007 年 5 月 25 日起，西北证券有限责任公司不再属于本基金管理人股东
中原信托投资有限公司	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

注：经长城基金管理有限公司股东会 2007 年第四次会议决议通过，并经中国证监会证监基金字（2007）138 号文批准，西北证券有限责任公司将其所持本基金管理人（长城基金管理有限公司）15%的股权分别转让给其他原有股东，转让后本基金管理人股东分别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%）、中原信托投资有限公司（17.647%）、北方国际信托投资股份有限公司（17.647%）。上述股权变更事项已于 2007 年 5 月 25 日办理完毕工商变更登记手续。

(2)关联方交易

声明：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

①通过关联方席位进行的交易

股票投资

2007年2月12日至2007年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	股票交易金额	股票交易占比
1	长城证券有限责任公司	3,900,166,823.51	34.82%
2	东方证券股份有限公司	4,336,018,153.10	38.71%
	合计	8,236,184,976.61	73.53%

债券和回购交易

2007年2月12日至2007年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	债券交易金额	债券回购金额	债券交易占比	回购交易占比
1	长城证券有限责任公司	0.00	0.00	0.00%	0.00%
2	东方证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00%	0.00%
	合计	0.00	0.00	0.00%	0.00%

权证交易

2007年2月12日至2007年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	权证交易金额	权证交易占比
1	长城证券有限责任公司	0.00	0.00%
2	东方证券股份有限公司	6,671,223.42	27.78%
	合计	6,671,223.42	27.78%

佣金

2007年2月12日至2007年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	佣金	佣金占比
1	长城证券有限责任公司	3,145,128.89	34.75%
2	东方证券股份有限公司	3,475,706.70	38.40%
	合计	6,620,835.59	73.15%

*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本基金关联方报酬

关联方名称	2007年2月12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	49,322,577.30	年费率1.5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
交通银行	8,220,429.53	年费率2.5‰	
合计	57,543,006.83		

③与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期（2007年2月12日至2007年6月30日）未有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

本基金管理人投资本基金的情况

2007年2月12日至2007年6月30日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额（份）	占总份额比例
长城基金管理有限公司	2007年2月12日	2,500,000.00	0.50%
	加：本期增加	3,202,120.00	
	减：本期减少	0.00	
	2007年6月30日	5,702,120.00	0.08%

注：本期基金份额为期初基金份额2,500,000.00份，按照基金转换比例1：2.2808480转换后计算。

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

关联方名称	2007年6月30日	
	持有份额（份）	占总份额比例
长城证券有限责任公司	5,702,120.00	0.08%

除本基金管理人外，本基金管理人主要股东控制的其它机构上期末及本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	2007年6月30日
交通银行	银行存款	857,698,468.11

⑥从关联方取得的利息收入（2007年2月12日至2007年6月30日）

关联方名称	项目	（2007年2月12日至2007年6月30日）
交通银行	存款利息收入	2,199,018.75

⑦关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	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	12,825,063.61
应付基金托管费	交通银行	托管费	2,137,510.60
应付佣金	长城证券有限责任公司	佣金	986,703.74
应付佣金	东方证券股份有限公司	佣金	1,984,049.48
其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金、清算备付金	500,000.00
其他应付款	东方证券股份有限公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
其他应付款	西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
应收利息	交通银行	存款利息	246,565.40
合计			19,179,892.83

6、主要会计报表项目注释

注释 1. 应收利息

2007年6月30日

单位：人民币元

项目	金额
银行存款利息	246,565.40
清算备付金利息	185,645.50
债券利息	10,020.95
权证交易价差保证金利息	45.60
应收 TA 申购利息	149.51
合计	442,426.96

注释 2. 投资估值增值的金额

2007年6月30日

单位：人民币元

项目	金额
股票	2,166,633,367.86
债券	706,461.18
权证	2,200,868.16
合计	2,169,540,697.20

注释 3. 应付佣金

2007年6月30日

单位：人民币元

序号	项目	金额
1	长城证券有限责任公司	986,703.74
2	申银万国证券股份有限公司	1,114,588.07
3	东方证券股份有限公司	1,984,049.48
4	国泰君安证券股份有限公司	136,456.48

5	中银国际证券有限责任公司	832,381.96
6	银河证券有限责任公司	0.00
	合 计	5,054,179.73

注释 4. 其他应付款

2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	经济内容	金额
长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金、清算备付金	500,000.00
西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
东方证券股份有限公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
银河证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
合 计		1,250,000.00

注释 5. 预提费用

2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	金额
上海证券报信息披露费	49,588.57
中国证券报信息披露费	49,588.57
证券时报信息披露费	49,588.57
审计费用	29,752.78
上市年费	29,752.78
银行间账户维护费	4,425.53
合计	212,696.80

注释 6. 实收基金

单位：人民币元

项 目	基金份额（份）	基金面值
2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)	500,000,000.00	500,000,000.00
加：本期申购增加	9,928,836,841.92	9,928,836,841.92
其中：本期转型拆分折算增加	640,424,000.00	640,424,000.00
减：本期赎回减少	2,842,883,177.71	2,842,883,177.71
2007 年 6 月 30 日	7,585,953,664.21	7,585,953,664.21

①根据基金招募说明书及长城久富核心成长股票型证券投资基金(L0F)集中申购期份额发售公告的规定，长城久富核心成长股票型证券投资基金(L0F)自 2007 年 3 月 5 日至 2007 年 4 月 5 日集中申购，集中申购期内，实行限量申购。如果预计申购规模达到或超过 80 亿份左右的目标销售规模时，提前终止本次集中申购活动。

长城久富核心成长股票型证券投资基金（L0F）于 2007 年 3 月 5 日起开始向社会集中申

购。鉴于投资者申购踊跃，根据该基金发售公告的有关规定，申购截止日由原定的 2007 年 4 月 5 日提前至 2007 年 3 月 6 日。

经深圳大华天诚会计师事务所深华(2007)验字 015 号验资报告的审验，截至 2007 年 3 月 12 日，长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)已将原基金份额转换基准日（2007 年 3 月 9 日）基金份额持有人持有的份额净值转换为新的基金份额，转换后的基金份额净值为 1.00 元，基金份额总额为 1,140,424,000.00 元，份额转换时产生的尾差 36.37 元计入“其他收入”中。集中申购数量为 7,934,819,964.27 份基金单位，基金集中申购金额为 7,934,819,964.27 元，其中，集中申购净额为 7,933,111,394.97 元，折算成基金份额的利息 1,708,569.30 元，利息尾差 3,523.88 记入“其他收入”。

②根据《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》和《长城久富核心成长股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定及深圳证券交易所深证上[2007]66 号的上市通知书，长城久富核心成长股票型证券投资基金证券简称为“长城久富”，证券编码为“162006”开始挂牌交易时间为 2007 年 5 月 18 日（星期五）。

注释 7. 未实现利得

2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	金 额
投资估值增值-股票投资	2,166,633,367.86
投资估值增值-债券投资	706,461.18
投资估值增值-权证投资	2,200,868.16
未实现利得平准金-申购	201,635,319.12
未实现利得平准金-赎回	-671,994,779.39
合 计	1,699,181,236.93

注释 8. 股票差价收入

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	金 额
卖出股票成交总额	3,359,453,053.70
减：卖出股票成本总额	2,818,928,277.82
卖出佣金	2,819,882.81
股票差价收入	537,704,893.07

*本基金本报告期因股权分置改革而获得由非流通股股东支付的现金对价为人民币 939.54 元，该等现金对价于股权分置改革方案实施后的股票复牌日冲减股票投资成本。

注释 9. 债券差价收入

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	金额
卖出债券成交总额	46,539,028.04
减：卖出债券成本总额	44,515,469.15
卖出应收利息	107,473.73
债券差价收入	1,916,085.16

注释 10. 权证差价收入

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	金额
卖出权证成交总额	21,145,888.22
减：卖出权证成本总额	10,246,941.65
卖出佣金	0.00
权证差价收入	10,898,946.57

注释 11. 其他收入

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期数
赎回基金补偿收入	4,469,828.49
其他	4,991.81
合 计	4,474,820.30

注释 12. 其他费用

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	金额
上市年费	22,848.82
信息披露费	114,245.49
审计费用	22,848.82
银行费用	1,620.00
银行间帐户维护费及结算服务费用	7,004.09
2006 年分红手续费及账户更名费	891,000.00
深交所账户更名费	100.00
合 计	1,059,667.22

注释 13. 本期已分配基金净收益

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 6 月 30 日

单位：人民币元

分红除息日	每 10 份基金份额分配收益	本次收益分配额	本期累计收益分配额	备注
2007 年 3 月 2 日	6.00	300,000,000.00	300,000,000.00	收益分配
2007 年 3 月 12 日	3.102	155,076,839.11	455,076,839.11	转型拆分*
合计	9.102	455,076,839.11		

* 2007 年 3 月 13 日《关于原久富证券投资基金基金份额转换结果的公告》长城基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已于 2007 年 3 月 12 日对投资者持有的原久富证券投资基金进行了基金份额转换操作。根据转换基准日（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），本基金管理人按照 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 1.0000 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财产。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，其中 155,076,839.11 为本期因基金转型拆分折算而转为份额的收益。

7、本报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2007 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）因重召开股东大会等事项而临时公告而暂时停牌的股票情况：

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	数量	期末估值单价	总成本	期末估值总额	估值方法
000768	西飞国际	2007-5-18	2007-7-16	233,550	30.87	4,408,573.76	7,209,688.50	按股票停牌日的前一日市场收盘价估值
000927	一汽夏利	2007-6-29	2007-7-2	1,200,000	8.36	12,828,000.00	10,032,000.00	
600649	原水股份	2007-6-29	2007-7-2	2,300,500	14.03	31,507,620.61	32,276,015.00	
600663	陆家嘴	2007-6-29	2007-7-2	671,280	25.41	16,908,669.65	17,057,224.80	
600879	火箭股份	2007-6-29	2007-7-2	200,000	26.59	4,053,478.96	5,318,000.00	

（2）因参加一般法人投资者配售方式获配而持有的流通受限制的股票，情况如下：

股票名称	数量	总成本	总市值	受限期限	估值方法	转让受限原因
中环股份	98,899	574,603.19	1,534,912.48	3 个月(自 2007 年 4 月 20 日起)	按估值日在交易所挂牌的同一股票的市场收盘价估值	根据基金与上市公司签订申购协议的规定，在新股上市
沃尔核材	15,964	250,954.08	779,841.40	3 个月(自 2007 年 4 月 20 日起)		
天津普林	95,400	789,912.00	1,670,454.00	3 个月(自 2007 年 5 月 16 日起)		

中国远洋	441,910	3,747,396.80	8,069,276.60	3个月(自2007年6月26日起)		后的约定 期限内不 能自由转 让
中信银行	2,777,500	16,109,500.00	25,553,000.00	3个月(自2007年4月27日起)		

8、本基金在本报告期内，无或有事项。

第七节 久富证券投资基金财务会计报告（未经审计）

（一）久富证券投资基金半年度会计报表

1、久富证券投资基金 2007 年 2 月 11 日及 2006 年 12 月 31 日的比较式资产负债表

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,855,695.98	618,936.57
清算备付金		262,176,163.39	111,851,829.25
交易保证金		640,993.11	609,609.61
应收证券清算款		0.00	4,906,661.67
应收股利		0.00	0.00
应收利息	1	214,198.75	2,234,084.86
应收申购款		0.00	0.00
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		1,074,968,345.57	932,552,923.22
其中：股票投资成本		651,739,427.78	560,337,318.63
债券投资市值		25,341,047.00	237,588,891.70
其中：债券投资成本		25,341,072.29	238,129,554.67
权证投资市值		811,750.00	0.00
其中：权证投资成本		1,046,534.25	0.00
配股权证		0.00	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		1,366,008,193.80	1,290,362,936.88
负债：			
应付证券清算款		6,979,161.93	5,969,957.16
应付赎回款		0.00	0.00
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		607,610.98	1,363,534.50
应付托管费		101,268.50	227,255.76
应付销售服务费		0.00	0.00
应付佣金	3	573,502.89	1,062,296.42

应付利息		0.00	139,885.74
应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	4	1,250,000.00	1,250,000.00
卖出回购证券款		0.00	100,000,000.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	5	110,399.58	60,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		9,621,943.88	110,072,929.58
持有人权益：			
实收基金	6	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	7	422,994,108.25	371,674,941.62
未分配收益		433,392,141.67	308,615,065.68
持有人权益合计		1,356,386,249.92	1,180,290,007.30
负债及持有人权益合计		1,366,008,193.80	1,290,362,936.88
附注：每份基金份额净值		2.7128	2.3606

2、久富证券投资基金本报告期（2007年1月1日至2007年2月11日）及上年度可比期间的比较式经营业绩表

单位：人民币元

项目	注释	2007年1月1日至 2007年2月11日	2006年1月1日至 2006年6月30日
一、收入		127,732,273.22	185,528,539.61
股票差价收入	8	128,782,677.60	173,214,426.70
债券差价收入	9	-1,981,502.60	0.00
权证差价收入		0.00	5,631,300.52
债券利息收入		806,824.80	1,848,721.77
存款利息收入		124,273.42	214,401.70
股利收入		0.00	4,619,688.92
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入		0.00	0.00
二、费用		2,955,197.23	5,784,310.52
基金管理人报酬		2,251,510.63	4,814,053.55
基金托管费		375,251.76	802,342.27
基金销售服务费		0.00	0.00
卖出回购证券支出		272,514.26	0.00
利息支出		0.00	0.00
其他费用	10	55,920.58	167,914.70
其中：上市年费		6,903.96	29,752.78
信息披露费		34,520.22	99,177.14
审计费用		6,903.96	29,752.78
三、基金净收益		124,777,075.99	179,744,229.09
加：未实现利得		51,319,166.63	157,277,951.56
四、基金经营业绩		176,096,242.62	337,022,180.65

3、久富证券投资基金本报告期（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）及上年度可比期间的比较式收益分配表

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
本期基金净收益		124,777,075.99	179,744,229.09
加：期初基金净收益		308,615,065.68	-38,925,745.03
本期损益平准金		0.00	0.00
可供分配基金净收益		433,392,141.67	140,818,484.06
加：以前年度损益调整		0.00	0.00
减：本期已分配基金净收益	11	0.00	0.00
期末基金净收益		433,392,141.67	140,818,484.06

4、久富证券投资基金本报告期（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）及上年度可比期间的比较式基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	注释	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		1,180,290,007.30	518,852,678.19
二、本期经营活动：			
已实现基金净收益		124,777,075.99	179,744,229.09
未实现利得		51,319,166.63	157,277,951.56
经营活动产生的基金净值变动数		176,096,242.62	337,022,180.65
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		0.00	0.00
基金赎回款		0.00	0.00
基金单位交易产生的基金净值变动数		0.00	0.00
四、本期向持有人分配收益：			
向持有人分配收益产生的基金净值变动数		0.00	0.00
五、期末基金净值		1,356,386,249.92	855,874,858.84

（二）久富证券投资基金半年度会计报表附注

1、基金的基本情况

久富证券投资基金是根据中国证券监督管理委员会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2002]11号）批准，由原富岛基金、兴沈基金、久盛基金经清理规范、合并而成的契约型封闭式证券投资基金，基金发起人为长城证券有限责任公司和长城基金管理有限公司。基金久富于2002年4月18日在深交所上市，基金存续期延长五年（至2007年5月20日）。本基金于2002年5月28日成功扩募

至 5 亿份基金单位，每份基金单位面值 1 元，发起人认购 500 万份，其余 49500 万份由社会公众持有，扩募部分于 2002 年 6 月 6 日在深交所上市交易。

基金募集申请的核准机构：中国证券监督管理委员会

核准文号：证监基金字[2002]11 号

核准名称：《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》

基金运作方式：契约型、封闭式

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

基金合同生效日：2001 年 12 月 18 日

合同生效日基金份额总额：253,697,560 份

2、本报告所采用的会计政策和会计估计：

(1)本报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(2)主要税项：

①根据《财政部国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》财税【2004】78 号文件规定，基金自 2004 年 1 月 1 日起，继续免征企业所得税和营业税。

②印花税

根据《财政部 国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》财税[2005]11 号文件规定，从2005年1月24日起，减按1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

③根据《财政部国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知》财税【2005】102 号文件规定，自 2005 年 6 月 13 日起对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定计征个人所得税。

3、本报告期重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

4、关联方

(1)关联方关系

关联公司名称	与本基金关系
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人
交通银行	本基金托管人
长城证券有限责任公司	本基金发起人及本基金管理人的主要股东、租赁交易席位
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位

西北证券有限责任公司	本基金管理人的股东
中原信托投资有限公司	本基金管理人的股东
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东
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

(2)关联方交易

声明：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

①通过关联方席位进行的交易

股票投资

2007年1月1日至2007年2月11日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	股票交易金额	股票交易占比
1	长城证券有限责任公司	332,191,092.37	46.08%
2	东方证券股份有限公司	323,754,041.33	44.91%
	合计	655,945,133.70	90.99%

2006年1月1日至2006年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	股票交易金额	股票交易占比
1	长城证券有限责任公司	426,512,316.48	28.06%
2	东方证券股份有限公司	213,830,049.31	14.07%
	合计	640,342,365.79	42.13%

债券和回购交易

2007年1月1日至2007年2月11日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	债券交易金额	债券回购金额	债券交易占比	回购交易占比
1	长城证券有限责任公司	53,677,562.80	160,000,000.00	17.09%	100.00%
2	东方证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00%	0.00%
	合计	53,677,562.80	160,000,000.00	17.09%	100.00%

2006年1月1日至2006年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	债券交易金额	债券回购金额	债券交易占比	回购交易占比
1	长城证券有限责任公司	8,644,213.90	0.00	12.57%	0.00%
2	东方证券股份有限公司	5,954,245.70	0.00	8.66%	0.00%
	合计	14,598,459.60	0.00	21.22%	0.00%

权证交易

2007年1月1日至2007年2月11日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	权证交易金额	权证交易占比
1	长城证券有限责任公司	0.00	0.00%
2	东方证券股份有限公司	1,046,429.60	100.00%
	合计	1,046,429.60	100.00%

2006年1月1日至2006年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	权证交易金额	权证交易占比
1	长城证券有限责任公司	4,963,717.07	88.14%
2	东方证券股份有限公司	0.00	0.00%
	合计	4,963,717.07	88.14%

佣金

2007年1月1日至2007年2月11日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	佣金	佣金占比
1	长城证券有限责任公司	271,055.93	47.26%
2	东方证券股份有限公司	253,340.12	44.17%
	合计	524,396.05	91.44%

2006年1月1日至2006年6月30日

单位：人民币元

序号	租用席位证券公司名称	佣金	佣金占比
1	长城证券有限责任公司	346,666.00	28.21%
2	东方证券股份有限公司	172,161.17	14.01%
	合计	518,827.17	42.23%

*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本基金关联方报酬（本报告期：2007年1月1日至2007年2月11日）

关联方名称	本报告期	上年度可比报告期	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	2,251,510.63	4,814,053.55	年费率 1.5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
交通银行	375,251.76	802,342.27	年费率 2.5%	
合计	2,626,762.39	5,616,395.82		

③与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期无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. 本基金管理人投资本基金的情况

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额（份）	占总份额比例
长城基金管理有限公司	2006 年 12 月 31 日	2,500,000.00	0.50%
	加：本期增加	0.00	0.00%
	减：本期减少	0.00	0.00%
	2007 年 2 月 11 日	2,500,000.00	0.50%

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额（份）	占总份额比例
长城基金管理有限公司	2005 年 12 月 31 日	2,500,000.00	0.50%
	加：本期增加	0.00	0.00%
	减：本期减少	0.00	0.00%
	2006 年 6 月 30 日	2,500,000.00	0.50%

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

关联方名称	2007 年 2 月 11 日		2006 年 6 月 30 日	
	持有份额（份）	比例	持有份额（份）	比例
长城证券有限责任公司	2,500,000.00	0.50%	2,500,000.00	0.50%

除本基金管理人外，本基金管理人主要股东控制的其它机构上期末及本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	2007 年 2 月 11 日	2006 年 6 月 30 日
交通银行	银行存款	1,855,695.98	1,262,081.98

⑥从关联方取得的利息收入（本报告期：2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）

关联方名称	项目	本报告期	上年度可比报告期
交通银行	存款利息收入	1,739.93	8,415.95

⑦关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	2006 年 2 月 11 日	2006 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	607,610.98	998,837.43
应付基金托管费	交通银行	托管费	101,268.50	166,472.92
应付佣金	长城证券有限责任公司	佣金	271,055.93	173,104.79
应付佣金	东方证券股份有限公司	佣金	253,340.12	38,107.53

其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金、清算备付金	500,000.00	500,000.00
其他应付款	东方证券股份有限公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他应付款	西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
应收利息	交通银行	存款利息	1,910.13	312.39
合计			2,235,185.66	2,376,835.06

5、主要会计报表项目注释

注释 1. 应收利息

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
银行存款利息	1,910.13
清算备付金利息	149,681.65
债券利息	62,345.68
权证交易价差保证金利息	261.29
合计	214,198.75

注释 2. 投资估值增值的金额

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
股票	423,228,917.79
债券	-25.29
权证	-234,784.25
合计	422,994,108.25

注释 3. 应付佣金

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

序号	项目	金额
1	长城证券有限责任公司	271,055.93
2	申银万国证券股份有限公司	17,317.51
3	东方证券股份有限公司	253,340.12
4	银河证券有限责任公司	31,789.33
	合 计	573,502.89

注释 4. 其他应付款

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	经济内容	金额
长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金、清算备付金	500,000.00

西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
东方证券股份有限公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
银河证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00
合 计		1,250,000.00

注释 5. 预提费用

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
上海证券报信息披露费	11,506.74
中国证券报信息披露费	11,506.74
证券时报信息披露费	11,506.74
审计费用	66,903.96
上市年费	6,903.96
银行间账户维护费	2,071.44
合 计	110,399.58

注释 6. 实收基金

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	基金份额数	实收基金
公众持有份额	495,000,000	495,000,000
发起人持有份额	5,000,000	5,000,000
合 计	500,000,000	500,000,000

本基金扩募前，由原江西省证券公司久盛投资基金、沈阳兴沈投资基金和海南富岛投资基金清理规范合并后的基金总份额为人民币 253,697,560.00 元，每一基金份额面值为人民币 1.00 元，业经深圳天健信德会计师事务所信德深验资报字（2001）第 11 号验资报告验证。

根据中国证监会证监基金字[2002]11 号文的批复，本基金扩募后的基金总份额人民币 500,000,000.00 元，每一基金份额面值为人民币 1.00 元，业经深圳天健信德会计师事务所信德深验资报字（2002）第 11 号验资报告验证。

本基金的发起人为长城基金管理有限公司和长城证券有限责任公司。

注释 7. 未实现利得

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
投资估值增值-股票投资	423,228,917.79
投资估值增值-债券投资	-25.29
投资估值增值-权证投资	-234,784.25
合 计	422,994,108.25

注：未实现利得为本基金估值资产的估值总额与成本总额之差

注释 8. 股票差价收入

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
卖出股票成交总额	380,020,718.86
减：卖出股票成本总额	250,921,621.71
卖出佣金	316,419.55
股票差价收入	128,782,677.60

注释 9. 债券差价收入

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
卖出债券成交总额	264,906,259.59
减：卖出债券成本总额	264,460,643.08
卖出应收利息	2,427,119.11
债券差价收入	-1,981,502.60

注释 10. 其他费用

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	金额
上市年费	6,903.96
信息披露费	34,520.22
审计费用	6,903.96
银行费用	21.00
账户维护费	6,571.44
交易所费用	1,000.00
合 计	55,920.58

注：基金久富转型过程中所发生的持有人大会费用由本基金管理人支付承担，不从本基金财产中列支。

注释 11. 本期已分配基金净收益

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

收益分配情况	本期收益分配额	累计收益分配额
0.00	0.00	0.00

6、本报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2007 年 2 月 11 日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下：

(1) 因股权分置改革而暂时停牌的股票情况：

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
000895	S 双汇	2006-6-1	2007-6-29	57.88	454,600	31.02	14,101,692.00	按股票停牌日的前一日市场平均价估值

(2) 因重大事项而暂时停牌的股票情况：

股票代码	股票名称	停牌日期	复牌日期	数量	期末估值单价	期末估值总额	估值方法
000617	S 济柴	2007-2-3	2007-3-6	1,359,452	21.26	28,901,949.52	按股票停牌日的前一日市场平均价估值
600967	北方创业	2007-2-8	2007-2-12	900,000	8.98	8,082,000.00	

7、本基金在本报告期内，无或有事项。

第八节 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)投资组合报告

(一) 期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产比例
1	股票	8,375,308,385.03	84.76%
2	债券	4,150,129.94	0.04%
3	权证	2,200,868.16	0.02%
4	资产支持证券	0.00	0.00%
5	银行存款和清算备付金合计	1,489,534,143.47	15.07%
6	其它资产	10,307,147.54	0.10%
	合计	9,881,500,674.14	100.00%

(二) 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	0.00	0.00%
B 采掘业	430,476,273.25	4.41%
C 制造业	4,490,564,400.51	46.04%
C0 食品、饮料	845,417,662.78	8.67%
C1 纺织、服装、皮毛	72,752,472.69	0.75%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%

C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,032,836,917.56	10.59%
C5 电子	37,618,056.61	0.39%
C6 金属、非金属	214,894,651.54	2.20%
C7 机械、设备、仪表	1,970,758,229.41	20.20%
C8 医药、生物制品	314,822,668.52	3.23%
C99 其他制造业	1,463,741.40	0.02%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	118,185,991.74	1.21%
E 建筑业	117,792,232.76	1.21%
F 交通运输、仓储业	217,333,574.69	2.23%
G 信息技术业	94,473,890.65	0.97%
H 批发和零售贸易业	159,670,618.00	1.64%
I 金融、保险业	1,500,993,178.03	15.39%
J 房地产业	372,900,331.20	3.82%
K 社会服务业	278,888,484.62	2.86%
L 传播与文化产业	510,859,088.20	5.24%
M 综合类	83,170,321.38	0.85%
合计	8,375,308,385.03	85.86%

（三）期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值	市值占基金 资产净值比例
1	600143	金发科技	13,835,575	533,223,060.50	5.47%
2	600037	歌华有线	18,900,000	494,802,000.00	5.07%
3	000568	泸州老窖	11,709,324	492,962,540.40	5.05%
4	600036	招商银行	19,475,079	478,697,441.82	4.91%
5	600000	浦发银行	9,020,000	330,041,800.00	3.38%
6	601318	中国平安	4,500,000	321,795,000.00	3.30%
7	600030	中信证券	5,500,000	291,335,000.00	2.99%
8	600150	沪东重机	1,805,299	249,564,533.76	2.56%
9	600786	东方锅炉	3,910,466	246,281,148.68	2.52%
10	000157	中联重科	5,946,144	228,926,544.00	2.35%
11	600138	中青旅	7,230,458	177,796,962.22	1.82%
12	002038	双鹭药业	4,444,803	166,680,112.50	1.71%
13	600875	东方电机	2,567,215	163,993,694.20	1.68%
14	000581	威孚高科	9,082,714	162,398,926.32	1.66%
15	000617	石油济柴	5,008,672	155,268,832.00	1.59%
16	600309	烟台万华	2,883,866	154,459,862.96	1.58%
17	600519	贵州茅台	1,290,026	154,390,311.68	1.58%
18	000858	五粮液	4,600,000	144,716,000.00	1.48%
19	600583	海油工程	3,935,040	142,448,448.00	1.46%
20	600761	安徽合力	4,940,883	140,815,165.50	1.44%
21	600331	宏达股份	2,788,700	135,112,515.00	1.39%

22	000002	万 科A	7,000,000	133,840,000.00	1.37%
23	000951	中国重汽	2,100,000	106,890,000.00	1.10%
24	600469	风神股份	6,627,061	106,430,599.66	1.09%
25	000024	招商地产	2,059,999	101,145,950.90	1.04%
26	000069	华侨城A	2,539,988	101,091,522.40	1.04%
27	600867	通化东宝	8,205,717	95,678,660.22	0.98%
28	600970	中材国际	1,707,592	93,200,371.36	0.96%
29	600123	兰花科创	3,078,094	92,096,572.48	0.94%
30	000792	盐湖钾肥	2,000,000	88,760,000.00	0.91%
31	600717	天津港	3,400,000	85,578,000.00	0.88%
32	000402	金 融 街	2,912,600	84,465,400.00	0.87%
33	600028	中国石化	6,241,087	82,507,170.14	0.85%
34	601699	潞安环能	2,000,372	81,755,203.64	0.84%
35	002024	苏宁电器	1,664,124	78,147,263.04	0.80%
36	600509	天富热电	3,772,478	66,169,264.12	0.68%
37	600100	同方股份	1,893,104	64,933,467.20	0.67%
38	601006	大秦铁路	3,988,463	60,385,329.82	0.62%
39	600439	瑞贝卡	1,500,000	60,285,000.00	0.62%
40	000625	长安汽车	3,500,500	57,688,240.00	0.59%
41	600458	时代新材	4,800,000	57,312,000.00	0.59%
42	600858	银座股份	1,826,714	56,025,318.38	0.57%
43	600104	上海汽车	3,116,146	53,815,841.42	0.55%
44	600517	置信电气	1,486,920	51,283,870.80	0.53%
45	600801	华新水泥	1,970,070	45,902,631.00	0.47%
46	002007	华兰生物	1,017,088	42,310,860.80	0.43%
47	600690	青岛海尔	2,600,000	41,600,000.00	0.43%
48	600693	东百集团	2,307,471	40,749,937.86	0.42%
49	000895	双汇发展	662,893	38,381,504.70	0.39%
50	000759	武汉中百	2,535,461	34,482,269.60	0.35%
51	000800	一汽轿车	3,000,000	32,700,000.00	0.34%
52	600649	原水股份	2,300,500	32,276,015.00	0.33%
53	000932	华菱管线	3,615,258	30,838,150.74	0.32%
54	000619	海螺型材	2,523,400	30,003,226.00	0.31%
55	600026	中海发展	1,237,500	28,437,750.00	0.29%
56	000528	柳 工	1,153,600	28,263,200.00	0.29%
57	601166	兴业银行	793,217	27,833,984.53	0.29%
58	000400	许继电气	2,024,646	27,170,749.32	0.28%
59	000001	深发展A	935,209	25,736,951.68	0.26%
60	601998	中信银行	2,777,500	25,553,000.00	0.26%
61	600312	平高电气	1,101,646	25,106,512.34	0.26%
62	600688	S 上石化	1,979,625	22,646,910.00	0.23%
63	000793	华闻传媒	2,656,100	22,258,118.00	0.23%
64	600660	福耀玻璃	728,240	22,225,884.80	0.23%

65	600482	风帆股份	1,000,000	21,910,000.00	0.22%
66	002084	海鸥卫浴	700,000	21,721,000.00	0.22%
67	600428	中远航运	976,066	21,366,084.74	0.22%
68	000031	中粮地产	878,200	19,864,884.00	0.20%
69	002081	金螳螂	457,400	18,533,848.00	0.19%
70	002045	广州国光	1,540,249	17,928,498.36	0.18%
71	000898	鞍钢股份	1,000,000	17,690,000.00	0.18%
72	600663	陆家嘴	671,280	17,057,224.80	0.17%
73	000401	冀东水泥	1,229,500	16,917,920.00	0.17%
74	600088	中视传媒	528,020	16,057,088.20	0.16%
75	600198	*ST 大唐	752,757	15,694,983.45	0.16%
76	000869	张裕A	243,450	14,967,306.00	0.15%
77	000839	中信国安	494,480	13,845,440.00	0.14%
78	600383	金地集团	403,300	13,800,926.00	0.14%
79	002055	得润电子	800,237	12,971,841.77	0.13%
80	601111	中国国航	1,300,047	12,727,460.13	0.13%
81	002029	七匹狼	686,157	12,467,472.69	0.13%
82	000410	沈阳机床	506,978	12,167,472.00	0.12%
83	600019	宝钢股份	1,000,000	11,000,000.00	0.11%
84	000939	凯迪电力	620,000	10,614,400.00	0.11%
85	000927	一汽夏利	1,200,000	10,032,000.00	0.10%
86	600590	泰豪科技	500,000	9,255,000.00	0.09%
87	000861	海印股份	800,000	8,352,000.00	0.09%
88	601919	中国远洋	441,910	8,069,276.60	0.08%
89	600031	三一重工	181,800	8,041,014.00	0.08%
90	002097	山河智能	113,398	7,983,219.20	0.08%
91	000878	云南铜业	230,800	7,962,600.00	0.08%
92	000825	太钢不锈	390,000	7,823,400.00	0.08%
93	600299	星新材料	162,410	7,391,279.10	0.08%
94	000060	中金岭南	248,270	7,274,311.00	0.07%
95	000768	西飞国际	233,550	7,209,688.50	0.07%
96	000751	锌业股份	339,300	6,687,603.00	0.07%
97	600497	驰宏锌锗	94,000	6,206,820.00	0.06%
98	600351	亚宝药业	800,000	6,168,000.00	0.06%
99	600547	山东黄金	80,800	5,921,832.00	0.06%
100	600219	南山铝业	249,500	5,661,155.00	0.06%
101	600879	火箭股份	200,000	5,318,000.00	0.05%
102	002128	露天煤业	142,500	5,144,250.00	0.05%
103	600415	小商品城	48,385	4,886,885.00	0.05%
104	000983	西山煤电	152,300	4,299,429.00	0.04%
105	600596	新安股份	89,100	3,848,229.00	0.04%
106	000680	山推股份	240,000	3,787,200.00	0.04%
107	600058	五矿发展	154,300	3,502,610.00	0.04%

108	600489	中金黄金	74,333	3,495,880.99	0.04%
109	600131	岷江水电	499,121	3,493,847.00	0.04%
110	002134	天津普林	186,400	3,263,864.00	0.03%
111	600027	华电国际	462,194	3,110,565.62	0.03%
112	600266	北京城建	108,600	3,077,724.00	0.03%
113	600111	稀土高科	107,800	2,998,996.00	0.03%
114	000758	中色股份	117,798	2,980,289.40	0.03%
115	600682	S 宁新百	88,525	2,788,537.50	0.03%
116	000999	S 三 九	150,900	2,731,290.00	0.03%
117	600048	保利地产	59,350	2,725,945.50	0.03%
118	002122	天马股份	34,709	2,644,478.71	0.03%
119	002123	荣信股份	30,147	2,502,201.00	0.03%
120	000933	神火股份	71,700	2,015,487.00	0.02%
121	600674	川投能源	200,000	1,906,000.00	0.02%
122	600348	国阳新能	49,900	1,844,304.00	0.02%
123	002102	冠福家用	100,000	1,839,000.00	0.02%
124	600835	上海机电	68,900	1,710,098.00	0.02%
125	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.02%
126	002130	沃尔核材	29,964	1,463,741.40	0.02%
127	000937	金牛能源	88,100	1,406,076.00	0.01%
128	600188	兖州煤业	94,000	1,334,800.00	0.01%
129	600436	片仔癀	33,300	1,253,745.00	0.01%
130	600125	铁龙物流	69,780	769,673.40	0.01%
131	002137	实 益 达	15,500	731,445.00	0.01%
132	002139	拓邦电子	11,500	690,000.00	0.01%
133	600396	金山股份	30,000	615,900.00	0.01%
134	002138	顺络电子	14,500	497,495.00	0.01%
135	002136	安 纳 达	3,500	79,835.00	0.00%

注：以上股票名称以 2007 年 6 月 30 日公布的股票简称为准。

（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超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600037	歌华有线	389,468,191.00	3.99%
2	000568	泸州老窖	366,167,908.71	3.75%
3	600143	金发科技	275,558,041.48	2.82%
4	600036	招商银行	271,107,839.85	2.78%
5	600030	中信证券	248,887,406.90	2.55%
6	601318	中国平安	236,414,433.05	2.42%
7	600000	浦发银行	235,459,168.15	2.41%

8	600786	东方锅炉	176,948,563.17	1.81%
9	600050	中国联通	161,220,056.95	1.65%
10	600150	沪东重机	154,220,035.39	1.58%
11	600583	海油工程	138,926,358.15	1.42%
12	000858	五 粮 液	129,982,207.90	1.33%
13	601988	中国银行	129,855,131.84	1.33%
14	600875	东方电机	128,968,194.77	1.32%
15	000002	万 科A	126,116,511.08	1.29%
16	000157	中联重科	114,564,764.12	1.17%
17	601398	工商银行	114,234,509.50	1.17%
18	600309	烟台万华	110,358,063.97	1.13%
19	600761	安徽合力	107,234,112.76	1.10%
20	600028	中国石化	101,750,150.77	1.04%

2、本报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产净值的比例
1	600050	中国联通	152,337,226.71	1.56%
2	601988	中国银行	130,949,303.57	1.34%
3	000002	万 科A	121,274,208.63	1.24%
4	000876	新 希 望	118,590,085.08	1.22%
5	601398	工商银行	112,159,173.45	1.15%
6	600005	武钢股份	101,565,790.43	1.04%
7	600030	中信证券	97,745,898.01	1.00%
8	600795	国电电力	94,294,613.16	0.97%
9	600000	浦发银行	87,610,037.09	0.90%
10	600026	中海发展	85,985,931.46	0.88%
11	600482	风帆股份	64,994,407.53	0.67%
12	600717	天津港	61,619,128.34	0.63%
13	600028	中国石化	60,900,620.38	0.62%
14	000625	长安汽车	59,586,063.13	0.61%
15	600206	有研硅股	55,086,175.83	0.56%
16	000858	五 粮 液	52,471,956.64	0.54%
17	600569	安阳钢铁	51,651,881.85	0.53%
18	601628	中国人寿	46,972,144.70	0.48%
19	000932	华菱管线	42,141,140.44	0.43%
20	000951	中国重汽	41,170,065.22	0.42%

3、本基金报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入：

项目	金额(元)
报告期内买入股票的成本总额	7,890,517,609.49
报告期内卖出股票的收入总额	3,359,453,053.70

（五）按券种分类的债券组合

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	2,893,232.00	0.03%
4	可转换债	1,256,897.94	0.01%
5	央行票据	0.00	0.00%
	合 计	4,150,129.94	0.04%

（六）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	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	07 武钢债	2,893,232.00	0.03%
2	锡业转债	1,256,897.94	0.01%

（七）期末按市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）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、处罚的情况。

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(元)
1	交易保证金	3,385,827.94
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	44,344.11
4	应收利息	442,426.96
5	应收申购款	6,434,548.53
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
	合计	10,307,147.54

4、本基金本期末持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

权证代码	权证名称	数量（份）	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
031003	深发 SFC1	93,521	1,425,260.04	0.0146%
031004	深发 SFC2	46,760	775,608.12	0.0080%

6、本基金本报告期内权证投资情况：

权证代码	权证名称	获得认购(沽)权证	获得认购成本(元)	期间买入数量(份)	买入成本(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	期末数量(份)
580013	武钢 CWB1	2,731,714	6,330,134.38	0	0.00	2,731,714	10,029,854.46	0
580989	南航 JTP1	424,620	0.00	0	0.00	424,620	985,042.05	0
030002	五粮 YGC1	0	0.00	0	0.00	50,000	-232,463.81	0
031001	侨城 HQC1	0	0.00	100,000	2,870,273.02	100,000	116,513.87	0
031003	深发 SFC1	93,521	0.00	0	0.00	0	0.00	93,521
031004	深发 SFC2	46,760	0.00	0	0.00	0	0.00	46,760

7、以上各表的股票名称均以 2007 年 6 月 30 日公布的股票简称为准。

8、由于四舍五入的原因，以上各表的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第九节 久富证券投资基金投资组合报告

（一）期末（2007 年 2 月 11 日）基金资产组合情况

序号	资产项目	金额（元）	占基金总资产比例
1	股票	1,074,968,345.57	78.69%
2	债券	25,341,047.00	1.86%
3	权证	811,750.00	0.06%
4	资产支持证券	0.00	0.00%
5	银行存款和清算备付金合计	264,031,859.37	19.33%
6	其它资产	855,191.86	0.06%
	合计	1,366,008,193.80	100.00%

（二）期末（2007 年 2 月 11 日）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	1,730,778.00	0.13%
B 采掘业	21,840,000.00	1.61%
C 制造业	643,911,206.06	47.47%
C0 食品、饮料	80,490,396.76	5.93%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	7,550,000.00	0.56%

C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	255,451,950.08	18.83%
C5 电子	5,715,669.36	0.42%
C6 金属、非金属	0.00	0.00%
C7 机械、设备、仪表	186,786,657.59	13.77%
C8 医药、生物制品	107,916,532.27	7.96%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	24,948,691.60	1.84%
G 信息技术业	0.00	0.00%
H 批发和零售贸易业	16,452,881.28	1.21%
I 金融、保险业	204,082,197.20	15.05%
J 房地产业	84,374,000.00	6.22%
K 社会服务业	37,785,697.29	2.79%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	39,842,894.14	2.94%
合计	1,074,968,345.57	79.25%

(三) 期末(2007年2月11日)按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值	市值占基金资产净值比例
1	600143	金发科技	2,649,136	138,655,778.24	10.22%
2	600000	浦发银行	3,000,000	68,970,000.00	5.08%
3	600519	贵州茅台	700,000	66,388,000.00	4.89%
4	000002	万科A	4,400,000	65,384,000.00	4.82%
5	600458	时代新材	3,731,000	60,330,270.00	4.45%
6	600036	招商银行	3,652,520	59,207,349.20	4.37%
7	600867	通化东宝	4,314,400	57,510,952.00	4.24%
8	600030	中信证券	1,585,000	55,443,300.00	4.09%
9	000951	中国重汽	1,687,117	44,624,244.65	3.29%
10	600858	银座股份	1,490,011	39,842,894.14	2.94%
11	600138	中青旅	2,131,173	37,785,697.29	2.79%
12	600761	安徽合力	1,301,700	31,123,647.00	2.29%
13	000617	石油济柴	1,359,452	28,901,949.52	2.13%
14	000619	海螺型材	2,820,000	27,156,600.00	2.00%
15	002038	双鹭药业	1,114,494	26,112,594.42	1.93%
16	000581	威孚高科	2,142,722	25,434,110.14	1.88%
17	600161	天坛生物	750,015	24,292,985.85	1.79%
18	600028	中国石化	2,600,000	21,840,000.00	1.61%
19	600309	烟台万华	632,878	20,429,301.84	1.51%
20	000625	长安汽车	1,496,012	20,016,640.56	1.48%

21	000927	一汽夏利	2,150,384	19,848,044.32	1.46%
22	000402	金融街	1,500,000	18,990,000.00	1.40%
23	000001	S深发展A	999,950	18,639,068.00	1.37%
24	600693	东百集团	902,022	16,452,881.28	1.21%
25	000895	双汇发展	454,600	14,101,692.00	1.04%
26	600026	中海发展	1,120,000	14,067,200.00	1.04%
27	601006	大秦铁路	983,860	10,881,491.60	0.80%
28	000665	武汉塑料	1,500,000	8,880,000.00	0.65%
29	600967	北方创业	900,000	8,082,000.00	0.60%
30	600978	宜华木业	500,000	7,550,000.00	0.56%
31	002045	广州国光	261,000	4,969,440.00	0.37%
32	000157	中联重科	200,000	4,394,000.00	0.32%
33	000528	柳工	150,000	2,778,000.00	0.20%
34	601166	兴业银行	76,000	1,822,480.00	0.13%
35	002069	獐子岛	19,894	1,730,778.00	0.13%
36	002073	青岛软控	24,844	1,387,537.40	0.10%
37	002076	雪莱特	32,558	746,229.36	0.06%
38	000400	许继电气	9,200	117,484.00	0.01%
39	600067	冠城大通	10,000	79,000.00	0.01%
40	000568	泸州老窖	28	704.76	0.00%

注1：以上股票名称以2007年6月30日公布的股票简称为准。

注2：由于市场波动的原因，致使本基金在报告期末投资的金发科技（代码600143）市值超过了基金资产净值的10%，但在规定的期限内进行了调整。

（四）报告期内（2007年1月1日至2007年2月11日）投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细如下：

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	000617	石油济柴	28,324,948.31	2.40%
2	000581	威孚高科	23,495,319.50	1.99%
3	600309	烟台万华	20,528,594.00	1.74%
4	600967	北方创业	19,175,007.08	1.62%
5	000001	S深发展A	17,311,608.66	1.47%
6	000428	华天酒店	16,061,587.30	1.36%
7	000402	金融街	15,557,498.37	1.32%
8	600693	东百集团	15,273,327.59	1.29%
9	600030	中信证券	15,072,864.74	1.28%
10	600016	民生银行	14,824,572.06	1.26%
11	000858	五粮液	14,480,554.13	1.23%
12	600026	中海发展	14,480,517.58	1.23%

13	000927	一汽夏利	14,053,250.09	1.19%
14	600036	招商银行	11,895,480.64	1.01%
15	002038	双鹭药业	10,770,162.22	0.91%
16	600978	宜华木业	9,573,573.81	0.81%
17	000665	武汉塑料	8,963,283.64	0.76%
18	000951	中国重汽	8,180,250.89	0.69%
19	600867	通化东宝	8,088,323.23	0.69%
20	601006	大秦铁路	7,091,468.47	0.60%

2、本报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细如下：

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	000568	泸州老窖	47,041,131.96	3.99%
2	600028	中国石化	40,110,830.82	3.40%
3	600000	浦发银行	31,673,627.46	2.68%
4	000718	苏宁环球	25,594,250.78	2.17%
5	600016	民生银行	24,388,918.43	2.07%
6	600143	金发科技	22,171,069.80	1.88%
7	000421	南京中北	21,200,004.07	1.80%
8	000428	华天酒店	19,166,667.67	1.62%
9	600036	招商银行	14,732,773.70	1.25%
10	000858	五 粮 液	14,208,230.83	1.20%
11	000002	万 科 A	13,818,474.78	1.17%
12	600967	北方创业	12,530,638.52	1.06%
13	600690	青岛海尔	10,596,742.01	0.90%
14	000951	中国重汽	9,629,732.75	0.82%
15	002024	苏宁电器	9,390,200.59	0.80%
16	000619	海螺型材	8,923,703.09	0.76%
17	600030	中信证券	8,525,149.74	0.72%
18	000402	金 融 街	7,539,176.02	0.64%
19	000625	长安汽车	6,195,696.39	0.52%
20	600519	贵州茅台	5,107,038.10	0.43%

3、本基金报告期内买入股票总成本和卖出股票总收入：

项目	金额(元)
报告期内买入股票的成本总额	342,323,730.86
报告期内卖出股票的收入总额	380,020,718.86

（五）按券种分类的债券组合

序号	券种分类	市值（元）	占基金资产净值比例
1	国债	1,047.00	0.00%

2	金融债	0.00	0.00%
3	企业债	25,340,000.00	1.87%
4	可转换债	0.00	0.00%
5	央行票据	0.00	0.00%
	合 计	25,341,047.00	1.87%

（六）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	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	99 国开 13	25,340,000.00	1.87%
2	04 国债(3)	1,047.00	0.00%

（七）期末按市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）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、处罚的情况。

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(元)
1	交易保证金	640,993.11
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	214,198.75
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
	合计	855,191.86

4、本基金本期末（2007 年 2 月 11 日）持有处于转股期的可转换债券。

5、本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

权证代码	权证名称	数量（份）	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
030002	五粮 YGC1	50,000	811,750.00	0.0598%

6、本基金本报告期内（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）权证投资情况：

权证代码	权证名称	获得认购(沽)权证	获得认购成本(元)	期间买入数量(份)	买入成本(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	期末数量(份)
030002	五粮 YGC1	0	0.00	50,000	1,046,534.25	0	0.00	50,000

7、以上各表的股票名称均以 2007 年 6 月 30 日公布的股票简称为准。

8、由于四舍五入的原因，以上各表的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十节 基金份额持有人户数、持有人结构

（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

截止 2007 年 6 月 30 日长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)持有人情况如下：

1、基金份额持有人户数

基金份额持有人户数	304,490 户
平均每户持有基金份额	24,913.64 份/户

2、基金份额持有人结构

项目	持有份额(份)	占基金总份额的比例
机构投资者	624,372,253.19	8.23%
个人投资者	6,961,581,411.02	91.77%
合计	7,585,953,664.21	100.00%

3、报告期末本基金场内前十名持有人明细

序号	持有人名称	持有份额	占场内总份额比例	占期末总份额比例
1	中国人寿保险（集团）公司	110,647,241.00	11.29%	1.46%
2	中国人寿保险股份有限公司	84,305,641.00	8.60%	1.11%
3	太平人寿保险有限公司	56,737,932.00	5.79%	0.75%
4	UBS AG	31,102,603.00	3.17%	0.41%
5	中国人寿保险股份有限公司	24,363,596.00	2.49%	0.32%
6	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	2.23%	0.29%
7	中国人民财产保险股份有限公司	21,586,192.00	2.20%	0.28%
8	太平人寿保险有限公司	16,607,758.00	1.69%	0.22%
9	中国再保险（集团）公司	16,073,182.00	1.64%	0.21%
10	中国人寿再保险股份有限公司	13,207,130.00	1.35%	0.17%

4、本基金管理人基金从业人员持有本基金份额的情况

截止本报告期末，本基金管理人的基金从业人员未持有本基金份额。

（二）久富证券投资基金

截止 2007 年 2 月 11 日久富证券投资基金持有人情况如下：

1、基金份额持有人户数及结构

序号	项目	户数/份额
1	本基金报告期内份额持有人户数	14,262(户)
2	平均每户持有基金份额	35,058(份)

序号	项目	份额（份）	占总份额比例
1	机构投资者持有基金份额	382,040,037.00	76.41%
2	个人投资者持有基金份额	117,959,963.00	23.59%

2、基金份额前十名持有人情况：

序号	名称	份额（份）	占总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	49,153,625	9.83%
2	中国人寿保险（集团）公司	48,511,449	9.70%
3	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	42,438,304	8.49%
4	太平人寿保险有限公司	32,577,202	6.52%
5	新华人寿保险股份有限公司	28,940,922	5.79%
6	UBS AG	15,136,448	3.03%
7	银河—渣打—CITIGROUP GLOBAL MARKETS LIMITED	14,863,877	2.97%
8	宝钢集团有限公司	13,950,000	2.79%
9	华泰证券—招行—华泰紫金 2 号集合资产管理计划	12,330,134	2.47%
10	国信—中行—国信“金理财”经典组合基金集合资产	9,576,126	1.92%

第十一节开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	基金合同生效日的份额总额	500,000,000.00
2	期初基金份额总额	500,000,000.00
3	加：本期申购基金份额总额	9,928,836,841.92
4	其中：本期转型拆分解算增加	640,424,000.00

5	减：本期赎回基金份额总额	2,842,883,177.71
6	期末基金份额总额	7,585,953,664.21

第十二节 重大事件揭示

（一）本基金管理人于 2007 年 1 月 15 日召开了本基金份额持有人大会，表决通过了有关久富基金转型的决议：长城基金管理有限公司向深圳证券交易所申请终止久富基金上市交易；久富基金的名称变更为长城久富核心成长股票型证券投资基金（L0F），基金的运作方式由封闭式转为开放式，基金存续期由 2007 年 5 月 20 日到期变更为不定期；对基金的投资目标、投资范围和投资策略做适当调整，并对基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件做适当修订。依据中国证监会 2007 年 1 月 31 日证监基金字（2007）25 号文批准，持有人大会决议生效。

（二）长城基金管理有限公司股东会 2007 年第二次会议通过，聘任谢志华先生担任公司独立董事、麦建光先生不再担任公司独立董事，选举韩刚先生担任公司监事。经长城基金管理有限公司股东会 2007 年第六次会议通过，选举王国斌同志任公司董事、杨玉成同志不再担任公司董事。监管部门对以上任命无异议。

（三）本报告期内本基金管理人办公地址由“深圳市福田区深南中路 2066 号华能大厦 25 层”变更为“深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层”。

（四）报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

（五）报告期内基金投资策略无改变。

（六）基金收益分配事项

①本基金在转型前本期未有收益分配，在转型前基金成立至终止基金份额累计分红 0.00 元。

②转型后，在本期间于 2007 年 3 月 2 日进行了一次收益分配，每 10 份基金份额分别派发现金红利 6.00 元；

2007 年 3 月 12 日本基金管理人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。经本基金托管人交通银行股份有限公司确认，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），本基金管理人按照 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 1.0000 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财产。原基金久富的基金总额由 500,000,000.00 份转换为 1,140,424,000.00 份，其中 155,076,839.11 为本期因基金转型拆分折算而转为份额的收益。

本报告期每 10 份基金份额共分红 9.102 元，本基金成立至今每 10 份基金份额累计分红

9.102 元。

（七）本基金会计事务所本期间无变更。

（八）报告期内无基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚情况；

（九）2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日本基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、股票成交金额及占全年同类成交总额的比例：

单位：人民币元

租用席位证券公司名称	席位数量	股票成交金额	股票成交金额占比
长城证券有限责任公司	2	4,232,357,915.88	35.50%
申银万国证券股份有限公司	1	1,464,003,333.00	12.28%
东方证券股份有限公司	2	4,659,772,194.43	39.08%
国泰君安证券股份有限公司	1	166,413,048.08	1.40%
中银国际证券有限责任公司	1	1,312,230,060.02	11.01%
银河证券有限责任公司	1	87,486,777.39	0.73%
合计	8	11,922,263,328.80	100.00%

2、债券成交金额及占全年同类成交总额的比例：

单位：人民币元

租用席位证券公司名称	席位数量	债券成交金额	债券成交金额占比
长城证券有限责任公司	2	53,677,562.80	16.01%
申银万国证券股份有限公司	1	281,665,153.60	83.99%
东方证券股份有限公司	2	0.00	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	1	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	1	0.00	0.00%
银河证券有限责任公司	1	0.00	0.00%
合计	8	335,342,716.40	100.00%

3、债券回购成交金额及占全年同类成交总额的比例：

单位：人民币元

租用席位证券公司名称	席位数量	债券回购成交金额	债券回购成交金额占比
长城证券有限责任公司	2	160,000,000.00	100.00%
申银万国证券股份有限公司	1	0.00	0.00%
东方证券股份有限公司	2	0.00	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	1	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	1	0.00	0.00%
银河证券有限责任公司	1	0.00	0.00%
合计	8	160,000,000.00	100.00%

4、权证成交金额及占全年同类成交总额的比例：

单位：人民币元

租用席位证券公司名称	席位数量	权证成交金额	权证成交金额占比
长城证券有限责任公司	2	0.00	0.00%
申银万国证券股份有限公司	1	16,361,256.96	65.28%
东方证券股份有限公司	2	7,717,653.02	30.79%
国泰君安证券股份有限公司	1	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	1	985,118.40	3.93%
银河证券有限责任公司	1	0.00	0.00%
合计	8	25,064,028.38	100.00%

5、佣金金额及占全年同类总额的比例：

单位：人民币元

租用席位证券公司名称	席位数量	佣金金额	佣金金额占比
长城证券有限责任公司	2	3,416,184.82	35.50%
申银万国证券股份有限公司	1	1,197,853.63	12.45%
东方证券股份有限公司	2	3,729,046.82	38.75%
国泰君安证券股份有限公司	1	136,456.48	1.42%
中银国际证券有限责任公司	1	1,076,023.12	11.18%
银河证券有限责任公司	1	68,459.43	0.71%
合计	8	9,624,024.30	100.00%

6、报告期内租用证券公司席位的变更情况

本报告期内租用的证券公司席位无变更。

7、由于四舍五入的原因，以上各表的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(十) 其他重要事项

1、与基金转型相关的公告事项

(1) 2006年12月15日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登《久富证券投资基金召开基金份额持有人大会公告》。

(2) 2007年1月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于久富证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》。

(3) 2007年2月5日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《久富证券投资基金基金份额持有人大会决议公告》。

(4) 2007年2月9日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《久富证券投资基金终止上市公告》。

(5) 2007年2月9日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《久富证券投资基金终止上市提示性公告》。

（6）2007年3月8日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于原久富证券投资基金基金份额转换的公告》。

（7）2007年3月13日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于原久富证券投资基金基金份额转换结果的公告》。

2、其他公告事项

（1）2007年1月19日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《久富证券投资基金季度报告（2006年第4季度）》。

（2）2007年2月6日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于督察长任职的公告》。

（3）2007年2月28日本基金管理人在中国证券报刊登了《长城久富核心成长股票型基金招募说明书》。

（4）2007年2月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型基金份额发售公告》。

（5）2007年2月28日本基金管理人在中国证券报刊登了《长城久富核心成长股票型基金合同摘要》

（6）2007年2月26日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）收益分配公告》。

（7）2007年3月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）上网发售提示性公告》。

（8）2007年3月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为代销机构的公告》

（9）2007年3月7日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）提前结束集中申购的公告》。

（10）2007年3月13日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金集中申购结果的公告》。

（11）2007年3月15日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）开放申购的公告》。

（12）2007年3月21日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长基金通过交通银行网上银行前端申购实行费率优惠的公告》。

（13）2007年3月30日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《久富证券投资基金2006年年报摘要》。

（14）2007年4月20日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007年1季度报告》。

（15）2007年4月30日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司办公地址变更公告》。

（16）2007年5月15日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《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》。

（17）2007年5月15日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《关于长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）开放赎回的公告》。

（18）2007年5月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)上市交易提示性公告》。

（19）2007年6月9日本基金管理人在证券时报刊登了《关于长城基金管理有限公司股权、注册地址变更的公告》。

（20）2007年6月14日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于暂停长城久富核心成长股票型（LOF）基金大额申购业务的公告》。

（21）2007年6月26日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报刊登了《长城基金管理有限公司关于恢复长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)大额申购业务的公告》。

（22）本报告期刊登的其他公告。

第十三节 备查文件目录

- （一）本基金设立批准的相关文件
- （二）《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城久富核心成长股票型证券投资基金招募说明书》
- （四）《长城久富和兴成长股票型证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书
- （六）基金发起人营业执照

（七）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

（八）基金托管人业务资格批件、营业执照

（九）代销机构业务资格批件、营业执照

（十）中国证监会规定的其他文件

查阅地点：广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长城基金管理有限公司。

咨询电话：0755-23982338

客户服务中心电话：400-8868-666

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>

长城基金管理有限公司
二〇〇七年八月二十五日