

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） 二〇〇七年年度报告



报告期间：2007 年 1 月 1 日至 12 月 31 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：2008 年 3 月 26 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》自同一日起失效。

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 2008 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务会计报告已经审计。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 12 月 31 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）其他有关资料：.....	7
第三节主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	7
（一）主要财务指标.....	7
（二）基金净值表现.....	8
（三）收益分配情况.....	11
第四节 管理人报告.....	12
（一）基金管理人及基金经理情况.....	12
（二）本报告期基金运作遵规守信情况声明.....	12
（三）报告期内投资策略和业绩表现说明及解释.....	13
（四）宏观经济、证券市场及行业走势简要展望.....	13
（五）基金内部监察报告.....	14
第五节 托管人报告.....	15
第六节 审计报告.....	15
第七节 财务会计报告（已经审计）.....	17
一、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务会计报告.....	17
（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务报表.....	17
（二）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务报表附注.....	20
二、久富证券投资基金年度财务会计报告.....	38
（一）久富证券投资基金年度财务报表.....	38
（二）久富证券投资基金年度财务报表附注.....	41
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.....	52
（一）期末基金资产组合情况.....	52
（二）期末按行业分类的股票投资组合.....	53
（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.....	53
（四）报告期内投资组合的重大变动.....	56
（五）报告期末按券种分类的债券组合.....	57
（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.....	57

（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	58
（八）投资组合报告附注	58
第九节 久富证券投资基金投资组合报告	59
（一）期末（2007 年 2 月 11 日）基金资产组合情况	59
（二）期末（2007 年 2 月 11 日）按行业分类的股票投资组合	59
（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	60
（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	61
（五）按券种分类的债券组合	62
（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	62
（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	62
（八）投资组合报告附注	63
第十节 基金份额持有人户数、持有人结构	63
第十一节 开放式基金份额变动	65
第十二节 重大事件揭示	65
第十三节 备查文件目录	72

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：4,712,415,843.44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40层、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）其他有关资料

1、会计师事务所

名称：深圳大华天诚会计师事务所

办公地址：深圳市福田区滨河大道 5022 号联合广场 B 座 11 楼

2、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、基金净值表现及收益分配情况

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

1、2007 年长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF) 主要财务指标（2007 年 2 月 12 日—2007 年 12 月 31 日）及原久富证券投资基金主要财务指标（2007 年 1 月 1 日—2007 年 2 月 11 日）

单位：人民币元

序号	主要财务指标	2007年1月1日至2007年12月31日	
		转型后	转型前
		(2007.2.12-2007.12.31)	(2007.1.1-2007.2.11)
1	本期利润（元）	5,574,673,698.81	176,096,242.62
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	3,201,964,267.45	124,777,075.99
3	加权平均基金份额本期利润（元）	0.8533	0.3522
4	期末可供分配基金利润（元）	2,471,534,718.17	433,392,141.67
5	期末可供分配基金份额利润（元）	0.5245	0.8668
6	期末基金资产净值（元）	8,573,579,367.51	1,356,386,249.92
7	期末基金份额净值（元）	1.8194	2.7128
8	加权平均净值利润率	61.36%	13.62%
9	本期份额净值增长率	97.03%	14.92%
10	份额累计净值增长率	97.03%	172.70%

2、原久富证券投资基金主要财务指标（2006年—2005年）

单位：人民币元

序号	项目	2006年度	2005年度
1	本期利润（元）	661,437,329.11	33,684,259.95
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	347,540,810.71	-7,147,709.61
3	加权平均基金份额本期利润（元）	1.3229	0.0674
4	期末可供分配基金利润（元）	308,615,065.68	-38,925,745.03
5	期末可供分配基金份额利润（元）	0.6172	-0.0779
6	期末基金资产净值（元）	1,180,290,007.30	518,852,678.19
7	期末基金份额净值（元）	2.3606	1.0377
8	加权平均净值利润率	84.70%	6.96%
9	本期份额净值增长率	127.48%	6.95%
10	份额累计净值增长率	137.30%	4.31%

（二）基金净值表现

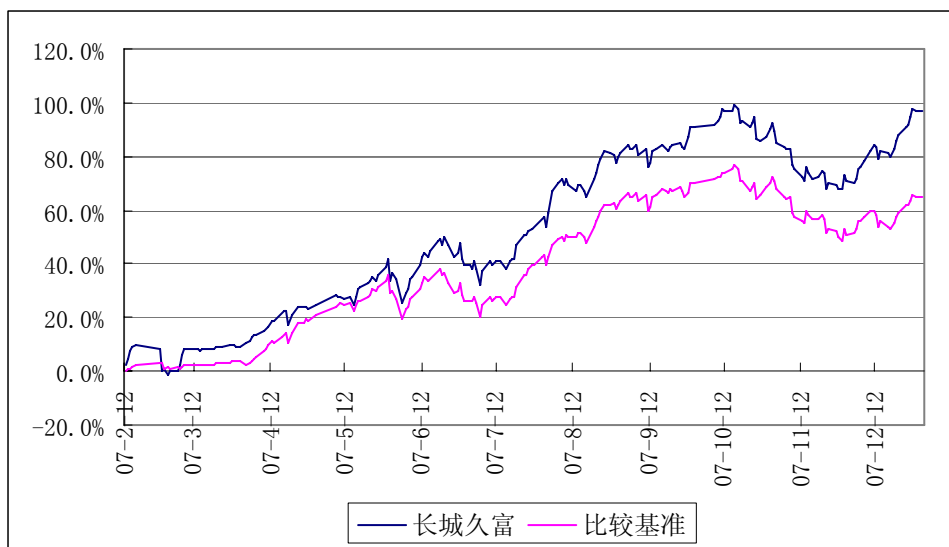
1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)

（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
过去三个月	3.04%	1.53%	-2.98%	1.49%	6.02%	0.04%
过去六个月	41.49%	1.69%	30.77%	1.57%	10.72%	0.12%
07-2-12 至 07-12-31	97.03%	1.82%	64.84%	1.58%	32.19%	0.24%

(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12月31日)

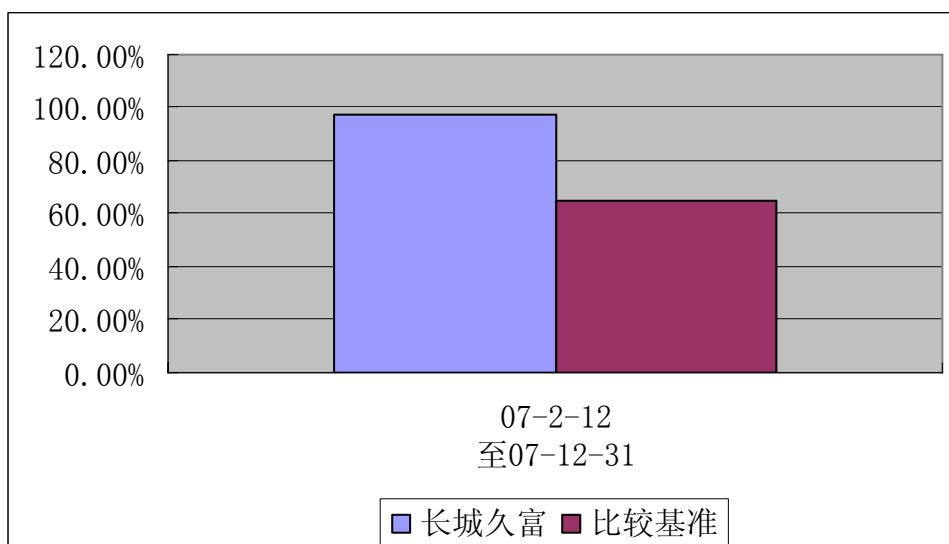


注：

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。

(3) 长城久富净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



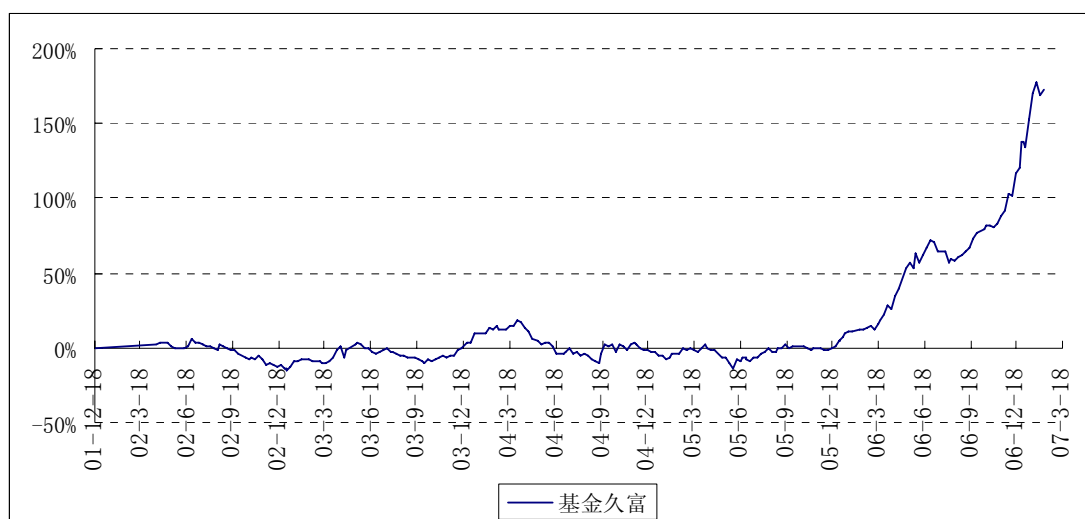
2、原久富证券投资基金

(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
06-10-8 至 07-2-9	54.18%	3.25%	-	-	-	-
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%	-	-	-	-
02-1-2 至 07-2-9	172.72%	2.55%	-	-	-	-
原封闭式基金基 金合同生效以来 至 07-2-9	172.70%	2.54%	-	-	-	-

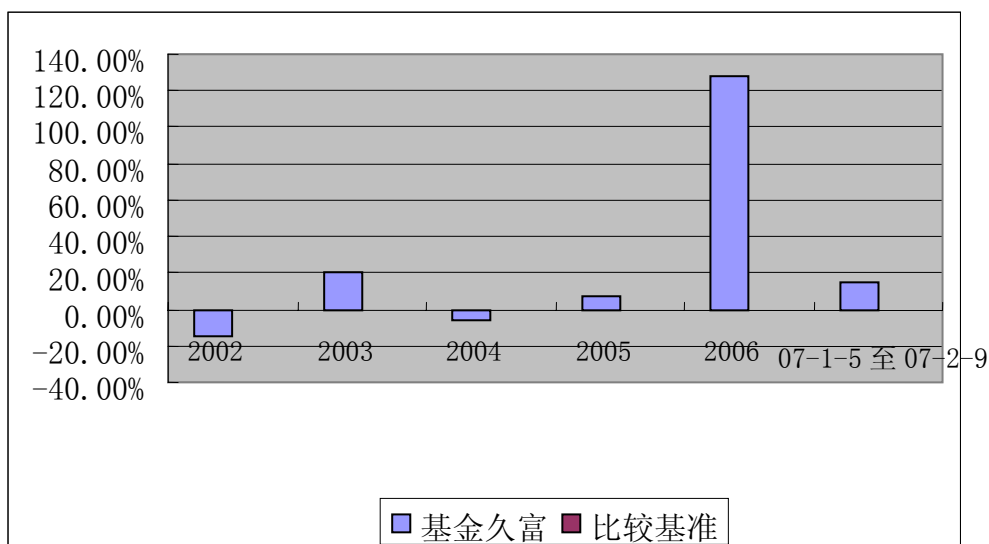
(2) 基金久富净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

(自成立以来至 2007 年 2 月 9 日)



注：基金久富无业绩比较基准。

(3) 基金久富净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



（三）收益分配情况

单位：元

年度		每 10 份基金 份额分 红数(元)	分红除息日	备注
2007 年	转型后(2007 年 2 月 12 日-2007 年 12 月 31 日)	6.000	除息日:2007 年 3 月 2 日	收益分配
		3.102	除息日:2007 年 3 月 12 日	转型拆分
	转型前(2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日)	0.000		
2001 年至 2006 年		0.000		
合计		9.102		

备注：

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 日本基金管理人对于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。

第四节 管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人简介

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

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。（自 2008 年 2 月 5 日起，“长城久富核心成长股票型证券投资基金”基金经理由徐九龙先生和李硕先生担任，项志群先生不再担任“长城久富核心成长股票型证券投资基金”基金经理。变更公告已于 2008 年 2 月 5 日在《证券时报》、《中国证券报》和《上海证券报》上刊登。）

（二）本报告期基金运作遵规守信情况声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城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，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况，本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整，有效地保护了基金持有人利益。

（三）报告期内投资策略和业绩表现说明及解释

2007年，上证综合指数从2675点起步，以5261点收盘，期间经历过“5·30”等较大幅度的回调，但是从三季度开始，随着基金发行规模激增和基金申购持续升温，大盘蓝筹股出现了集体性上涨，10月中旬创出了6124.04点全年新高。回顾07年的市场，前三季度均是以上扬走势为主，但第四季度受国内外多重因素的影响，在市场整体估值水平较高的情况下，大盘出现了较大幅度的回调。

本基金07年度业绩表现一般，虽然07年3月实行“封转开”，规模的快速扩张对基金投资组合有一定的影响，但是我们在投资组合方面也出现了一定的不足，最大的问题表现在均衡性方面，包括钢铁、航空，地产、建材、交通运输等周期类股票在获利了解后，无法高位回补，组合与以往相比明显失之均衡，四季度增加了前期跌幅较大的中小盘成长股，使得四季度业绩表现较好，对全年净值增长具有较大贡献。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

2008年，全球经济以及国内宏观经济面临的不确定因素增加。首先，美国经济受次贷影响尚未消除，经济增长放缓几乎已成定局，美国经济以及由其导致的全球经济减速将逐步传导至我国；其次，国内宏观经济虽然总体向好，但也面临CPI高企和流动性泛滥的等诸多困难，在内忧外患的形势下，政府宏观调控所面临的复杂性和难度进一步增加，因此政策走势和力度将对行业运行和证券市场产生较大影响；第三，08年我国证券市场逐步进入全流通时代，大小非的减持压力不容忽视，这将对市场的资金面和市场心理产生较大影响。

综上所述，我们认为08年各种不确定性因素的较多，上市公司的盈利增速可能低于预期，而08年的资金面和减持压力都将成为市场运行的制约因素，上述原因决定了08年证券市场将以振荡调整为主。但是，我们认为节能减排、人民币升值、扩大内需等依然会成为投资的主题之一。因此，在关注风险因素的同时，我们认为市场仍然存在结构性的投资机会。

在不确定性因素较多的08年，我们将更加注重配置确定性较大的投资品种，核心策略依然秉承“自下而上、精选个股”的原则，同时兼顾长、中、短期的资产类配置，我们将继续做好基本面研

究，注重板块和个股研究，深入挖掘企业的长期投资价值，寻找估值合理、竞争优势明显的持续成长类个股进行集中投资，争取给投资者更为丰厚的回报。

（五）基金内部监察报告

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据《基金管理公司内部控制指导意见》及其他法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规性，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。在本报告期内，本基金运作中无操纵市场行为、内幕交易和不当关联交易，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

第五节 托管人报告

2007 年度，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年度，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 年度，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、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

第六节 审计报告

（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金审计报告

深华(2008)审字 054 号

长城久富核心成长股票型证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的 长城久富核心成长股票型证券投资基金的财务报表，包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日的利润表、2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日的所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是长城久富核心成长股票型证券投资基金管理人的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允地反映了 长城久富核心成长股票型证券投资基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况和 2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日的经营成果。

深圳大华天诚会计师事务所

中国注册会计师 李秉心

中国 深圳

中国注册会计师 徐海宁

2008 年 3 月 18 日

（二）久富证券投资基金审计报告

深华(2008)审字 114 号

久富证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的 久富证券投资基金的财务报表，包括 2007 年 2 月 11 日的资产负债表、2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日的经营业绩表、2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日的收益分配表和基金净值变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算办法》、《金融企业会计制度》和《久富证券投资基金基金合同》的规定编制财务报表是 久富证券投资基金管理人的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施

审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和《久富证券投资基金基金合同》的规定编制，在所有重大方面公允地反映了 久富证券投资基金 2007 年 2 月 11 日的财务状况和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日的经营成果。

深圳大华天诚会计师事务所

中国注册会计师 胡春元

中国 深圳

中国注册会计师 徐海宁

2008 年 3 月 18 日

第七节 财务会计报告（已经审计）

一、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务会计报告

（一）长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务报表

1、长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007 年 12 月 31 日资产负债表

长城久富核心成长股票型证券投资基金
资产负债表
2007 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	注 释	2007 年 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
资产：			
银行存款		813,270,045.28	1,855,695.98
结算备付金		222,118,049.88	262,176,163.39

存出保证金		3,850,262.61	640,993.11
交易性金融资产	1	7,584,596,309.92	1,100,309,392.57
其中：股票投资		7,449,860,309.92	1,074,968,345.57
债券投资		134,736,000.00	25,341,047.00
资产支持证券		0.00	0.00
衍生金融资产	2	0.00	811,750.00
买入返售金融资产		0.00	0.00
应收证券清算款		0.00	0.00
应收利息	3	691,537.47	214,198.75
应收股利		0.00	0.00
应收申购款		28,473,764.43	0.00
其他资产		0.00	0.00
合计		8,652,999,969.59	1,366,008,193.80
负债：			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债		0.00	0.00
卖出回购金融资产款		0.00	0.00
应付证券清算款		15,455,888.59	6,979,161.93
应付赎回款		46,939,027.16	0.00
应付管理人报酬		10,246,539.69	607,610.98
应付托管费		1,707,756.60	101,268.50
应付销售服务费		0.00	0.00
应付交易费用	4	3,829,983.70	573,502.89
应交税费		0.00	0.00
应付利息		0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
其他负债	5	1,241,406.34	1,360,399.58
负债合计		79,420,602.08	9,621,943.88
所有者权益：			
实收基金	6	4,712,415,843.44	500,000,000.00
未分配利润		3,861,163,524.07	856,386,249.92
所有者权益合计		8,573,579,367.51	1,356,386,249.92
负债和所有者权益总计		8,652,999,969.59	1,366,008,193.80

附注：基金份额净值 1.8194 元，基金份额总额 4,712,415,843.44 份。

（后附注释系财务报表的组成部分）

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 12 月 31 日止期间利润表

长城久富核心成长股票型证券投资基金利润表
2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)-2007 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	注释	本期数
一、收入		5,790,768,926.39
1、利息收入		17,834,125.97
其中：存款利息收入		15,726,081.65
债券利息收入		2,108,044.32
资产支持证券利息收入		0.00
买入返售金融资产收入		0.00
2、投资收益(损失以“-”号填列)		3,389,517,198.20
其中：股票投资收益	7	3,334,013,832.67
债券投资收益	8	832,729.84
资产支持证券投资收益		0.00
衍生工具收益	9	13,654,141.79
股利收益		41,016,493.90
3、公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	10	2,372,709,431.36
4、其他收入(损失以“-”号填列)	11	10,708,170.86
二、费用		216,095,227.58
1、管理人报酬		119,353,884.60
2、托管费		19,892,314.13
3、销售服务费		0.00
4、交易费用	12	75,564,089.93
5、利息支出		0.00
其中：卖出回购金融资产支出		0.00
6、其他费用	13	1,284,938.92
三、利润总额		5,574,673,698.81

(后附注释系财务报表的组成部分)

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12月31日止期间所有者权益(基金净值)变动表

所有者权益(基金净值)变动表

2007年2月12日(基金合同生效日)-2007年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值) (基金合同生效日)	500,000,000.00	856,386,249.92	1,356,386,249.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	5,574,673,698.81	5,574,673,698.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以“-”填列)	4,212,415,843.44	-2,114,819,585.55	2,097,596,257.89
其中：1. 基金申购款	10,239,793,459.27	413,838,476.16	10,653,631,935.43
2. 基金赎回款	6,027,377,615.83	2,528,658,061.71	8,556,035,677.54

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	-455,076,839.11	-455,076,839.11
五、期末所有者权益(基金净值)	4,712,415,843.44	3,861,163,524.07	8,573,579,367.51

(后附注释系财务报表的组成部分)

(二) 长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)年度财务报表附注

(2007年2月12基金成立日至2007年12月31日)

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。

附注 2. 财务报表编制基准

本基金原以2006年2月15日以前颁布的企业会计准则、2001年11月27日颁布的《金融企业

会计制度》和 2001 年 9 月 12 日颁布的《证券投资基金会计核算办法》（以下合称“原会计准则和制度”）、《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 2 号-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《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起，本基金执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007 年度财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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 2 号《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》、《证券投资基金信息披露编报规则》及其他中国证监会颁布的相关规定以及《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定编制的年度财务报表。

在编制 2007 年度财务报表时，2007 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有项目已按照新企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。追溯调整涉及的主要内容包

(a) 将所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；

(b) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且其变动已计入当期损益。

按原会计准则和制度列报的 2007 年 2 月 12 日（基金合同生效日）和 2007 年 6 月 30 日所有者权益，以及 2007 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按新会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注 8。

附注 3. 重要会计政策

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 12 月 31 日。

2. 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

3. 基金资产和负债的分类原则

2007 年 7 月 1 日之前，基金资产和负债按其性质分类列示；自 2007 年 7 月 1 日起，基金资产和负债按下列原则进行分类：

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资按持有意图和持有能力划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；本基金目前持有的其他金融资产划分为应收款项。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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指引》和《长城久富核心成长股票型证券投资基金基金合同》制定。

估值对象为基金所拥有的股票、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 12 月 31 日，惟在交易所交易的证券市价以 2007 年 12 月 28 日（星期五）市场交易收盘价为准，在银行间市场交易的证券价格以 2007 年 12 月 29 日（星期六）采用估值技术确定的公允价值为准。

（1）股票估值方法

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 未上市股票的估值：

①首次发行的股票，于 2007 年 7 月 1 日之前按成本估值；自 2007 年 7 月 1 日起，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

②首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第 1) 条确定的估值价格进行估值。

④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times (D1 - Dr) / D1$$
 (FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天)。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(2) 债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 首次发行未上市债券于 2007 年 7 月 1 日之前按成本估值；自 2007 年 7 月 1 日起，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4) 在银行间债券市场交易的债券于 2007 年 7 月 1 日之前按成本估值；自 2007 年 7 月 1 日起，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收

益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(3) 权证估值方法

1) 上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的权证，于 2007 年 7 月 1 日之前按行业确定的公允价格估值；自 2007 年 7 月 1 日起，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(4) 资产支持证券的估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

(5) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(6) 在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，可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。

于 2007 年 7 月 1 日之前，实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目；自 2007 年 7 月 1 日起，实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动收益/(损失)”科目。

5. 证券投资基金成本计价方法

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。于 2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按成交日应支付的

全部价款入账；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按成交日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。

卖出股票于成交日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。除交易所交易的债券投资成本于 2007 年 7 月 1 日之前按成交日应支付的全部价款入账外，债券投资成本按成交日债券的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。买入债券应支付的全部价款中所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附注 3.5.3 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于成交日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。于 2007 年 7 月 1 日之前，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；自 2007 年 7 月 1 日起，权证投资成本按成交日权证的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。

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投资成本。

卖出权证于成交日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4) 买入返售金融资产

于 2007 年 7 月 1 日之前，买入返售金融资产于成交日按协议金额确认初始成本；自 2007 年 7 月 1 日起，买入返售金融资产于成交日按融出资金应付或实际支付的总额确认初始成本。

6. 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购(转入)和赎回(转出)引起的实收基金变动分别于基金申购(转入)确认日及基金赎回(转出)确认日认列。

7. 损益平准金

损益平准金包括损益平准金(未实现)和损益平准金(已实现)。损益平准金(未实现)指在申购(转入)或赎回(转出)基金份额时，申购(转入)或赎回(转出)款项中包含的利润分配（未分配利润）未实

现部分的余额占基金净值比例计算的金额。损益平准金(已实现)指在申购(转入)或赎回(转出)基金份额时, 申购(转入)或赎回(转出)款减去确认的实收基金和损益平准金(未实现)后的差额确定。损益平准金于基金申购(转入)确认日或基金赎回(转出)确认日认列, 于 2007 年 7 月 1 日之前, 损益平准金(未实现)在持有人权益中“未实现利得/(损失)”科目中核算; 损益平准金(已实现)在“损益平准金”科目中核算, 于期末将余额转入“收益分配(未分配收益)科目”。自 2007 年 7 月 1 日起, 损益平准金(已实现)与损益平准金(未实现)均在“损益平准金”科目中核算, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

8. 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益/(损失)其中权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除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。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认。自 2007 年 7 月 1 日起, 若票面利率与实际利率出现重大差异, 则按实际利率计算利息收入。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

于 2007 年 7 月 1 日之前, 买入返售金融资产收入按协议金额与协议利率在回购期内以直线法逐日计提; 自 2007 年 7 月 1 日起, 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

自 2007 年 7 月 1 日起, 公允价值变动收益/(损失)于估值日按公允价值变动产生的未实现估值增值/(减值)金额确认。

9. 费用的确认和计量

(1) 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基金合同》的规定按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提入账。

(2) 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。

(3) 卖出回购金融资产支出: 于 2007 年 7 月 1 日之前, 卖出回购金融资产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; 自 2007 年 7 月 1 日起, 卖出回购金融资产支

出按实收金额，在融资期限内按实际利率逐日计提入账。

（4）其他费用

发生的其他费用，于 2007 年 7 月 1 日之前，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。

发生的其他费用，自 2007 年 7 月 1 日起，如果影响每基金份额净值小数点后第四位的，即发生的其他费用大于基金净值万分之一，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四位的，即发生的其他费用小于基金净值万分之一，应于发生时直接计入基金损益。

10. 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则为：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。本基金收益以现金形式分配，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%。

11. 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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。

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3% 的税率缴纳。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂

免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注 4. 主要财务报表项目注释

注释 1. 交易性金融资产

项目	2007 年 12 月 31 日			2007 年 2 月 12 日		
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值
股票投资	4,653,404,968.78	7,449,860,309.92	2,796,455,341.14	651,739,427.78	1,074,968,345.57	423,228,917.79
债券投资	135,487,801.53	134,736,000.00	-751,801.53	25,341,072.29	25,341,047.00	-25.29
其中：交易所市场	---	---	---	1,072.29	1,047.00	-25.29
银行间市场	135,487,801.53	134,736,000.00	-751,801.53	25,340,000.00	25,340,000.00	---
合计	4,788,892,770.31	7,584,596,309.92	2,795,703,539.61	677,080,500.07	1,100,309,392.57	423,228,892.50

注释 2. 衍生金融资产

项目	2007 年 12 月 31 日			2007 年 2 月 12 日		
	成本	公允价值	估值增值	成本	公允价值	估值增值
权证投资	---	---	---	1,046,534.25	811,750.00	-234,784.25
合计	---	---	---	1,046,534.25	811,750.00	-234,784.25

注释 3. 应收利息

项 目	2007 年 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
银行存款利息	255,824.69	1,910.13
结算备付金利息	98,801.08	149,681.65
债券利息	336,861.54	62,345.68
权证交易价差保证金利息	50.16	261.29
合 计	691,537.47	214,198.75

注释 4. 应付交易费用

项 目	2007 年 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
应付佣金		
申银万国证券股份有限公司	---	17,317.51
东方证券股份有限公司	---	253,340.12
国泰君安证券股份有限公司	138,129.06	---
长城证券有限责任公司	---	271,055.93
中银国际证券有限责任公司	2,754,842.20	---
中国银河证券有限责任公司	936,012.44	31,789.33
小计	3,828,983.70	573,502.89
银行间交易费用	1,000.00	---
合计	3,829,983.70	573,502.89

注释 5. 其他负债

项目	2007 年 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
----	------------------	-----------------

应付赎回费	176,906.34	---
其他应付款	1,000,000.00	1,250,000.00
预提费用	64,500.00	110,399.58
合计	1,241,406.34	1,360,399.58

注释 6. 实收基金

项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
期初数（基金合同生效日）	500,000,000.00
加：本期申购（转入）增加数	10,239,793,459.27
其中：本期转型拆分折算增加	640,424,000.00
减：本期赎回（转出）减少数	6,027,377,615.83
期末数	4,712,415,843.44

* 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(LOF)集中申购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(LOF)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(LOF)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”。

**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. 股票投资收益

项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
卖出股票证券清算款	11,568,986,841.53
卖出交易费用	44,233,780.71

减：卖出股票成本总额*	8,269,495,148.23
卖出佣金	9,711,641.34
股票投资收益*	3,334,013,832.67

*卖出股票成本总额和股票投资收益按新会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的调节过程列示于本财务报表附注 8。

注释 8. 债券投资收益

项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
卖出债券及到期兑付证券清算款	191,411,081.38
卖出交易费用	747.66
减：卖出债券成本总额	188,249,502.31
卖出应收利息	2,329,096.89
应付银行间交易费用	500.00
债券投资收益	832,729.84

注释 9. 衍生工具收益

项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
卖出权证证券清算款	23,900,807.92
卖出交易费用	275.52
减：卖出权证成本总额	10,246,941.65
衍生工具收益	13,654,141.79

注释 10. 公允价值变动收益

项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
交易性金融资产	2,372,474,647.11
——股票投资	2,373,226,423.35
——债券投资	-751,776.24
衍生工具	234,784.25
——权证投资	234,784.25
合 计	2,372,709,431.36

注释 11. 其他收入

收入项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
赎回基金补偿收入	10,695,063.60
其他	13,107.26
合 计	10,708,170.86

注释 12. 交易费用

费用项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
交易所市场交易费用	75,562,351.43
银行间交易费用	1,738.50
合 计	75,564,089.93

交易费用按新会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的调节过程列示于本财务报表

表附注 8。

注释 13. 其他费用

费用项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
上市年费	53, 096. 04
信息披露费	265, 479. 78
审计费用	53, 096. 04
银行费用	6, 088. 50
银行间结算账户维护费	16, 078. 56
其他*	891, 100. 00
合 计	1, 284, 938. 92

* “其他”为 2007 年分红手续费及账户更名费。

注释 14. 本期已分配基金净收益

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
2007-3-2	6. 000	300, 000, 000. 00	300, 000, 000. 00
2007-3-12*	3. 102	155, 076, 839. 11	455, 076, 839. 11
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。

附注 5. 关联方关系及交易

1. 关联方关系：

关联方名称	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、本基金管理人主要股东控制的机构、本基金注册与登记机构、本基金销售机构	无
交通银行股份有限公司	本基金托管人、本基金销售机构	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

*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：

（1）本基金通过关联方席位进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

关联方名称	项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31	
		金额	占总额比例
1. 股票投资成交金额			
①长城证券有限责任公司	年成交量	4, 937, 145, 060. 78	21. 33%
②东方证券股份有限公司	年成交量	4, 625, 763, 405. 78	19. 98%
合计		9, 562, 908, 466. 56	41. 31%
2. 权证交易			
①东方证券股份有限公司	年成交量	8, 201, 067. 24	30. 63%
合计		8, 201, 067. 24	30. 63%
3. 支付的佣金			
①长城证券有限责任公司	支付年佣金	3, 956, 569. 41	21. 15%
②东方证券股份有限公司	支付年佣金	3, 702, 435. 90	19. 79%
合计		7, 659, 005. 31	40. 94%

*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。

***本基金本报告期末在关联方席位进行债券和回购交易。

(2) 本基金支付的关联方报酬

关联方名称	2007. 2. 12-2007. 12. 31	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	119,353,884.60	年费率 1.5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
交通银行股份有限公司	19,892,314.13	年费率 2.5‰	
合计	139,246,198.73		

(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

① 本基金管理人投资本基金的情况

2007 年 2 月 12 日至 2007 年 12 月 31 日投资本基金情况

关联方名称	项目	持有份额	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	---	---
	2007 年 12 月 31 日	5,702,120.00	0.12%

* 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。

② 本基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期末未持有本基金。

(5) 关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	2007 年 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
交通银行股份有限公司	银行存款	813,270,045.28	1,855,695.98

(6) 从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	2007. 2. 12-2007. 12. 31
交通银行股份有限公司	存款利息收入	4,477,321.43

(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 12 月 31 日	2007 年 2 月 12 日
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	10,246,539.69	607,610.98
应付托管费	交通银行股份有限公司	托管费	1,707,756.60	101,268.50
应付交易费用	长城证券有限责任公司	佣金	---	271,055.93
应付交易费用	东方证券股份有限公司	佣金	---	253,340.12
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

应收利息	交通银行股份有限公司	存款利息	255,824.69	1,910.13
合计			12,960,120.98	2,235,185.66

附注 6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2007 年 12 月 31 日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下：

(1) 因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券：

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601088	中国神华	2007-9-27	2008-1-9	网下认购	36.99	65.61	531,620	19,664,623.80	34,879,588.20
601390	中国中铁	2007-11-23	2008-3-3	网下认购	4.80	11.49	2,261,974	10,857,475.20	25,990,081.26
601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	网下认购	30.00	49.45	239,528	7,185,840.00	11,844,659.60
601857	中国石油	2007-10-30	2008-2-5	网下认购	16.70	30.96	564,030	9,419,301.00	17,462,368.80
601866	中海集运	2007-12-7	2008-3-12	网下认购	6.62	12.15	819,137	5,422,686.94	9,952,514.55
002189	利达光电	2007-11-19	2008-3-3	网下认购	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-3-7	网下认购	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	网下认购	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	网下认购	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70

(2) 期末持有的暂时停牌股票：

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600331	宏达股份	2007-09-27	重大事项	80.20	---	---	1,516,512	51,121,434.24	121,624,262.40
000400	许继电气	2007-09-10	重大事项	18.90	2008-01-07	20.79	1,871,246	24,279,316.52	35,366,549.40

附注 7. 风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

(b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易，因此除在附注 6 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的国债的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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%。

于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

2007 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值的比例
交易性金融资产	7,584,596,309.92	88.46%
－ 股票投资	7,449,860,309.92	86.89%
－ 债券投资	134,736,000.00	1.57%
衍生金融资产	---	---
合计	7,584,596,309.92	88.46%

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中信全债指数收益率}$ 。在假设市场其他变量不变的情况下，根据资本资产定价模型（CAMP）算出了本基金资产净值日收益率变化相对于业绩比较基准日收益率变化的敏感度系数为 0.9977，即在维持基金仓位等其他市场变量不变的情况下，于 2007 年 12 月 31 日，若本业绩比较基准日收益率上升 5%，本基金资产净值日增加额约为 427,674,837.49 元；反之，若本业绩比较基准日收益率下降 5%，本基金资产净值日减少额约为 427,674,837.49 元。

(ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	813,270,045.28	-	-	-	813,270,045.28
结算备付金	222,118,049.88	-	-	-	222,118,049.88
存出保证金	101,282.05	-	-	-	101,282.05
交易性金融资产	-	-	134,736,000.00	-	134,736,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	1,035,489,377.21	-	134,736,000.00	-	1,170,225,377.21

负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	1,035,489,377.21	-	134,736,000.00	-	1,170,225,377.21

于 2007 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

(iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

附注 8. 按新会计准则调整原会计准则的所有者权益及净损益

如附注 2 所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，并已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的 2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按新会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

项目	2007 年 2 月 12 日 (基金合同生效 日)所有者权益	2007 年 2 月 12 日(基金合 同生效日)至 2007 年 6 月 30 日止期间净损益	2007 年 6 月 30 日 所有者权益
按原会计准则列报的金额	1,356,386,249.92	533,210,720.19	9,754,641,983.03
金融资产公允价值变动的调整数	---	1,746,546,588.95*	---
按新会计准则列报的金额	1,356,386,249.92	2,279,757,309.14	9,754,641,983.03

*原利润表“未实现利得”。

实行新会计准则后，交易费用的会计处理方法由计入成本改变为计入当期损益，属于《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》规定需追溯调整之外的事项，本财务报表从重要性原则考虑，基于一定合理的假设，根据 2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日的股票交易费用支付信息，对相关报表项目进行重分类。由于债券、权证和回购的交易费用很小，对成本的影响也很小，因此不做重分类调整。

按原会计准则和制度列报的 2007 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日的交易费

用、股票差价收入、卖出股票成本总额调整为按新会计准则列报的交易费用、股票投资收益、卖出股票成本总额的过程列示如下：

项目	2007年2月12日 (基金合同生效日) 至2007年6月30日 交易费用	2007年2月12日 (基金合同生效日) 至2007年6月30日 股票投资收益 (原利润表“股票差价收入”)	2007年2月12日 (基金合同生效日) 至2007年6月30日 卖出股票成本总额
按原会计准则列报的金额	---	537,704,893.07	2,818,928,277.82
按新企业会计准则调整的金额	27,617,396.60*	27,617,396.60*	-16,418,969.41**
按新会计准则列报的金额	27,617,396.60	565,322,289.67	2,802,509,308.41

*2007年2月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日发生的股票买卖交易费用；

**2007年2月12日(基金合同生效日)至2007年6月30日发生的股票买入交易费用。

附注 9. 或有事项

本基金在本报告期内，无或有事项。

附注 10. 资产负债表日后事项

本基金在本报告期内，无资产负债表日后事项。

二、久富证券投资基金年度财务会计报告

（一）久富证券投资基金年度财务报表

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

久富证券投资基金资产负债表

2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

资产	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	1	262,176,163.39	111,851,829.25
交易保证金	2	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	3	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	4	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	5	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	6	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	7	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	8	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

（后附注释系财务报表的组成部分）

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

久富证券投资基金经营业绩表
2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日	2006 年度
一、收入			
1、股票差价收入	9	128,782,677.60	344,466,846.40
2、债券差价收入	10	(1,981,502.60)	(108,425.49)
3、权证差价收入	11	0.00	5,631,300.52
4、债券利息收入		806,824.80	4,440,235.36
5、存款利息收入		124,273.42	665,711.29
6、股利收入		0.00	6,646,393.62
7、买入返售证券收入		0.00	0.00
8、其他收入		0.00	0.00
收入合计		127,732,273.22	361,742,061.70
二、费用			
1、基金管理人报酬		2,251,510.63	11,545,732.89
2、基金托管费		375,251.76	1,924,288.84
3、基金销售服务费		0.00	0.00
4、卖出回购证券支出		272,514.26	387,205.74
5、利息支出		0.00	0.00
6、其他费用	12	55,920.58	344,023.52
其中：上市年费		6,903.96	60,000.00
信息披露费		34,520.22	200,000.00
审计费用		6,903.96	60,000.00
费用合计		2,955,197.23	14,201,250.99
三、基金净收益		124,777,075.99	347,540,810.71
加：未实现利得		51,319,166.63	313,896,518.40
四、基金经营业绩		176,096,242.62	661,437,329.11

（后附注释系财务报表的组成部分）

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

久富证券投资基金基金收益分配表
2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日	2006 年度
本期基金净收益		124,777,075.99	347,540,810.71
加：期初未分配收益		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	308,615,065.68
减：本期已分配基金净收益	12	0.00	0.00
期末基金净收益		433,392,141.67	308,615,065.68

（后附注释系财务报表的组成部分）

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

久富证券投资基金基金净值变动表
2007 年 1 月 1 日-2007 年 2 月 11 日

单位：人民币元

项目	注释	2007 年 1 月 1 日 -2007 年 2 月 11 日	2006 年度
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	347,540,810.71
未实现利得		51,319,166.63	313,896,518.40
经营活动产生的基金净值变动数		176,096,242.62	661,437,329.11
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	1,180,290,007.30

（后附注释系财务报表的组成部分）

（二）久富证券投资基金年度财务报表附注

（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日）

附注 1. 基金的基本情况

本基金是根据中国证监会《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久富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，于 2001 年 12 月 18 日正式成立，规模 253,697,560 份基金份额。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。

本基金于 2002 年 4 月 18 日在深交所上市（交易代码 184720），基金存续期延长 5 年，至 2007 年 5 月 20 日，本基金又于 2002 年 5 月 28 日成功扩募至 5 亿份基金份额，发起人认购基金总份额的

1%的基金份额，即 500 万份基金份额，其余由社会公众持有，扩募部分于 2002 年 6 月 6 日在深交所上市。

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》自同一日起失效。

附注 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 2 号-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。

本基金于 2007 年 2 月 11 日由封闭式基金转为开放式基金，但本报告期的会计报表是以持续经营假设为基础进行编制。

附注 3. 重要会计政策

(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 1 月 1 日至 2007 年 2 月 11 日（基金合同终止日）。

(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

本基金的会计核算以权责发生制为记账基础，以历史成本为计价原则，期末股票和债券按市值计价。

(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《久富证券投资基金基金合同》制定。

估值对象为基金所拥有的股票、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 2 月 11 日，惟证券市价以 2007 年 2 月 9 日（星期五）市场平均价为准。

银行存款、清算备付金按本金估值，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平均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场平均价估值；已上市但未流通的新股按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场平均价估值。

未上市股票应区分以下情况处理：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平均价估值；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平均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在债券持有期间内计提利息。

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

处于未上市期间的权证，例如权证发行至上市日之间等情况，可应用 B-S 模型等估值技术确定其公允价值。

配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市场平均价高于配股价的差额估值，如果市场平均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，在资产负债表中的“未实现利得”项目列示。

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发行之基金总份额，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，先计算买入成本，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账。

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。

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。

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，按成交金额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和非上市流通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赠的权证数量，该等权证初始成本为零。

③卖出权证于成交日确认证权差价收入。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

④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). 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。

(10). 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《久富证券投资基金基金合同》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《久富证券投资基金基金合同》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约定利率，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。

(11). 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益应先弥补上年亏损后，才进行当年收益分配。基金投资当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配采取现金方式或法规

允许的其他方式，每年分配一次，收益分配比例不低于基金可分配净收益的90%。

(12). 税项

A. 营业税

根据财政部、国家税务总局财税字〔1998〕55号及财税〔2001〕61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》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

本基金买卖股票原印花税率0.2%。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、国家税务总局财税字〔1998〕55号文《关于证券投资基金税收问题的通知》的规定：对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴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。

附注 4. 主要财务报表项目注释

注释 1. 清算备付金

项目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
上交所清算备付金	255,942,905.77	86,715,425.15
深交所清算备付金	500,258.73	22,668,681.98
上交所最低结算备付金	4,646,068.17	1,938,703.94
深交所最低结算备付金	1,086,930.72	529,018.18
合计	262,176,163.39	111,851,829.25

注释 2. 交易保证金

项目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
深交所交易保证金	531,383.50	500,000.00
上交所权证交易价差保证金	54,054.05	54,054.05
深交所权证交易价差保证金	55,555.56	55,555.56
合计	640,993.11	609,609.61

注释 3. 应收利息

项 目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
银行存款利息	1,910.13	170.20
清算备付金利息	149,681.65	27,360.15
债券利息	62,345.68	2,206,505.21
权证交易价差保证金利息	261.29	49.30
合 计	214,198.75	2,234,084.86

注释 4. 应付佣金

项 目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
申银万国证券股份有限公司	17,317.51	63,467.46
东方证券股份有限公司	253,340.12	361,712.11
国泰君安证券股份有限公司	---	80,366.85
长城证券有限责任公司	271,055.93	119,802.55
中银国际证券有限责任公司	---	294,801.78
中国银河证券有限责任公司	31,789.33	142,145.67
合 计	573,502.89	1,062,296.42

注释 5. 其他应付款

项目名称	经济内容	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
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
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

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
中国银河证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
合 计		1,250,000.00	1,250,000.00

注释 6. 预提费用

项 目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日	结存原因
上海证券报信息披露费	11,506.74	---	未支付
中国证券报信息披露费	11,506.74	---	未支付
证券时报信息披露费	11,506.74	---	未支付
审计费用	66,903.96	60,000.00	未支付
上市年费	6,903.96	---	未支付
银行间账户维护费	2,071.44	---	未支付
合 计	110,399.58	60,000.00	

注释 7. 实收基金

项 目	2007 年 2 月 11 日		2006 年 12 月 31 日	
	基金份额数	实收基金	基金份额数	实收基金
公众持有份额	495,000,000.00	495,000,000.00	495,000,000.00	495,000,000.00
发起人持有份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
合 计	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00	500,000,000.00

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 8. 未实现利得

项目	2007 年 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
投资估值增值-股票投资	423,228,917.79	372,215,604.59
投资估值增值-债券投资	-25.29	-540,662.97
投资估值增值-权证投资	-234,784.25	---
合计	422,994,108.25	371,674,941.62

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 9. 股票差价收入

项目	2007. 1. 1-2007. 2. 11	2006 年度
卖出股票成交总额	380,020,718.86	1,909,985,930.09
减：卖出股票成本总额	250,921,621.71	1,563,914,498.39
卖出佣金	316,419.55	1,604,585.30

股票差价收入	128,782,677.60	344,466,846.40
--------	----------------	----------------

注释 10. 债券差价收入

项目	2007. 1. 1-2007. 2. 11	2006 年度
卖出债券成交总额	264,906,259.59	3,680,726.48
减：卖出债券成本总额	264,460,643.08	3,769,943.27
卖出应收利息	2,427,119.11	19,208.70
债券差价收入	-1,981,502.60	-108,425.49

注释 11. 权证差价收入

项目	2007. 1. 1-2007. 2. 11	2006 年度
卖出权证成交总额	---	5,631,300.52
减：卖出权证成本总额	---	---
卖出佣金	---	---
权证差价收入	---	5,631,300.52

注释 12. 其他费用

费用项目	2007. 1. 1-2007. 2. 11	2006 年度
上市年费	6,903.96	60,000.00
信息披露费	34,520.22	200,000.00
审计费用	6,903.96	60,000.00
银行费用	21.00	2,248.50
交易所费用	1,000.00	3,775.02
账户维护费	6,571.44	18,000.00
合 计	55,920.58	344,023.52

注释 13. 本期已分配基金净收益

本基金本期末进行收益分配。

附注 5. 关联方关系及交易

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
交通银行股份有限公司	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：

（1）本基金通过关联方席位进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

关联方名称	项目	2007. 1. 1-2007. 2. 11		2006 年度	
		金额	占总额比例	金额	占总额比例
1. 股票投资成交金额					
①长城证券有限责任公司	年成交量	332, 191, 092. 37	46. 08%	760, 015, 384. 86	20. 61%
②东方证券股份有限公司	年成交量	323, 754, 041. 33	44. 91%	665, 634, 101. 96	18. 05%
合计		655, 945, 133. 70	90. 99%	1, 425, 649, 486. 82	38. 66%
2. 债券投资成交金额					
①长城证券有限责任公司	年成交量	53, 677, 562. 80	17. 09%	13, 311, 315. 70	9. 63%
②东方证券股份有限公司	年成交量	---	---	40, 095, 020. 60	29. 00%
合计		53, 677, 562. 80	17. 09%	53, 406, 336. 30	38. 63%
3. 债券回购交易					
①长城证券有限责任公司	年成交量	160, 000, 000. 00	100. 00%	234, 000, 000. 00	38. 74%
②东方证券股份有限公司	年成交量	---	---	100, 000, 000. 00	16. 56%
合计		160, 000, 000. 00	100. 00%	334, 000, 000. 00	55. 30%
4. 权证交易					
①长城证券有限责任公司	年成交量	---	---	4, 963, 717. 07	88. 14%
②东方证券股份有限公司	年成交量	1, 046, 429. 60	100. 00%	---	---
合计		1, 046, 429. 60	100. 00%	4, 963, 717. 07	88. 14%
5. 支付的佣金					
①长城证券有限责任公司	支付年佣金	271, 055. 93	47. 26%	615, 501. 26	20. 67%
②东方证券股份有限公司	支付年佣金	253, 340. 12	44. 17%	533, 873. 28	17. 93%
合计		524, 396. 05	91. 44%	1, 149, 374. 54	38. 60%

*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）本基金支付的关联方报酬

关联方名称	2007. 1. 1-2007. 2. 11	2006 年度	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	2, 251, 510. 63	11, 545, 732. 89	年费率 1. 5%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
交通银行股份有限公司	375, 251. 76	1, 924, 288. 84	年费率 2. 5‰	
合计	2, 626, 762. 39	13, 470, 021. 73		

（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

①本基金管理人投资本基金的情况

A. 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	---	---
	减：本期减少	---	---
	2007 年 2 月 11 日	2,500,000.00	0.50%

B. 2006 年度投资本基金情况

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	---	---
	减：本期减少	---	---
	2006 年 12 月 31 日	2,500,000.00	0.50%

②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 12 月 31 日	
	持有份额	比例	持有份额	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 12 月 31 日
交通银行股份有限公司	银行存款	1,855,695.98	618,936.57

（6）从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	2007.1.1-2007.2.11	2006 年度
交通银行股份有限公司	存款利息收入	1,739.93	14,403.38

（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 2 月 11 日	2006 年 12 月 31 日
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	607,610.98	1,363,534.50
应付基金托管费	交通银行股份有限公司	托管费	101,268.50	227,255.76
应付佣金	长城证券有限责任公司	佣金	271,055.93	119,802.55
应付佣金	东方证券股份有限公司	佣金	253,340.12	361,712.11
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	交通银行股份有限公司	存款利息	1,910.13	170.20
合计			2,235,185.66	3,072,475.12

附注 6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

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	

附注 7. 或有事项

本基金在本报告期内，无或有事项。

附注 8. 资产负债表日后事项

本基金在本报告期内，无资产负债表日后事项。

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	7,449,860,309.92	86.10%
2	债券	134,736,000.00	1.56%
3	银行存款和清算备付金合计	1,035,388,095.16	11.97%
4	权证	0.00	0.00%
5	资产支持证券	0.00	0.00%

6	其它资产	33,015,564.51	0.38%
	合计	8,652,999,969.59	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	870,900,072.93	10.16%
C 制造业	3,670,502,670.96	42.81%
C0 食品、饮料	651,939,320.00	7.60%
C1 纺织、服装、皮毛	30,604,043.72	0.36%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	3,557,605.50	0.04%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	814,163,361.20	9.50%
C5 电子	156,224,337.16	1.82%
C6 金属、非金属	145,384,487.90	1.70%
C7 机械、设备、仪表	1,443,296,347.95	16.83%
C8 医药、生物制品	424,411,232.88	4.95%
C99 其他制造业	921,934.65	0.01%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	491,279,237.27	5.73%
E 建筑业	132,325,634.70	1.54%
F 交通运输、仓储业	346,744,854.99	4.04%
G 信息技术业	48,029,958.74	0.56%
H 批发和零售贸易业	237,886,175.02	2.77%
I 金融、保险业	1,113,822,149.80	12.99%
J 房地产业	20,943,942.20	0.24%
K 社会服务业	83,969,815.00	0.98%
L 传播与文化产业	351,960,340.00	4.11%
M 综合类	81,495,458.31	0.95%
合计	7,449,860,309.92	86.89%

（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	13,348,616	515,924,008.40	6.02%
2	600036	招商银行	9,600,000	380,448,000.00	4.44%
3	000568	泸州老窖	4,800,000	352,800,000.00	4.12%
4	600037	歌华有线	11,190,000	351,813,600.00	4.10%
5	600150	中国船舶	1,400,000	349,636,000.00	4.08%
6	600786	东方锅炉	3,520,000	297,264,000.00	3.47%
7	600519	贵州茅台	1,210,000	278,300,000.00	3.25%

8	600509	天富热电	7,315,662	266,802,193.14	3.11%
9	600030	中信证券	2,885,100	257,552,877.00	3.00%
10	600029	南方航空	8,009,902	223,796,661.88	2.61%
11	600000	浦发银行	4,000,000	211,200,000.00	2.46%
12	601318	中国平安	1,900,000	201,590,000.00	2.35%
13	002038	双鹭药业	3,102,200	187,683,100.00	2.19%
14	600674	川投能源	5,800,000	186,644,000.00	2.18%
15	000157	中联重科	2,900,000	166,605,000.00	1.94%
16	601699	潞安环能	2,109,951	151,431,183.27	1.77%
17	600028	中国石化	5,950,000	139,408,500.00	1.63%
18	600123	兰花科创	2,877,234	135,057,363.96	1.58%
19	600331	宏达股份	1,516,512	121,624,262.40	1.42%
20	600478	力元新材	4,078,476	113,830,265.16	1.33%
21	600583	海油工程	2,180,000	113,534,400.00	1.32%
22	000983	西山煤电	1,745,650	110,796,405.50	1.29%
23	600970	中材国际	1,777,592	106,335,553.44	1.24%
24	601006	大秦铁路	3,913,860	100,273,093.20	1.17%
25	600867	通化东宝	6,020,000	84,039,200.00	0.98%
26	600138	中青旅	2,500,000	83,350,000.00	0.97%
27	600309	烟台万华	2,183,590	83,085,599.50	0.97%
28	600858	银座股份	2,168,009	81,495,458.31	0.95%
29	002147	方圆支承	1,818,606	81,109,827.60	0.95%
30	002007	华兰生物	1,391,458	74,150,796.82	0.86%
31	600875	东方电气	800,000	71,200,000.00	0.83%
32	600693	东百集团	2,307,471	69,131,831.16	0.81%
33	000968	煤气化	2,069,160	68,985,794.40	0.80%
34	600848	自仪股份	4,033,748	67,686,291.44	0.79%
35	000951	中国重汽	1,000,000	66,300,000.00	0.77%
36	601088	中国神华	1,000,000	65,610,000.00	0.77%
37	000800	一汽轿车	3,406,729	65,068,523.90	0.76%
38	002018	华星化工	1,940,640	62,682,672.00	0.73%
39	002024	苏宁电器	864,124	62,087,309.40	0.72%
40	000581	威孚高科	3,124,042	58,450,825.82	0.68%
41	600500	中化国际	2,579,939	56,965,053.12	0.66%
42	600517	置信电气	942,055	53,244,948.60	0.62%
43	000617	石油济柴	1,300,000	49,868,000.00	0.58%
44	000759	武汉中百	2,535,461	47,666,666.80	0.56%
45	601666	平煤天安	999,950	46,417,679.00	0.54%
46	600501	航天晨光	2,399,927	41,998,722.50	0.49%
47	002055	得润电子	1,673,937	41,848,425.00	0.49%
48	600557	康缘药业	1,207,336	36,437,400.48	0.43%
49	002182	云海金属	1,300,000	36,309,000.00	0.42%
50	000400	许继电气	1,871,246	35,366,549.40	0.41%

51	601939	建设银行	3,546,000	34,928,100.00	0.41%
52	601600	中国铝业	843,200	33,213,648.00	0.39%
53	600439	瑞贝卡	610,574	30,394,373.72	0.35%
54	002151	北斗星通	495,459	28,736,622.00	0.34%
55	600801	华新水泥	747,633	27,079,267.26	0.32%
56	002030	达安基因	1,233,226	26,304,710.58	0.31%
57	601390	中国中铁	2,261,974	25,990,081.26	0.30%
58	600660	福耀玻璃	600,000	21,516,000.00	0.25%
59	000869	张裕A	243,450	20,839,320.00	0.24%
60	600649	原水股份	1,001,633	20,142,839.63	0.23%
61	600748	上实发展	410,510	19,047,664.00	0.22%
62	600416	湘电股份	614,360	18,719,549.20	0.22%
63	600396	金山股份	888,955	17,690,204.50	0.21%
64	601857	中国石油	564,030	17,462,368.80	0.20%
65	600458	时代新材	1,018,454	17,222,057.14	0.20%
66	002065	东华合创	430,679	16,697,424.83	0.19%
67	600351	亚宝药业	800,000	13,680,000.00	0.16%
68	600486	扬农化工	429,738	13,545,341.76	0.16%
69	600087	南京水运	535,012	12,722,585.36	0.15%
70	601168	西部矿业	299,000	12,471,290.00	0.15%
71	601601	中国太保	239,528	11,844,659.60	0.14%
72	601169	北京银行	529,920	10,789,171.20	0.13%
73	600219	南山铝业	400,451	10,688,037.19	0.12%
74	600961	株冶集团	369,029	10,011,756.77	0.12%
75	601866	中海集运	819,137	9,952,514.55	0.12%
76	601808	中海油服	283,200	9,725,088.00	0.11%
77	600312	平高电气	346,874	7,933,008.38	0.09%
78	000751	锌业股份	339,300	5,890,248.00	0.07%
79	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.07%
80	002142	宁波银行	249,400	5,469,342.00	0.06%
81	002122	天马股份	34,709	5,202,532.01	0.06%
82	000815	美利纸业	171,865	3,557,605.50	0.04%
83	600861	北京城乡	119,654	2,035,314.54	0.02%
84	002146	荣盛发展	52,340	1,896,278.20	0.02%
85	002194	武汉凡谷	33,001	1,713,081.91	0.02%
86	600713	南京医药	100,000	1,592,000.00	0.02%
87	002152	广电运通	13,500	1,451,385.00	0.02%
88	002173	山下湖	30,277	921,934.65	0.01%
89	002149	西部材料	18,374	676,530.68	0.01%
90	002186	全聚德	10,500	619,815.00	0.01%
91	002198	嘉应制药	22,500	524,025.00	0.01%
92	002161	远望谷	10,925	471,960.00	0.01%
93	002189	利达光电	24,710	363,237.00	0.00%

94	002184	海得控制	15,000	345,150.00	0.00%
95	002196	方正电机	12,880	314,014.40	0.00%
96	002193	山东如意	8,700	209,670.00	0.00%
97	002188	新嘉联	8,500	182,410.00	0.00%
98	002181	粤传媒	5,500	146,740.00	0.00%
99	002190	成飞集成	6,500	137,540.00	0.00%
100	002167	东方锆业	2,000	79,420.00	0.00%
101	002195	海隆软件	2,000	65,720.00	0.00%

注：以上股票名称以 2007 年 12 月 31 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	000568	泸州老窖	526,606,525.31	6.14%
2	600037	歌华有线	389,468,191.00	4.54%
3	600028	中国石化	367,746,092.67	4.29%
4	600036	招商银行	343,188,352.93	4.00%
5	600030	中信证券	312,851,587.94	3.65%
6	600143	金发科技	303,835,204.86	3.54%
7	600000	浦发银行	277,606,659.45	3.24%
8	601318	中国平安	244,668,444.99	2.85%
9	600029	南方航空	222,885,043.69	2.60%
10	600016	民生银行	221,451,194.02	2.58%
11	600150	中国船舶	214,449,992.06	2.50%
12	600786	东方锅炉	190,629,479.65	2.22%
13	600674	川投能源	190,213,855.72	2.22%
14	600050	中国联通	182,961,410.73	2.13%
15	600509	天富热电	172,274,382.89	2.01%
16	601088	中国神华	171,232,282.61	2.00%
17	000157	中联重科	169,852,760.57	1.98%
18	000002	万科A	146,848,011.73	1.71%
19	600583	海油工程	138,926,358.15	1.62%
20	000876	新希望	132,090,540.00	1.54%

注：本表中本期累计买入金额在 2007 年 1 月 1 日至 6 月 30 日按 2001 年 9 月 12 日颁布的《证券投资基金会计核算办法》计算，2007 年 7 月 1 日至 12 月 31 日按 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》计算。

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	000568	泸州老窖	587,930,751.97	6.86%
2	600036	招商银行	440,500,968.62	5.14%
3	600000	浦发银行	384,991,177.30	4.49%
4	000002	万科A	371,690,956.35	4.34%
5	600030	中信证券	354,094,824.71	4.13%
6	600028	中国石化	309,829,749.03	3.61%
7	601318	中国平安	289,513,897.31	3.38%
8	600037	歌华有线	240,690,392.23	2.81%
9	600016	民生银行	221,831,603.48	2.59%
10	600150	中国船舶	202,359,627.42	2.36%
11	000858	五 粮 液	196,814,600.00	2.30%
12	600761	安徽合力	186,891,381.82	2.18%
13	000617	石油济柴	179,711,965.31	2.10%
14	000157	中联重科	177,275,687.74	2.07%
15	600050	中国联通	172,790,107.33	2.02%
16	000069	华侨城A	163,511,547.47	1.91%
17	000402	金 融 街	156,966,722.44	1.83%
18	600717	天津港	156,161,563.02	1.82%
19	000876	新 希 望	149,586,558.62	1.74%
20	600875	东方电气	149,481,179.44	1.74%

注：本表中本期累计卖出金额按实际证券清算款计算。

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	11,802,233,400.92
报告期内卖出股票的收入总额	11,568,986,841.53

注：本表中数据统计的口径与上述两表一致。

（五）报告期末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	134,736,000.00	1.57%
4	可转换债	0.00	0.00%
5	央行票据	0.00	0.00%
	合 计	134,736,000.00	1.57%

（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	债券代码	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	-----------

1	058031	05 中信债 1	134,736,000.00	1.57%
---	--------	----------	----------------	-------

（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

截至本报告期末，长城久富基金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	3,850,262.61
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收利息	691,537.47
5	应收申购款	28,473,764.43
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	0.00
	合计	33,015,564.51

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

本报告期末，本基金未持有权证投资。

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)	投资收益(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
30002	五粮 YGC1	0	0.00	0	0.00	50,000	-232,463.81	0
31001	侨城 HQC1	0	0.00	100,000	2,870,273.02	100,000	116,513.87	0
31003	深发 SFC1	93,521	0.00	0	0.00	93,521	1,529,843.82	0
31004	深发 SFC2	46,760	0.00	0	0.00	46,760	1,225,351.40	0

7、以上各表的股票名称均以 2007 年 12 月 31 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12月31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	310,396 户
平均每户持有基金份额	15,181.95 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	431,996,921.41	9.17%
个人投资者	4,280,418,922.03	90.83%
合计	4,712,415,843.44	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	17.62%	2.35%
2	中国人寿保险股份有限公司	54,552,957.00	8.69%	1.16%
3	太平人寿保险有限公司	44,011,082.00	7.01%	0.93%
4	中国人寿保险股份有限公司	24,363,596.00	3.88%	0.52%
5	中国人民财产保险股份有限公司	21,586,192.00	3.44%	0.46%
6	太平人寿保险有限公司	16,607,758.00	2.64%	0.35%
7	中国再保险（集团）公司	16,073,182.00	2.56%	0.34%
8	中国人寿再保险股份有限公司	13,207,130.00	2.10%	0.28%
9	首创安泰人寿保险有限公司	10,000,000.00	1.59%	0.21%
10	中国平安保险（集团）股份有限公司	9,647,618.00	1.54%	0.20%

4、期末本基金管理人从业人员投资本开放式基金的情况

项目	期末持有本开放式基金份额的总量（份）	占本基金总份额比例（%）
本基金管理人持有本基金的所有从业人员	128,212.62	0.0031

（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	银河一渣打—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	10,239,793,459.27
4	其中：本期转型拆分折算增加	640,424,000.00
5	减：本期赎回基金份额总额	6,027,377,615.83
6	期末基金份额总额	4,712,415,843.44

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；久富基金名称变更为长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)，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）经长城基金管理有限公司股东会2007年第一次审议通过，选举桑煜先生任公司监事，李建中先生不再任公司监事；选举杨玉成先生任公司董事，贺若先先生不再任公司董事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第二次会议审议通过，同意麦建光先生辞去公司独立董事，聘任谢志华先生任公司独立董事，选举韩刚先生任公司监事。经长城基金管理有限公司股东会2007年第六次会

议审议通过，选举王国斌先生任公司董事，杨玉成先生不再担任公司董事。经长城基金管理有限公司股东会 2007 年第七次会议审议通过，吕莉女士不再担任公司董事，杨传益女士不再担任公司监事。经长城基金管理有限公司股东会 2007 年第八次会议审议通过，批准邹平先生、龙熙霖先生不再担任公司董事，选举杨平先生、赵玉华先生任公司董事。监管部门对以上任命无异议。

（三）基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 10 月 19 日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

（四）2007 年 12 月 21 日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 12 月 21 日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》。

（五）本报告期内本基金管理人办公地址及注册地址由“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”。

（六）报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

（七）报告期内基金投资策略无改变。

（八）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 日本基金管理人对于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。

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。

（九）本基金会计事务所本期间无变更，本报告期支付本基金聘任会计师事务所 2006 年度审计服务费；截止本报告期末，该会计师事务所已为本基金连续提供审计服务陆年零壹个月；

（十）报告期内基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚；

（十一）2007年1月1日至2007年12月31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	5,269,336,153.15	22.08%
申银万国证券股份有限公司	1	4,561,079,065.24	19.11%
东方证券股份有限公司	2	4,949,517,447.11	20.74%
国泰君安证券股份有限公司	1	1,009,395,566.39	4.23%
中银国际证券有限责任公司	1	5,558,895,566.02	23.29%
银河证券有限责任公司	1	2,520,989,904.46	10.56%
合计	8	23,869,213,702.37	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	15.70%
申银万国证券股份有限公司	1	283,539,227.50	82.91%
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	2,828,100.00	0.83%
银河证券有限责任公司	1	1,948,203.60	0.57%
合计	8	341,993,093.90	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	58.81%
东方证券股份有限公司	2	9,247,496.84	33.24%

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	3.54%
银河证券有限责任公司	1	1,225,351.40	4.40%
合计	8	27,819,223.60	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	4,227,625.34	21.93%
申银万国证券股份有限公司	1	3,737,446.29	19.39%
东方证券股份有限公司	2	3,955,776.02	20.52%
国泰君安证券股份有限公司	1	827,696.26	4.29%
中银国际证券有限责任公司	1	4,558,263.35	23.64%
银河证券有限责任公司	1	1,972,688.88	10.23%
合计	8	19,279,496.14	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。

（十二）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股份有限公司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5月8日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《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）2007年7月2日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过交通银行股份有限公司开办定期定额投资业务的公告》。

（23）2007年7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《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)2007年第2季度报告》。

（24）2007年8月25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年半年度报告摘要》。

（25）2007年9月22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《关于修改长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同的公告》。

（26）2007年9月24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更新的招募说明书摘要（2007年第1号）》。

（27）2007年9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《关于修改长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)托管协议的公告》。

（28）2007年9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旗下开放式基金通过中国光大银行网上银行申购实行费率优惠的公告》。

（29）2007年10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《长城基金管理有限公司关于增加中国光大银行为长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城久泰中信标普300指数证券投资基金代销机构的公告》。

（30）2007年9月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于参与交通银行基金“定期定额申购”推广活动的公告》。

（31）2007年10月10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中国农业银行为长城消费、长城久泰、长城久富基金代销机构的公告》。

（32）2007年10月24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年三季度报告》。

（33）2007年10月26日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下开放式基金通过广州证券有限责任公司开办定期定额投资业务的公告》。

（34）2007年10月31日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于增加齐鲁证券有限公司为长城基金管理有限公司旗下开放式基金代销机构的公告》。

（35）2007年10月31日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于通过中国建设银行股份有限公司开办旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

（36）2007年11月1日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过招商银行股份有限公司开办长城基金管理有限公司旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

（37）2007年11月15日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过华夏银行股份有限公司开办长城基金管理有限公司旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

（38）2007年11月16日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于增加中信万通证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构的公告》。

（39）2007年11月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过中国农行开办长城基金管理有限公司旗下开放式基金定期定额投资业务公告》。

（40）2007年11月28日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《长城基金管理有限公司关于增加注册资本的公告》。

（41）2007年12月17日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下开放式基金通过各代销券商机构开办定期定额投资业务的公告》。

（42）2007年12月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过中国光大银行开办旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

（43）2007年12月18日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于通过兴业银行开办旗下开放式基金定期定额投资业务的公告》。

（44）2007年12月24日本基金管理人在中国证券报、上海证券报、证券时报上刊登了《关于旗下基金通过国盛证券有限责任公司网上交易前端申购实行费率优惠的公告》。

（45）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）报告期内披露的公告原件
- （六）基金管理人企业法人业务资格批件、基金管理资格证书
- （七）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
二〇〇八年三月二十六日