

# 长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF) 2016 年年度报告摘要

2016 年 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

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本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 2017 年 03 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长城久富混合（LOF）
场内简称	长城久富
基金主代码	162006
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
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
报告期末基金份额总额	871, 253, 699. 00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 5 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

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%×沪深 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率
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债券基金与货币市场基金，但低于股票基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	陆志俊
	联系电话	0755-23982338	95559
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8868-666	95559
传真		0755-23982328	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-305,044,052.03	719,854,922.07	235,652,824.48
本期利润	-309,617,896.09	549,566,251.92	256,007,616.27
加权平均基金份额本期利润	-0.3352	0.4877	0.1369
本期基金份额净值增长率	-22.61%	32.95%	15.43%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0629	0.4979	0.1747
期末基金资产净值	926,030,164.61	1,409,972,009.71	1,737,892,618.10
期末基金份额净值	1.0629	1.4979	1.1747

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

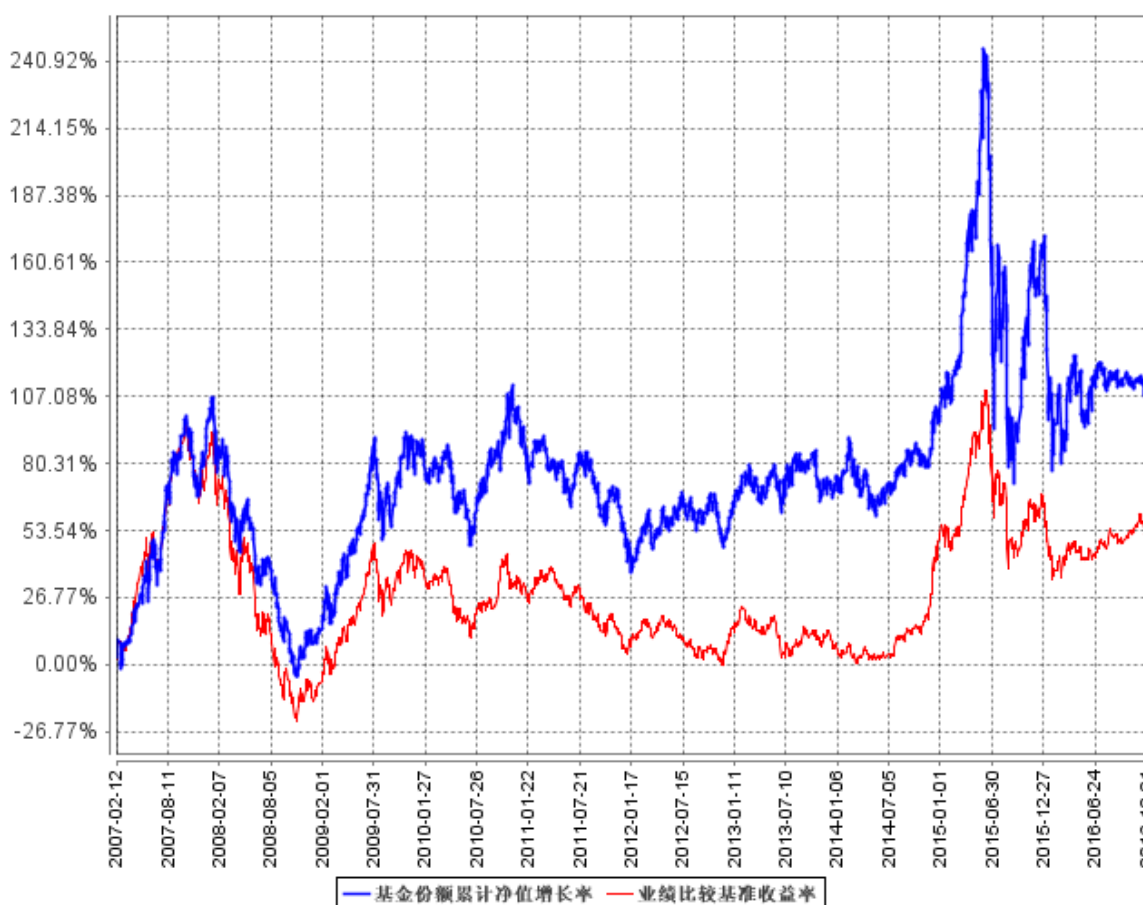
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.28%	0.51%	0.98%	0.54%	-4.26%	-0.03%
过去六个月	-4.34%	0.65%	3.89%	0.57%	-8.23%	0.08%
过去一年	-22.61%	1.98%	-7.69%	1.05%	-14.92%	0.93%
过去三年	18.75%	2.17%	38.81%	1.35%	-20.06%	0.82%
过去五年	37.86%	1.85%	41.21%	1.22%	-3.35%	0.63%
自开放式	106.69%	1.75%	51.57%	1.43%	55.12%	0.32%

基金合同生效起至今						
-----------	--	--	--	--	--	--

注：自基金合同生效至 2015 年 9 月 30 日本基金的业绩比较基准为： $75\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+25\% \times$  中信全债指数收益率；自 2015 年 10 月 1 日起本基金的业绩比较基准变更为： $75\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+25\% \times$  中证综合债指数收益率。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

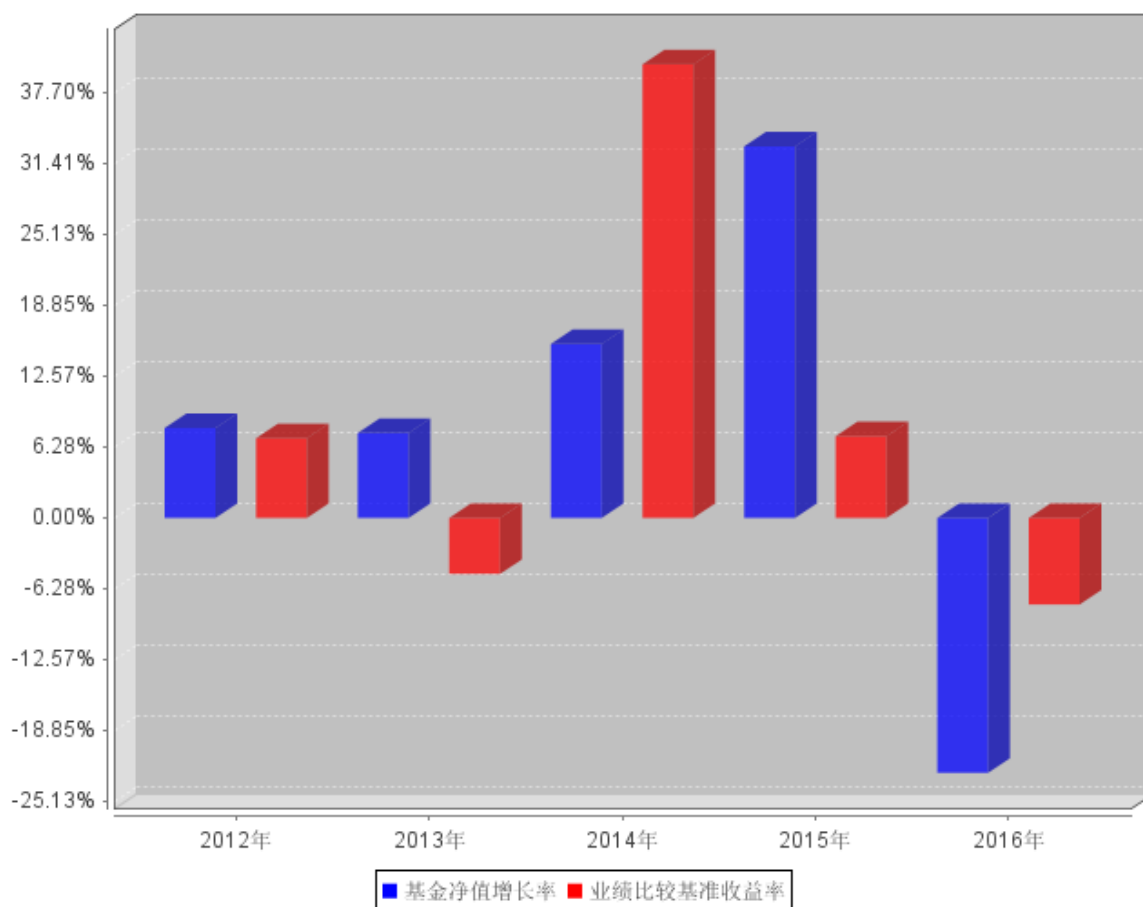


注：①本基金于 2007 年 2 月 12 日由封闭式基金基金久富转型而来。

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%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.0000	56,735,713.90	37,770,417.46	94,506,131.36	注：属2015年度利润2016年实施分配。
2015	0.5000	38,673,982.59	33,262,035.51	71,936,018.10	注：属2014年度利润2015年实施分配。
2014	0.8000	89,893,401.35	64,891,931.52	154,785,332.87	注：本年度共利润分配两次。其中：属2013年度利润2014年实施分配合计82,912,690.18元；属2014年度利润分配合

					计 71,872,642.69 元。
合计	2.3000	185,303,097.84	135,924,384.49	321,227,482.33	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（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股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（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。截至本报告期末，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：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券

投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、长城久泰和长城品牌的基金经理	2009年9月22日	2016年9月6日	16年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券股份有限公司投资银行部，2001年10月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”和“长城中小盘成长混合型证券投资基金”的基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。
何以广	长城中小盘、长城久富基金的基金经理	2016年9月6日	-	5年	男，中国籍，清华大学核工程与核技术学士、清华大学核科学与技术连读博士。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理助理、“长城优化升级混合型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）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。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资



基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年全年，市场先抑后扬。站在 2016 年年初来看，市场估值相对合理，但大部分行业的基本面平淡，因此市场指数难有大的向上行情。但市场在年初大跌之后，很多公司价值被低估。同时，在社会发展过程中，少量新的行业和优秀公司时有出现，投资这些市场还未完全反应的优秀新公司成为了本基金的重要投资方向。

在操作层面，2016 年本基金的行业配置较为中性，保持了 80%-90% 的仓位。投资风格方面，本基金主要配置了价值蓝筹和部分成长股，包括消银行、医药、白酒、电子、房地产等。由于基金配置节奏与市场行情错配，本基金在 2016 年的业绩表现一般。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为-22.61%，业绩比较基准收益率为-7.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，国际国内依然存在较大的变数。一是美联储可能继续加息，大宗商品价格大幅波动等因素将会对国际形势造成较大的影响。二是 2017 年中国经济依然疲软，在此背景下，国企改革方案是否能超预期、供给侧改革是否继续加码，都令我们充满期待和重点关注。不过，正面因素也在逐渐积累，包括 CPI 回落为货币市场宽松提供了基础条件，很多周期性行业的业绩呈现恢复性增长。以上因素将共同影响 2017 年的证券市场走势。

对于 2017 年的投资策略，本基金对大盘指数保持谨慎的态度。但我们认为一批优秀的、高成长、低估值公司将会走出独立行情。对于操作策略，本基金将会偏向成长风格。因此本基金在 2017 年将主要配置高成长、低估值的个股以及部分价值重估公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

### 3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内，于 2016 年 1 月 20 日进行了利润分配，共分配 94,506,131.36 元，是对 2015 年度利润进行的分配。本报告期末本基金可供分配利润为 54,776,465.61 元，本基金已于 2017 年 1 月 19 日进行了利润分配，共分配 26,087,664.34 元，尚未分配的可供分配利润，在符合分红条件的前提下，将按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

# § 5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2016 年度，基金托管人在长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）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。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2016 年度，长城基金管理有限公司在长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）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。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 94,506,131.36 元，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2016 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长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF) 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。

## § 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		57,169,289.72	7,640,610.46
结算备付金		173,688,777.78	106,984,776.98
存出保证金		818,463.90	872,221.12
交易性金融资产		717,143,330.74	1,262,851,943.61
其中：股票投资		717,143,330.74	1,262,851,943.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	39,397,050.92
应收利息		110,489.05	49,795.81
应收股利		-	-
应收申购款		11,148.56	18,074.70
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		948,941,499.75	1,417,814,473.60

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,868,599.24	-
应付赎回款		2,048,876.67	1,995,024.98
应付管理人报酬		1,200,118.88	1,747,782.86
应付托管费		200,019.83	291,297.16
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,830,247.39	2,945,706.62
应交税费		666,400.00	666,400.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		97,073.13	196,252.27
负债合计		22,911,335.14	7,842,463.89
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		871,253,699.00	941,277,604.02
未分配利润		54,776,465.61	468,694,405.69
所有者权益合计		926,030,164.61	1,409,972,009.71
负债和所有者权益总计		948,941,499.75	1,417,814,473.60

注：截至2016年12月31日，基金份额净值1.0629元，基金份额总额871,253,699.00份。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
<b>一、收入</b>		-272,384,967.27	599,158,939.83
1. 利息收入		2,918,812.86	2,157,312.82
其中：存款利息收入		2,646,462.45	2,122,052.98
债券利息收入		272,350.41	62.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	35,197.21
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-270,790,270.01	767,112,645.75
其中：股票投资收益		-276,531,427.01	757,818,026.81

基金投资收益		-	-
债券投资收益		194,623.65	315,777.37
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,546,533.35	8,978,841.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-4,573,844.06	-170,288,670.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		60,333.94	177,651.41
<b>减：二、费用</b>		37,232,928.82	49,592,687.91
1. 管理人报酬		15,059,630.83	23,170,596.38
2. 托管费		2,509,938.54	3,861,766.12
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		19,210,305.98	22,091,170.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		453,053.47	469,155.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-309,617,896.09	549,566,251.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-309,617,896.09	549,566,251.92

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	941,277,604.02	468,694,405.69	1,409,972,009.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-309,617,896.09	-309,617,896.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-70,023,905.02	-9,793,912.63	-79,817,817.65

其中：1. 基金申购款	104,959,482.69	6,805,497.36	111,764,980.05
2. 基金赎回款	-174,983,387.71	-16,599,409.99	-191,582,797.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-94,506,131.36	-94,506,131.36
五、期末所有者权益（基金净值）	871,253,699.00	54,776,465.61	926,030,164.61
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,479,389,453.11	258,503,164.99	1,737,892,618.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	549,566,251.92	549,566,251.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-538,111,849.09	-267,438,993.12	-805,550,842.21
其中：1. 基金申购款	100,481,306.34	30,783,021.85	131,264,328.19
2. 基金赎回款	-638,593,155.43	-298,222,014.97	-936,815,170.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-71,936,018.10	-71,936,018.10
五、期末所有者权益（基金净值）	941,277,604.02	468,694,405.69	1,409,972,009.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

何伟

基金管理人负责人

熊科金

主管会计工作负责人

彭洪波

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），原名为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。依据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）2007年2月1日证监基金字[2007]25号文《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，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，并更名为“长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)”。自2007年2月12日起，《长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》生效，原《久富证券投资基金基金合同》失效。根据上述证监基金字[2007]25号的核准，本基金自2007年3月5日至2007年3月6日公开集中申购，集中申购及利息总计人民币7,934,819,964.27元(已达到限量申购额)，折合基金份额7,934,819,964.27份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。

集中申购验资结束日同时为原久富证券投资基金的基金份额转换日。长城基金管理有限公司按照基金转换基准日（2007年3月9日）原久富证券投资基金的份额净值，对原久富证券投资基金进行了基金份额转换。经基金托管人确认，原久富证券投资基金的基金总份额由500,000,000.00份转换为1,140,424,000.00份。

根据2014年8月8日开始施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》以及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，长城基金管理有限公司决定自2015年8月3日起，将“长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF），”更名为“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括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。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。

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{沪深300指数收益率} + 25\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁



布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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。

#### 2. 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

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。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

## 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

交通银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
长城证券	4,849,394,185.10	38.64%	1,561,582,658.90	10.99%
东方证券	2,282,778,734.91	18.19%	89,278,812.56	0.63%

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
长城证券	59,716,800.00	98.64%	-	-
东方证券	-	-	-	-

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	4,516,237.50	38.64%	1,541,203.63	40.24%
东方证券	2,125,952.99	18.19%	856,853.39	22.37%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	1,437,878.41	11.05%	722,468.91	24.53%
东方证券	81,279.40	0.62%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和证券交易所买（卖）证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,059,630.83	23,170,596.38
其中：支付销售机构的客户维护费	2,474,153.23	3,710,742.20

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本期末本基金应付基金管理费为人民币 1,200,118.88 元。（2015 年 12 月 31 日：人民币 1,747,782.86 元）

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,509,938.54	3,861,766.12

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本期末本基金应付基金托管费为人民币 200,019.83 元。(2015 年 12 月 31 日：人民币 291,297.16 元)

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2007 年 2 月 12 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,702,120.00	5,702,120.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,702,120.00	5,702,120.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.6545%	0.6058%

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	57,169,289.72	144,645.75	7,640,610.46	80,360.30

注：本基金用于证券交易结算的资金已通过交通银行基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。本期末及上年度末的相关余额在资产负债表中的结算备付金科目中单独列示。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002821	凯莱英	2016 年 11 月 11 日	-	新股锁定	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	2016 年 11 月 18 日上市，本基金锁定 12 个月。
603823	百合花	2016 年 12 月 9 日	-	新股锁定	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	2016 年 12 月 20 日上市，本基金锁定 12 个月。
603660	苏州科达	2016 年 11 月 21 日	-	新股锁定	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	2016 年 12 月 1 日上市，本基金锁定 12 个月。
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-

	生物	月 29 日	月 6 日	上市						
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002509	天广中茂	2016年9月21日	重大事项停牌	12.53	-	-	2,590,357	29,089,626.44	32,457,173.21	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项停牌	18.27	2017年2月21日	18.35	1,600,000	33,421,490.04	29,232,000.00	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额为 0.00 元, 无质押债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元, 无质押债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 654,964,473.02 元, 划分为第二层次的余额为人民币 62,178,857.72 元, 无划分为第三层次余额。于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,086,269,006.27 元, 划分为第二层次的余额为人民币 176,582,937.34 元, 无划分为第三层次余额。

##### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具, 本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)



1	权益投资	717,143,330.74	75.57
	其中：股票	717,143,330.74	75.57
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	230,858,067.50	24.33
7	其他各项资产	940,101.51	0.10
8	合计	948,941,499.75	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	476,085,133.15	51.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	55,006,285.10	5.94
F	批发和零售业	43,615,121.88	4.71
G	交通运输、仓储和邮政业	26,050,408.24	2.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,218,145.56	1.32
J	金融业	45,409,780.00	4.90
K	房地产业	29,022,500.00	3.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,698,039.15	3.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	717,143,330.74	77.44
--	----	----------------	-------

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002509	天广中茂	2,590,357	32,457,173.21	3.50
2	000568	泸州老窖	949,989	31,349,637.00	3.39
3	002573	清新环境	1,699,945	29,698,039.15	3.21
4	002396	星网锐捷	1,600,000	29,232,000.00	3.16
5	601155	新城控股	2,470,000	29,022,500.00	3.13
6	000910	大亚圣象	1,499,878	28,647,669.80	3.09
7	002217	合力泰	1,599,956	28,639,212.40	3.09
8	600166	福田汽车	9,000,000	27,810,000.00	3.00
9	300156	神雾环保	1,099,842	27,507,048.42	2.97
10	002583	海能达	2,000,000	26,420,000.00	2.85

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)）的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000568	泸州老窖	77,616,665.83	5.50
2	002310	东方园林	68,803,425.52	4.88
3	002509	天广中茂	68,588,447.28	4.86
4	002245	澳洋顺昌	65,734,809.99	4.66
5	002456	欧菲光	65,132,083.03	4.62
6	601211	国泰君安	64,164,865.61	4.55
7	603866	桃李面包	63,019,562.19	4.47
8	300202	聚龙股份	60,172,167.73	4.27
9	300263	隆华节能	59,762,539.58	4.24
10	600303	曙光股份	56,740,496.49	4.02
11	000625	长安汽车	56,006,783.69	3.97
12	002142	宁波银行	55,480,822.18	3.93

13	002714	牧原股份	54,095,500.87	3.84
14	002221	东华能源	52,309,751.26	3.71
15	600068	葛洲坝	52,100,867.19	3.70
16	002206	海利得	51,137,979.72	3.63
17	002108	沧州明珠	50,118,495.11	3.55
18	600491	龙元建设	48,532,404.58	3.44
19	600498	烽火通信	48,280,619.91	3.42
20	000403	ST生化	48,266,461.80	3.42
21	600079	人福医药	48,224,442.52	3.42
22	600525	长园集团	46,541,481.71	3.30
23	000858	五粮液	46,424,816.08	3.29
24	600369	西南证券	45,262,307.89	3.21
25	600584	长电科技	44,048,086.70	3.12
26	600028	中国石化	43,887,704.52	3.11
27	300100	双林股份	43,807,428.50	3.11
28	000887	中鼎股份	43,093,433.48	3.06
29	600869	智慧能源	42,155,366.48	2.99
30	300014	亿纬锂能	41,686,606.93	2.96
31	002043	兔宝宝	41,074,761.52	2.91
32	300237	美晨科技	40,697,436.20	2.89
33	600395	盘江股份	39,269,003.92	2.79
34	600699	均胜电子	38,975,863.87	2.76
35	002247	帝龙文化	37,706,304.63	2.67
36	601009	南京银行	36,711,308.61	2.60
37	300156	神雾环保	36,572,545.71	2.59
38	002271	东方雨虹	36,446,001.26	2.58
39	002662	京威股份	35,794,437.35	2.54
40	002074	国轩高科	35,675,670.07	2.53
41	600891	秋林集团	35,331,987.12	2.51
42	002007	华兰生物	35,134,229.83	2.49
43	601818	光大银行	35,058,808.11	2.49
44	600104	上汽集团	35,054,989.45	2.49
45	002574	明牌珠宝	34,946,753.57	2.48
46	600392	盛和资源	34,713,324.26	2.46
47	600056	中国医药	34,000,746.36	2.41
48	002342	巨力索具	33,526,778.99	2.38

49	002396	星网锐捷	33,421,490.04	2.37
50	600664	哈药股份	32,902,713.11	2.33
51	300287	飞利信	32,730,661.92	2.32
52	000400	许继电气	32,677,959.59	2.32
53	300221	银禧科技	31,883,155.25	2.26
54	601669	中国电建	31,643,217.04	2.24
55	002671	龙泉股份	31,462,068.80	2.23
56	600095	哈高科	31,165,635.60	2.21
57	002157	正邦科技	31,023,592.54	2.20
58	002155	湖南黄金	30,688,388.42	2.18
59	601155	新城控股	29,825,465.07	2.12
60	000983	西山煤电	29,558,811.76	2.10
61	600166	福田汽车	29,470,943.54	2.09
62	002583	海能达	29,416,282.83	2.09
63	601166	兴业银行	29,328,800.94	2.08
64	002573	清新环境	29,155,036.54	2.07
65	000952	广济药业	28,996,992.24	2.06

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002456	欧菲光	88,939,511.16	6.31
2	600303	曙光股份	85,284,089.71	6.05
3	002245	澳洋顺昌	70,109,043.42	4.97
4	002310	东方园林	64,734,296.74	4.59
5	300263	隆华节能	57,217,577.36	4.06
6	000625	长安汽车	56,851,803.73	4.03
7	002206	海利得	55,512,970.91	3.94
8	300202	聚龙股份	53,923,686.35	3.82
9	601211	国泰君安	53,865,289.20	3.82
10	300014	亿纬锂能	53,543,535.83	3.80
11	002108	沧州明珠	52,686,442.12	3.74
12	002714	牧原股份	51,451,732.00	3.65
13	000568	泸州老窖	50,402,021.10	3.57
14	002450	康得新	49,526,427.98	3.51

15	600699	均胜电子	49,071,043.23	3.48
16	000887	中鼎股份	48,110,143.46	3.41
17	600079	人福医药	47,996,629.55	3.40
18	000858	五粮液	47,576,008.98	3.37
19	600491	龙元建设	46,362,218.54	3.29
20	600498	烽火通信	46,222,427.73	3.28
21	600369	西南证券	45,107,375.06	3.20
22	000673	当代东方	44,028,723.73	3.12
23	002509	天广中茂	44,019,838.05	3.12
24	002247	帝龙文化	44,012,755.55	3.12
25	300198	纳川股份	43,902,997.49	3.11
26	002043	兔宝宝	43,733,480.76	3.10
27	600028	中国石化	42,955,000.00	3.05
28	600525	长园集团	42,077,542.89	2.98
29	002271	东方雨虹	41,977,431.48	2.98
30	300100	双林股份	41,856,012.84	2.97
31	300113	顺网科技	41,172,518.64	2.92
32	600869	智慧能源	41,088,736.92	2.91
33	600395	盘江股份	41,060,467.58	2.91
34	603008	喜临门	40,864,564.52	2.90
35	603866	桃李面包	39,219,474.98	2.78
36	002142	宁波银行	38,935,561.66	2.76
37	600068	葛洲坝	38,679,952.06	2.74
38	002074	国轩高科	37,996,475.00	2.69
39	601009	南京银行	37,537,798.01	2.66
40	300237	美晨科技	37,413,376.70	2.65
41	000926	福星股份	37,133,878.99	2.63
42	002221	东华能源	36,498,301.43	2.59
43	600891	秋林集团	36,017,684.50	2.55
44	300200	高盟新材	35,636,764.08	2.53
45	002157	正邦科技	34,429,559.50	2.44
46	601818	光大银行	34,349,583.23	2.44
47	002574	明牌珠宝	34,032,252.44	2.41
48	600104	上汽集团	33,893,579.35	2.40
49	600056	中国医药	32,870,400.24	2.33
50	002007	华兰生物	32,792,190.14	2.33
51	300221	银禧科技	32,268,868.91	2.29
52	600562	国睿科技	32,008,293.94	2.27

53	601669	中国电建	31,924,026.00	2.26
54	000793	华闻传媒	31,918,963.62	2.26
55	002671	龙泉股份	31,911,815.56	2.26
56	600392	盛和资源	31,791,885.00	2.25
57	601877	正泰电器	31,695,537.00	2.25
58	002155	湖南黄金	31,678,568.18	2.25
59	600095	哈高科	31,179,046.33	2.21
60	000952	广济药业	30,411,307.38	2.16
61	002185	华天科技	30,240,950.60	2.14
62	300031	宝通科技	29,840,953.45	2.12
63	600487	亨通光电	29,592,936.00	2.10
64	002662	京威股份	29,515,900.57	2.09
65	000403	ST 生化	29,269,697.38	2.08
66	000909	数源科技	29,152,362.89	2.07
67	000983	西山煤电	28,820,553.00	2.04
68	300073	当升科技	28,284,926.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,145,838,364.60
卖出股票收入（成交）总额	6,410,441,706.40

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货，本期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	818,463.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	110,489.05
5	应收申购款	11,148.56

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	940,101.51

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002509	天广中茂	32,457,173.21	3.50	重大事项停牌
2	002396	星网锐捷	29,232,000.00	3.16	重大事项停牌

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
28,879	30,169.11	152,538,419.63	17.51%	718,715,279.37	82.49%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长城基金管理有限公司	5,702,120.00	10.33%
2	朱爱萍	1,959,039.00	3.55%
3	王艳红	1,000,000.00	1.81%
4	曾长耀	1,000,000.00	1.81%
5	高捷	642,675.00	1.16%
6	郭旭	586,054.00	1.06%



7	贾红革	550,000.00	1.00%
8	迟安功	320,417.00	0.58%
9	杜秋娥	253,551.00	0.46%
10	杨晓慧	242,213.00	0.44%

注：①以基金账户为统计口径；

②持有人为场内持有人，占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例  
×100%；

③以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	190,659.95	0.0219%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年2月12日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	941,277,604.02
本报告期基金总申购份额	104,959,482.69
减:本报告期基金总赎回份额	174,983,387.71
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	871,253,699.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

自 2016 年 2 月 1 日起，卢盛春先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2016 年 4 月 6 日起，谢志华先生不再担任公司独立董事，由徐英女士担任该职。

自 2016 年 5 月 20 日起，刘杉同志不再担任公司独立董事，由万建华同志担任该职。

自 2016 年 7 月 1 日起，杨光裕先生不再担任公司董事长及董事，由何伟先生担任公司董事长。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币玖万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务捌年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	2	4,849,394,185.10	38.64%	4,516,237.50	38.64%	-
东方证券	2	2,282,778,734.91	18.19%	2,125,952.99	18.19%	-
广发证券	1	1,555,467,711.79	12.40%	1,448,612.56	12.40%	-
中信建投	1	1,131,682,205.88	9.02%	1,053,933.73	9.02%	-
中银国际	1	1,073,924,472.77	8.56%	1,000,142.21	8.56%	-
银河证券	1	1,070,420,836.76	8.53%	996,884.44	8.53%	-
安信证券	1	364,756,585.22	2.91%	339,697.59	2.91%	-
申万宏源	1	135,250,327.36	1.08%	125,958.10	1.08%	-
国泰君安	1	85,012,928.02	0.68%	79,172.14	0.68%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 12 个交易单元。

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	59,716,800.00	98.64%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	821,650.98	1.36%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-