

长城安心回报混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国农业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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50
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.....	50

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	50
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	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
8.12 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
9.3 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	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	53
11.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
11.8 其他重大事件	56
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城安心回报混合型证券投资基金
基金简称	长城安心回报混合
基金主代码	200007
交易代码	200007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 8 月 22 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,443,059,070.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率 2 倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。
投资策略	分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用“注重收益、关注成长、精选个股”的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。
业绩比较基准	银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍
风险收益特征	本基金是绝对回报产品，其预期收益与风险低于股票型基金，高于债券基金与货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	林葛
	联系电话	0755-23982338	010-66060069
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95599
传真		0755-23982328	010-68121816
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	518026	100031
法定代表人	何伟	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	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	408,244,650.35	2,327,162,147.15	250,917,600.99
本期利润	-246,796,131.28	2,235,144,364.61	513,811,544.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0951	0.5186	0.0528
本期加权平均净值利润率	-10.05%	54.71%	7.27%
本期基金份额净值增长率	-9.31%	39.50%	7.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	1,280,199,077.29	1,482,936,607.49	228,017,566.95
期末可供分配基金份额利润	0.5240	0.5798	0.0301
期末基金资产净值	2,365,413,589.19	2,730,451,116.01	5,795,025,512.41
期末基金份额净值	0.9682	1.0676	0.7653
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	183.01%	212.06%	123.70%

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 “期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	-0.91%	0.60%	0.76%	0.01%	-1.67%	0.59%
过去六个月	3.34%	0.63%	1.52%	0.01%	1.82%	0.62%
过去一年	-9.31%	1.36%	3.05%	0.01%	-12.36%	1.35%
过去三年	36.00%	1.62%	14.09%	0.01%	21.91%	1.61%
过去五年	58.57%	1.38%	29.27%	0.02%	29.30%	1.36%
自基金合同生效起至今	183.01%	1.51%	77.61%	0.02%	105.40%	1.49%

3.2.2 自基金合同生效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

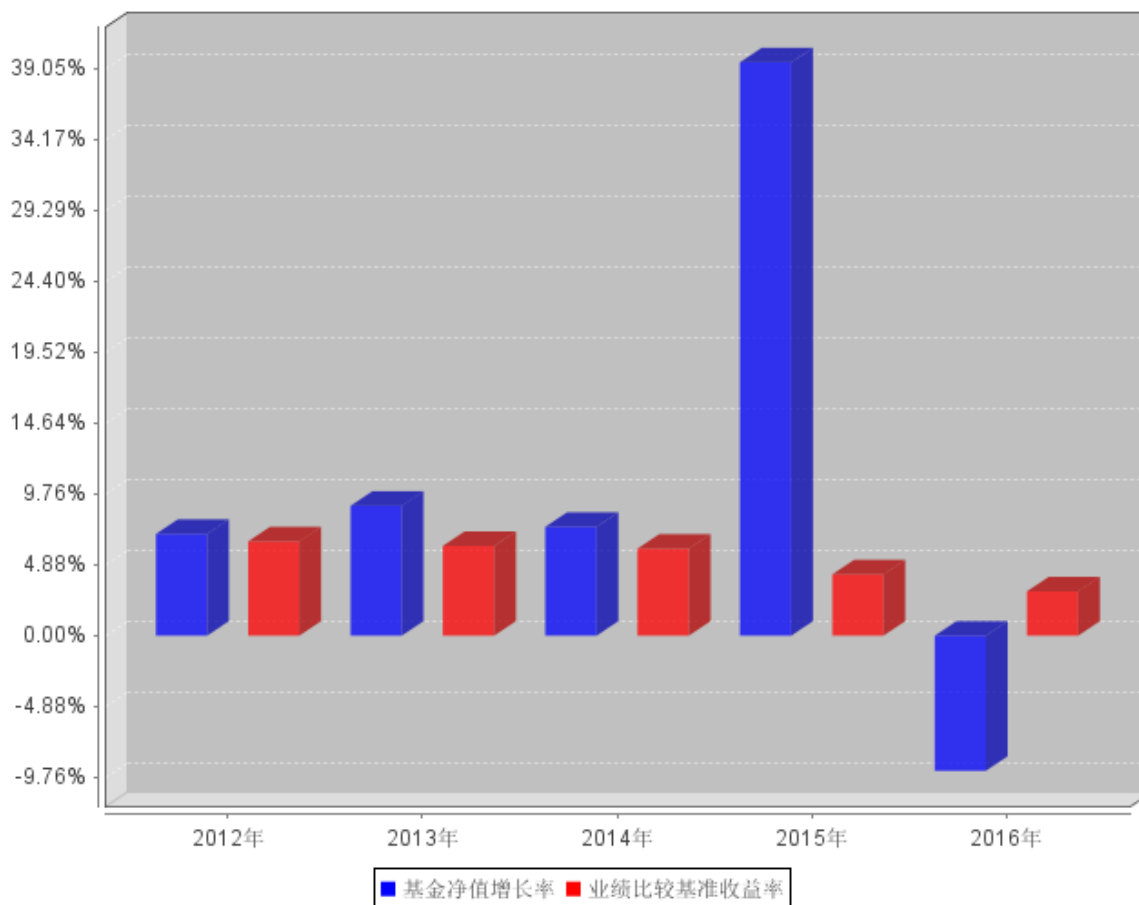
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金投资组合为：股票投资比例为基金净资产的 10%—85%；权证投资比例为基金净资产的 0%—3%；债券投资比例为基金净资产的 10%—85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的 5%以上。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

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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		
吴文庆	公司研究部总经理、长城久恒、长城双动力、长城安心回报、长城新兴产业、长城改革红利基金的基金经理	2016 年 1 月 18 日	-	7 年	男，中国籍，上海交通大学生物医学工程博士。2010 年进入长城基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理，“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理，“长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

徐九龙	专户投资 总监	2009年1月6 日	2016年1月18日	14年	男，中国籍，兰州大学理学学士、中山大学理学硕士。曾就职深圳市沙头角保税区管理局、深圳市经济贸易局。2002年3月进入长城基金管理有限公司，曾任基金管理部研究员，长城久富核心成长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、长城安心回报混合型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
-----	------------	---------------	------------	-----	---

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。

③自 2017 年 3 月 16 日起，吴文庆先生不再担任长城安心回报混合型证券投资基金的基金经理，由何以广先生担任该基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城安心回报混合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。

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

去年从股票市场熔断开始，到年底债券风波以及对险资举牌的控制，市场基本上处于底部震荡的态势。16 年全年市场波折较多，上半年新能源汽车板块一枝独秀，其余板块不温不火，下半年供给侧改革、PPP、大盘蓝筹等股票表现较好，但在年底对险资举牌控制后，这些个股也回落较大。

17 年我们仍然会在季度中对热点的板块和个股进行了一定程度的波段操作。我们将继续细心甄别风险，选择未来几个季度业绩增长确定，具备长期空间的行业和公司作为本基金投资的重点，争取为持有人做出更好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金业绩在同类可比的基金中排名位于中等水平。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度来看，该季度是上市公司年报和季报期，这个季度是对过去一年的上市公司业绩的验证期，这个季度上市公司的好与坏将迎来统一的验证。对于操作来说，目前国内 IPO 的速度维持快速发行的节奏，国外美国新总统上任，外部环境进一步不确定，加上国内经济下行的压力，市场仍然处于震荡盘整态势。

目前市场的格局在没有新增资金入市的情况下，指数维持窄幅震荡的板块轮动行情。由于在窄幅震荡的行情中，结构要优于仓位，保持中性仓位的运作，不让过高的仓位暴露风险。

在投资思路方面，我们对于热点板块和个股仍然会考虑去做波段，但主要的个股和持仓仍然会集中在新能源、节能环保、自动化、互联网、配网、高铁、移动支付、医药、食品安全、国企改革、国防安全、信息安全等符合国家政策和持续投入的行业。我们会在这些板块自下而上的仔细甄别个股，选择有核心技术、管理层过硬、产品壁垒高、市场空间大的公司进行集中配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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，实时监察关键业务风险点，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，保障基金份额持有人的利益，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。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，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。

4.7 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、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，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。

4.9 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

在托管长城安心回报混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》、《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》的约定，对长城安心回报混合型证券投资基金管理人——长城基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司在长城安心回报混合型证券投资基金的投资运作、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，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长城安心回报混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第 60737541_H06 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	长城安心回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的长城安心回报混合型证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长城基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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。</p> <p>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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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基金管理人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。</p> <p>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。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城安心回报混合型证券投资基金 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。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	266,257,000.60	118,652,521.63
结算备付金		6,060,954.56	3,001,775.80
存出保证金		1,292,069.12	1,779,378.51
交易性金融资产	7.4.7.2	2,067,354,102.09	2,283,995,788.17
其中：股票投资		1,794,462,102.09	1,917,967,788.17
基金投资		-	-
债券投资		272,892,000.00	366,028,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	300,001,000.00
应收证券清算款		28,691,433.27	32,195,884.42
应收利息	7.4.7.5	3,915,490.73	5,331,443.30
应收股利		-	-
应收申购款		295.57	21,166.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,373,571,345.94	2,744,978,957.99
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
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,182,054.27	7,260,038.19
应付管理人报酬		3,047,847.10	3,507,914.03
应付托管费		507,974.52	584,652.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,354,182.90	1,988,673.59
应交税费		206,630.13	206,630.13
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	859,067.83	979,933.68
负债合计		8,157,756.75	14,527,841.98
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	1,085,214,511.90	1,136,097,566.91
未分配利润	7.4.7.10	1,280,199,077.29	1,594,353,549.10
所有者权益合计		2,365,413,589.19	2,730,451,116.01
负债和所有者权益总计		2,373,571,345.94	2,744,978,957.99

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.9682 元，基金份额总额 2,443,059,070.38 份。

7.2 利润表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

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
一、收入		-189,220,334.86	2,328,727,518.12
1. 利息收入		12,948,994.70	22,233,703.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,669,714.94	2,142,730.69
债券利息收入		9,387,561.44	18,619,164.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		891,718.32	1,471,808.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		452,586,384.21	2,398,132,021.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	438,610,479.67	2,367,094,917.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-455,288.35	7,728,359.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	14,431,192.89	23,308,744.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-655,040,781.63	-92,017,782.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	285,067.86	379,575.33
减：二、费用		57,575,796.42	93,583,153.51
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	36,806,413.49	61,537,785.04
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,134,402.25	10,256,297.49
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	14,154,915.29	20,826,309.90
5. 利息支出		-	428,603.71
其中：卖出回购金融资产支出		-	428,603.71
6. 其他费用	7.4.7.20	480,065.39	534,157.37

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-246,796,131.28	2,235,144,364.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-246,796,131.28	2,235,144,364.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

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）	1,136,097,566.91	1,594,353,549.10	2,730,451,116.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-246,796,131.28	-246,796,131.28
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）	-50,883,055.01	-67,358,340.53	-118,241,395.54
其中：1. 基金申购款	150,327,512.51	174,078,899.37	324,406,411.88
2. 基金赎回款	-201,210,567.52	-241,437,239.90	-442,647,807.42
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,085,214,511.90	1,280,199,077.29	2,365,413,589.19
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）	3,363,583,254.91	2,431,442,257.50	5,795,025,512.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,235,144,364.61	2,235,144,364.61

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)	-2,227,485,688.00	-3,072,233,073.01	-5,299,718,761.01
其中：1. 基金申购款	50,212,765.46	63,510,258.70	113,723,024.16
2. 基金赎回款	-2,277,698,453.46	-3,135,743,331.71	-5,413,441,785.17
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,136,097,566.91	1,594,353,549.10	2,730,451,116.01

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 熊科金 彭洪波
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城安心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（中国证监会）“证监基金字[2006]123号”《关于同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的批复》核准，基金合同于2006年8月22日生效的契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集规模为1,416,548,067.74份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

于2007年9月5日（基金拆分基准日），本基金管理人长城基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币2.2512元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第9位为人民币2.251230974元。本基金管理人于拆分日，按照1:2.251230974的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币1.0000元，基金份额面值为人民币0.4442元。

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。本基金的业绩比较基准为：银行一年期定期存款（税前）利率的2倍。

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

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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“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)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 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应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并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入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交

易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；

(3) 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；

(4) 本基金收益每年最多分配 12 次，年度收益分配比例不低于基金可分配收益的 60%；

(5) 本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申请的约定转为基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	266,257,000.60	118,652,521.63
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-

合计:	266,257,000.60	118,652,521.63
-----	----------------	----------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,838,356,999.76	1,794,462,102.09	-43,894,897.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	99,947,400.00	99,870,000.00
	银行间市场	170,734,161.86	173,022,000.00
	合计	270,681,561.86	272,892,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,109,038,561.62	2,067,354,102.09	-41,684,459.53
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,310,050,154.21	1,917,967,788.17	607,917,633.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	49,975,000.00	50,015,000.00
	银行间市场	310,614,311.86	316,013,000.00
	合计	360,589,311.86	366,028,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,670,639,466.07	2,283,995,788.17	613,356,322.10

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	300,001,000.00	-
合计	300,001,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	49,919.63	69,294.99
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,000.25	1,485.88
应收债券利息	3,861,931.20	5,197,739.85
应收买入返售证券利息	-	62,041.81
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	639.65	880.77
合计	3,915,490.73	5,331,443.30

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,345,667.58	1,977,403.33
银行间市场应付交易费用	8,515.32	11,270.26
合计	2,354,182.90	1,988,673.59

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	67.83	872.48
预提审计费	100,000.00	120,000.00
预提信息披露费	-	100,000.00
预提银行间账户维护费	4,500.00	4,561.20
预提上清所债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	859,067.83	979,933.68

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,557,626,342.96	1,136,097,566.91
本期申购	338,412,387.13	150,327,512.51
本期赎回(以“-”号填列)	-452,979,659.71	-201,210,567.52
本期末	2,443,059,070.38	1,085,214,511.90

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,482,936,607.49	111,416,941.61	1,594,353,549.10
本期利润	408,244,650.35	-655,040,781.63	-246,796,131.28
本期基金份额交易产生的变动数	-95,215,471.19	27,857,130.66	-67,358,340.53
其中：基金申购款	210,452,789.95	-36,373,890.58	174,078,899.37
基金赎回款	-305,668,261.14	64,231,021.24	-241,437,239.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,795,965,786.65	-515,766,709.36	1,280,199,077.29

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31

	31 日	日
活期存款利息收入	1,724,188.96	2,057,962.26
定期存款利息收入	864,166.67	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	61,405.54	61,677.94
其他	19,953.77	23,090.49
合计	2,669,714.94	2,142,730.69

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

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
卖出股票成交总额	4,627,505,517.55	8,590,143,867.61
减：卖出股票成本总额	4,188,895,037.88	6,223,048,950.06
买卖股票差价收入	438,610,479.67	2,367,094,917.55

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	385,319,944.19	1,241,034,978.76
减：卖出债券（债转股及债券到期 兑付）成本总额	379,621,235.48	1,213,967,526.64
减：应收利息总额	6,153,997.06	19,339,092.30
买卖债券差价收入	-455,288.35	7,728,359.82

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生资产支持证券投资收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生衍生工具收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

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
股票投资产生的股利收益	14,431,192.89	23,308,744.13
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,431,192.89	23,308,744.13

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-655,040,781.63	-92,017,782.54
——股票投资	-651,812,531.63	-94,076,772.46
——债券投资	-3,228,250.00	2,058,989.92
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-655,040,781.63	-92,017,782.54

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

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
基金赎回费收入	284,527.14	98,157.11
转换基金补偿收入	540.72	281,418.22
合计	285,067.86	379,575.33

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	14,148,555.41	20,813,684.90
银行间市场交易费用	6,359.88	12,625.00
合计	14,154,915.29	20,826,309.90

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

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
审计费用	100,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行间债券帐户维护费	35,938.80	36,000.00
银行汇划费用	42,726.59	68,595.25
其他	1,200.00	-
银行小额账户维护费	200.00	9,562.12
合计	480,065.39	534,157.37

注：其他为上清所查询服务费。

7.4.7.21 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	358,342,599.64	3.84%	695,059,308.07	5.78%
东方证券	-	-	142,748,827.49	1.19%

7.4.10.1.2 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	200,294,972.61	95.24%	111,616,364.38	38.52%

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期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。

7.4.10.1.5 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	333,725.86	3.84%	301,875.24	12.87%

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	632,782.47	5.74%	-	-
东方证券	129,958.18	1.18%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	36,806,413.49	61,537,785.04
其中：支付销售机构的客户维护费	7,553,383.16	12,840,346.55

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 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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) 本期末本基金未支付的管理费余额人民币 3,047,847.10 元。(2015 年 12 月 31 日，人民币 3,507,914.03 元)

7.4.10.2.2 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	6,134,402.25	10,256,297.49

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) 本期末本基金未支付的托管费余额人民币 507,974.52 元。(2015 年 12 月 31 日, 人民币 584,652.36 元)

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注: 本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金, 于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.4.2 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: 除基金管理人之外的, 本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.5 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
中国农业银行	266,257,000.60	1,724,188.96	118,652,521.63	2,057,962.26

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管, 按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

注: 本基金于本年度未进行利润分配。

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

7.4.12.1 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	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注	

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	额	
002821	凯莱英	2016年 11月11 日	2017年 11月 20日	新股锁 定	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
603823	百合花	2016年 12月9日	2017年 12月 20日	新股锁 定	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
603660	苏州科达	2016年 11月21 日	2017年 12月1 日	新股锁 定	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	-
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	赛托生物	2016年 12月29 日	2017年 1月6 日	新股未 上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
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	-

7.4.12.2 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	-	-	7,999,895	93,151,176.18	100,238,684.35	-
600797	浙大网新	2016年10月27日	重大事项停牌	18.00	2017年1月6日	17.95	2,000,000	33,468,421.86	36,000,000.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 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人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。

7.4.13.2 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股票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发行的证券，不得超过该证券市值的 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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，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可回购交易的债券资产的公允价值。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人员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。

7.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。本基金的生息

资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5 年 以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	266,257,000.60	-	-	-	-	-	266,257,000.60
结算备付金	6,060,954.56	-	-	-	-	-	6,060,954.56
存出保证金	1,292,069.12	-	-	-	-	-	1,292,069.12
交易性金融资产	-	-	-99,870,000.00	173,022,000.00	-	-1,794,462,102.09	2,067,354,102.09
应收证券清算款	-	-	-	-	-	28,691,433.27	28,691,433.27
应收利息	-	-	-	-	-	3,915,490.73	3,915,490.73
应收申购款	-	-	-	-	-	295.57	295.57
资产总计	273,610,024.28	-	-99,870,000.00	173,022,000.00	-	-1,827,069,321.66	2,373,571,345.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,182,054.27	1,182,054.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,047,847.10	3,047,847.10
应付托管费	-	-	-	-	-	507,974.52	507,974.52
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,354,182.90	2,354,182.90
应交税费	-	-	-	-	-	206,630.13	206,630.13

其他负债	-	-	-	-	-	859,067.83	859,067.83
负债总计	-	-	-	-	-	8,157,756.75	8,157,756.75
利率敏感度缺口	273,610,024.28	-	-99,870,000.00	173,022,000.00	-	-	-
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	118,652,521.63	-	-	-	-	-	118,652,521.63
结算备付金	3,001,775.80	-	-	-	-	-	3,001,775.80
存出保证金	1,779,378.51	-	-	-	-	-	1,779,378.51
交易性金融资产	200,825,000.00	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-	-1,917,967,788.17	2,283,995,788.17
买入返售金融资产	300,001,000.00	-	-	-	-	-	300,001,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	32,195,884.42	32,195,884.42
应收利息	-	-	-	-	-	5,331,443.30	5,331,443.30
应收申购款	-	-	-	-	-	21,166.16	21,166.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	624,259,675.94	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-	-1,955,516,282.05	2,744,978,957.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,260,038.19	7,260,038.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,507,914.03	3,507,914.03
应付托管费	-	-	-	-	-	584,652.36	584,652.36

应付交易费用	-	-	-	-	-	1,988,673.59	1,988,673.59
应交税费	-	-	-	-	-	206,630.13	206,630.13
其他负债	-	-	-	-	-	979,933.68	979,933.68
负债总计	-	-	-	-	-	14,527,841.98	14,527,841.98
利率敏感度缺口	624,259,675.94	48,965,000.00	59,898,000.00	56,340,000.00	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	利率上升25个基点	-77,622.27	-2,004,781.11
	利率下降25个基点	78,647.93	2,030,128.55

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的最大其他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其他价格风险，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 10%-85%，权证投资 0%-3%，债券 10%-85%，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。于本报告期末及上年度末，

本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,794,462,102.09	75.86	1,917,967,788.17	70.24
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	272,892,000.00	11.54	366,028,000.00	13.41
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,067,354,102.09	87.40	2,283,995,788.17	83.65

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	118,101,608.57	66,169,888.69
沪深 300 指数下降 5%	-118,101,608.57	-66,169,888.69	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析，上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 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 1,657,733,733.23 元, 划分为第二层次的余额为人民币 409,620,368.86 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 1,865,371,729.79 元, 划分为第二层次的余额为人民币 418,624,058.38 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, 本基金本报告期末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	1,794,462,102.09	75.60
	其中: 股票	1,794,462,102.09	75.60
2	固定收益投资	272,892,000.00	11.50
	其中: 债券	272,892,000.00	11.50
	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	272,317,955.16	11.47
7	其他各项资产	33,899,288.69	1.43
8	合计	2,373,571,345.94	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	46,558,626.48	1.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,135,285,921.99	48.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	83,285,592.23	3.52
F	批发和零售业	243,022,500.00	10.27
G	交通运输、仓储和邮政业	39,512,519.48	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	84,058,442.72	3.55
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	93,328,461.22	3.95
L	租赁和商务服务业	53,176,000.00	2.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,089,340.31	0.68
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	1,794,462,102.09	75.86

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000963	华东医药	2,150,000	154,950,500.00	6.55
2	600146	商赢环球	3,319,928	112,379,562.80	4.75
3	002509	天广中茂	7,999,895	100,238,684.35	4.24
4	002323	雅百特	5,500,000	83,270,000.00	3.52

5	300234	开尔新材	2,502,535	75,126,100.70	3.18
6	300147	香雪制药	5,599,804	72,237,471.60	3.05
7	002303	美盈森	6,500,085	66,820,873.80	2.82
8	002359	齐星铁塔	2,299,891	65,707,885.87	2.78
9	000534	万泽股份	3,999,906	65,478,461.22	2.77
10	000566	海南海药	4,700,000	59,737,000.00	2.53
11	002658	雪迪龙	3,315,520	57,026,944.00	2.41
12	600525	长园集团	4,000,000	55,800,000.00	2.36
13	300269	联建光电	2,300,000	53,176,000.00	2.25
14	600829	人民同泰	3,400,000	51,952,000.00	2.20
15	000403	ST生化	1,499,981	49,214,376.61	2.08
16	300166	东方国信	2,299,988	47,816,750.52	2.02
17	002714	牧原股份	1,999,941	46,558,626.48	1.97
18	300090	盛运环保	4,000,000	46,400,000.00	1.96
19	002574	明牌珠宝	4,000,000	46,280,000.00	1.96
20	000587	金洲慈航	3,059,946	45,531,996.48	1.92
21	600847	万里股份	1,699,862	45,046,343.00	1.90
22	300038	梅泰诺	949,926	41,549,763.24	1.76
23	300319	麦捷科技	1,000,000	39,290,000.00	1.66
24	600511	国药股份	1,200,000	36,120,000.00	1.53
25	600797	浙大网新	2,000,000	36,000,000.00	1.52
26	300122	智飞生物	2,000,000	32,940,000.00	1.39
27	002294	信立泰	1,000,000	29,240,000.00	1.24
28	000671	阳光城	5,000,000	27,850,000.00	1.18
29	300181	佐力药业	3,000,000	27,390,000.00	1.16
30	002672	东江环保	1,521,078	26,770,972.80	1.13
31	600270	外运发展	1,500,000	24,810,000.00	1.05
32	300281	金明精机	1,299,985	23,464,729.25	0.99
33	300190	维尔利	999,959	16,089,340.31	0.68
34	601021	春秋航空	399,920	14,693,060.80	0.62
35	300263	隆华节能	1,499,887	11,054,167.19	0.47
36	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.13
37	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.05
38	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.04
39	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
40	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
41	603737	三棵树	1,327	96,897.54	0.00
42	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
43	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00

44	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
45	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
46	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
47	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
48	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
49	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
50	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
51	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
52	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
53	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
54	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
55	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
56	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
57	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
58	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
59	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
60	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
61	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
62	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
63	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
64	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
65	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
66	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	002638	勤上光电	123,439,307.14	4.52
2	600525	长园集团	118,096,580.59	4.33
3	002714	牧原股份	116,966,886.32	4.28
4	600146	商赢环球	111,122,678.34	4.07
5	300307	慈星股份	96,528,618.99	3.54
6	300147	香雪制药	93,574,850.40	3.43
7	002509	天广中茂	93,151,176.18	3.41
8	002303	美盈森	88,487,683.45	3.24

9	300269	联建光电	88,059,131.96	3.23
10	002323	雅百特	83,148,798.57	3.05
11	000090	天健集团	78,557,509.33	2.88
12	300017	网宿科技	74,895,312.11	2.74
13	002368	太极股份	74,428,362.81	2.73
14	002727	一心堂	73,615,926.76	2.70
15	300234	开尔新材	73,572,045.64	2.69
16	600271	航天信息	72,377,669.64	2.65
17	601777	力帆股份	70,149,529.08	2.57
18	600333	长春燃气	68,398,776.61	2.51
19	002359	齐星铁塔	66,863,662.51	2.45
20	000534	万泽股份	66,590,732.26	2.44
21	002574	明牌珠宝	66,321,502.00	2.43
22	000566	海南海药	66,189,378.10	2.42
23	000661	长春高新	65,432,978.98	2.40
24	300122	智飞生物	64,064,746.93	2.35
25	002658	雪迪龙	61,840,553.18	2.26
26	000625	长安汽车	61,424,459.92	2.25
27	300199	翰宇药业	58,761,613.56	2.15
28	002310	东方园林	58,706,741.49	2.15
29	000403	ST 生化	55,315,480.54	2.03
30	300166	东方国信	55,253,486.27	2.02

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	000513	丽珠集团	159,851,533.65	5.85
2	000661	长春高新	158,703,452.73	5.81
3	600079	人福医药	134,483,721.96	4.93
4	002638	勤上光电	132,973,471.58	4.87
5	600276	恒瑞医药	127,342,117.43	4.66
6	300017	网宿科技	110,598,923.56	4.05
7	002727	一心堂	87,012,327.75	3.19
8	002294	信立泰	85,162,932.33	3.12
9	000090	天健集团	84,511,994.40	3.10

10	002368	太极股份	82,404,491.18	3.02
11	000639	西王食品	75,731,781.12	2.77
12	601313	江南嘉捷	73,298,315.57	2.68
13	002714	牧原股份	72,910,334.01	2.67
14	300307	慈星股份	72,415,198.78	2.65
15	600271	航天信息	68,313,004.89	2.50
16	002310	东方园林	68,168,877.36	2.50
17	000625	长安汽车	63,427,328.42	2.32
18	600525	长园集团	63,405,862.00	2.32
19	300199	翰宇药业	62,901,078.23	2.30
20	601777	力帆股份	61,634,490.11	2.26
21	603008	喜临门	57,154,732.81	2.09
22	300026	红日药业	55,237,530.50	2.02
23	601886	江河集团	54,791,629.61	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	4,717,201,883.43
卖出股票收入（成交）总额	4,627,505,517.55

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	99,870,000.00	4.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,497,000.00	5.01
	其中：政策性金融债	118,497,000.00	5.01
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	54,525,000.00	2.31
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	272,892,000.00	11.54

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019539	16 国债 11	1,000,000	99,870,000.00	4.22
2	130234	13 国开 34	700,000	69,342,000.00	2.93
3	1382138	13 甘公投 MTN1	500,000	54,525,000.00	2.31
4	110237	11 国开 37	500,000	49,155,000.00	2.08
5	-	-	-	-	-

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，本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

基金投资的前十名证券的发行主体本期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	1,292,069.12
2	应收证券清算款	28,691,433.27
3	应收股利	-
4	应收利息	3,915,490.73
5	应收申购款	295.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,899,288.69

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	100,238,684.35	4.24	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
162, 937	14, 993. 89	108, 779, 669. 38	4. 45%	2, 334, 279, 401. 00	95. 55%

9.2 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	3, 673. 92	0. 0002%

9.3 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	0
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 (2006 年 8 月 22 日) 基金份额总额	1, 416, 548, 067. 74
本报告期期初基金份额总额	2, 557, 626, 342. 96
本报告期基金总申购份额	338, 412, 387. 13
减:本报告期基金总赎回份额	452, 979, 659. 71
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以 "-" 填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2, 443, 059, 070. 38

§ 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，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

本基金本报告期内投资策略无改变。

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拾万元。

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八年。

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、基金托管人涉及托管业务机构及其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	
西南证券	1	2,795,136,053.20	29.95%	2,603,110.30	29.95%	-
中信证券	2	22,049,559,386.22	21.96%	1,908,755.89	21.96%	-
中信建投	1	1,374,438,357.17	14.73%	1,280,011.64	14.73%	-
东兴证券	1	726,422,001.22	7.78%	676,515.19	7.78%	-
大同证券	1	662,113,293.68	7.10%	616,627.04	7.10%	-
招商证券	2	480,301,927.61	5.15%	447,306.05	5.15%	-
长城证券	3	358,342,599.64	3.84%	333,725.86	3.84%	-
银河证券	2	301,477,786.60	3.23%	280,764.27	3.23%	-
光大证券	1	220,921,564.03	2.37%	205,741.49	2.37%	-
华西证券	1	190,825,317.98	2.05%	177,716.85	2.05%	-
国泰君安	2	171,714,405.26	1.84%	159,917.72	1.84%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
申银万国证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内减少方正证券 1 个交易单元，截止本报告期末共计 31 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

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，使用其席位作为基金的专用交易席

位，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
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	10,002,000.00	4.76%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	200,294,972.61	95.24%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
申银万国证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所实施熔断对旗下基金相关业务影响的公告	本基金管理人网站	2016年1月4日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月5日
3	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月6日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月8日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2016年1月12日

		理人网站	
6	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
8	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 14 日
9	长城基金管理有限公司关于变更长城安心回报混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 19 日
10	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
11	长城基金管理有限公司关于参加平安证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
12	长城基金管理有限公司于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
13	长城基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证	2016 年 1 月 21 日

	基金所持固定收益品种估值调整的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
14	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月27日
15	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月28日
16	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年1月29日
17	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年2月2日
18	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年2月4日
19	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年2月26日
20	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016年3月1日

	的公告	券日报及本基金管理人网站	
21	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年3月3日
22	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年3月19日
23	关于增加陆金所资管为长城旗下开放式基金代销机构并同时实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年3月21日
24	长城基金关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年3月25日
25	长城基金关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年3月30日
26	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年4月6日
27	长城基金关于大同证券有限责任公司开通旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年4月12日

		理人网站	
28	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
29	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 6 日
30	长城基金关于增加富济财富为旗下开放式基金代销机构并开通转换定投等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
31	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
32	长城基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
33	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
34	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日

35	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年6月3日
36	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年6月6日
37	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加国盛证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年6月16日
38	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年6月18日
39	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年6月30日
40	关于旗下部分基金通过陆金所资管开通定期定额投资业务并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年7月1日
41	长城基金管理有限公司关于参加兴业证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年7月1日
42	长城基金管理有限公司关于董事	中国证券报及本基	2016年7月4日

	长变更的公告	金管理人网站	
43	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年7月5日
44	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年7月7日
45	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年7月8日
46	长城基金关于增加肯特瑞财富管理公司为旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年8月31日
47	长城基金关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年9月7日
48	关于增加武汉农村商业银行长城旗下开放式基金代销机构并开通定投业务及实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年9月8日
49	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016年9月8日

50	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
51	关于增加方正证券为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日
52	关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 19 日
53	关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 21 日
54	长城基金管理有限公司关于参加和讯科技费率优惠活动的公告（放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 11 日
55	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 12 日
56	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 29 日
57	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中国民生银	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2016 年 12 月 5 日

	行直销银行“基金通”平台开展的申购基金费率优惠活动的公告	基金管理人网站	
58	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 13 日
59	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 21 日
60	长城基金关于旗下部分开放式基金参与农业银行开展的基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 26 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (二) 《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件 营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件 营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管

理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn