

长城中小盘成长混合型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示

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	长城中小盘混合
基金主代码	200012
交易代码	200012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 1 月 27 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	79,025,088.37 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有较高成长性的中小盘股票，在控制风险的基础上，采用积极主动的投资策略，力求实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金，将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置。本基金采用“自下而上”的股票投资策略，股票投资的主要对象是具有较高成长性的中小市值上市公司。在股票选择方面，本基金以成长性为分析重点，对中小市值公司的基本面进行全面考察，挖掘投资机会。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，同时本基金追求个股的成长收益，所以为较高风险、较高收益产品。

注：自基金合同生效至 2016 年 8 月 25 日本基金业绩比较基准为：天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+中债总财富指数收益率×20%；自 2016 年 8 月 26 日起本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。详见本管理人 2016 年 8 月 26 日发布的《关于长城中小盘基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	王永民
	联系电话	0755-23982338	010-66594896

	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95566
传真		0755-23982328	010-66594942

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	基金管理人及基金托管人住所

§ 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	255,579.01	12,712,696.45	58,364,210.94
本期利润	-632,664.62	5,410,611.44	71,080,578.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0082	0.0573	0.2695
本期基金份额净值增长率	-1.44%	-4.06%	38.27%
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	0.1645	0.1818	0.2194
期末基金资产净值	92,026,568.39	89,012,699.86	222,302,396.69
期末基金份额净值	1.165	1.182	1.232

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

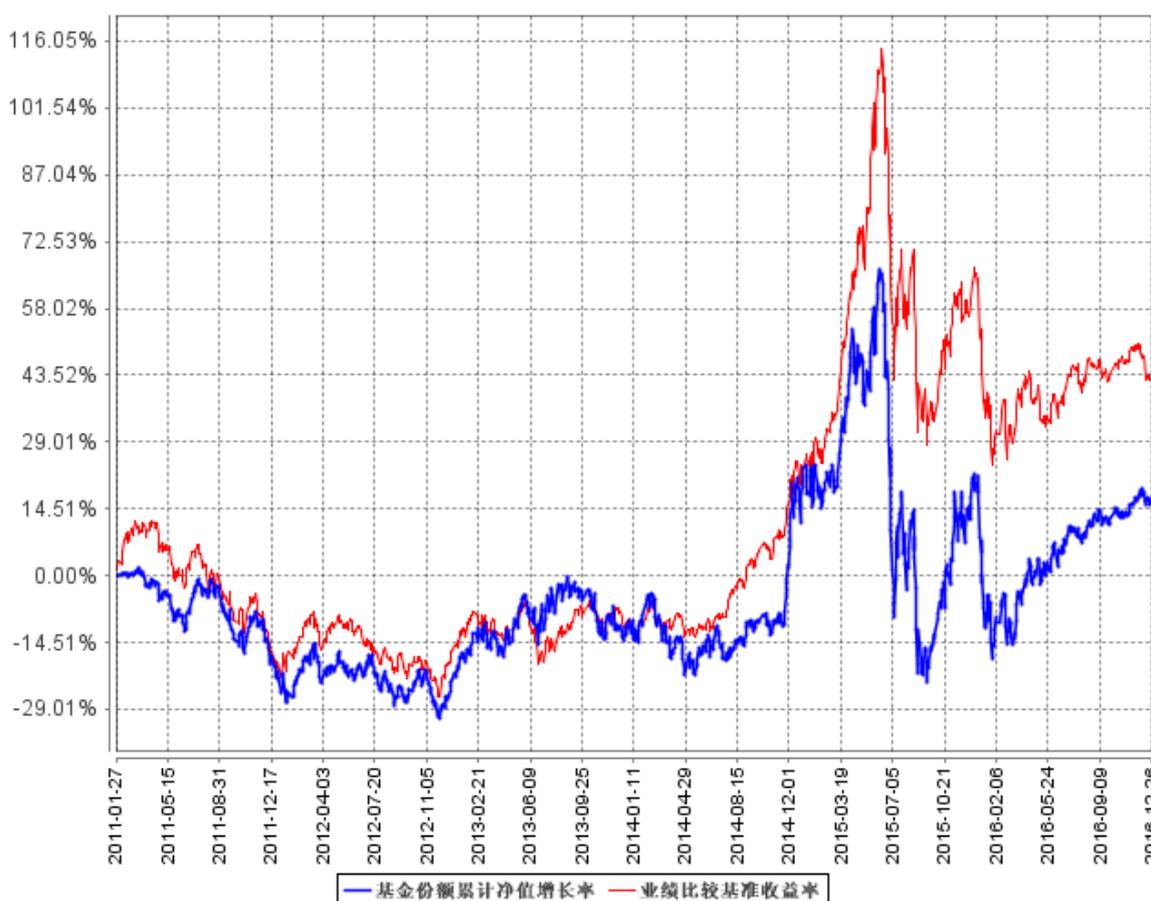
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.93%	0.56%	-0.93%	0.64%	4.86%	-0.08%
过去六个月	8.98%	0.65%	0.98%	0.70%	8.00%	-0.05%
过去一年	-1.44%	1.82%	-12.59%	1.41%	11.15%	0.41%

过去三年	30.75%	2.21%	57.28%	1.56%	-26.53%	0.65%
过去五年	47.10%	1.93%	74.96%	1.40%	-27.86%	0.53%
自基金合同生效起至今	16.50%	1.81%	42.19%	1.35%	-25.69%	0.46%

注：自基金合同生效至 2016 年 8 月 25 日本基金业绩比较基准为：天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×40%+中债总财富指数收益率×20%；自 2016 年 8 月 26 日起本基金的业绩比较基准变更为：中证 700 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。详见本管理人 2016 年 8 月 26 日发布的《关于长城中小盘基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

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

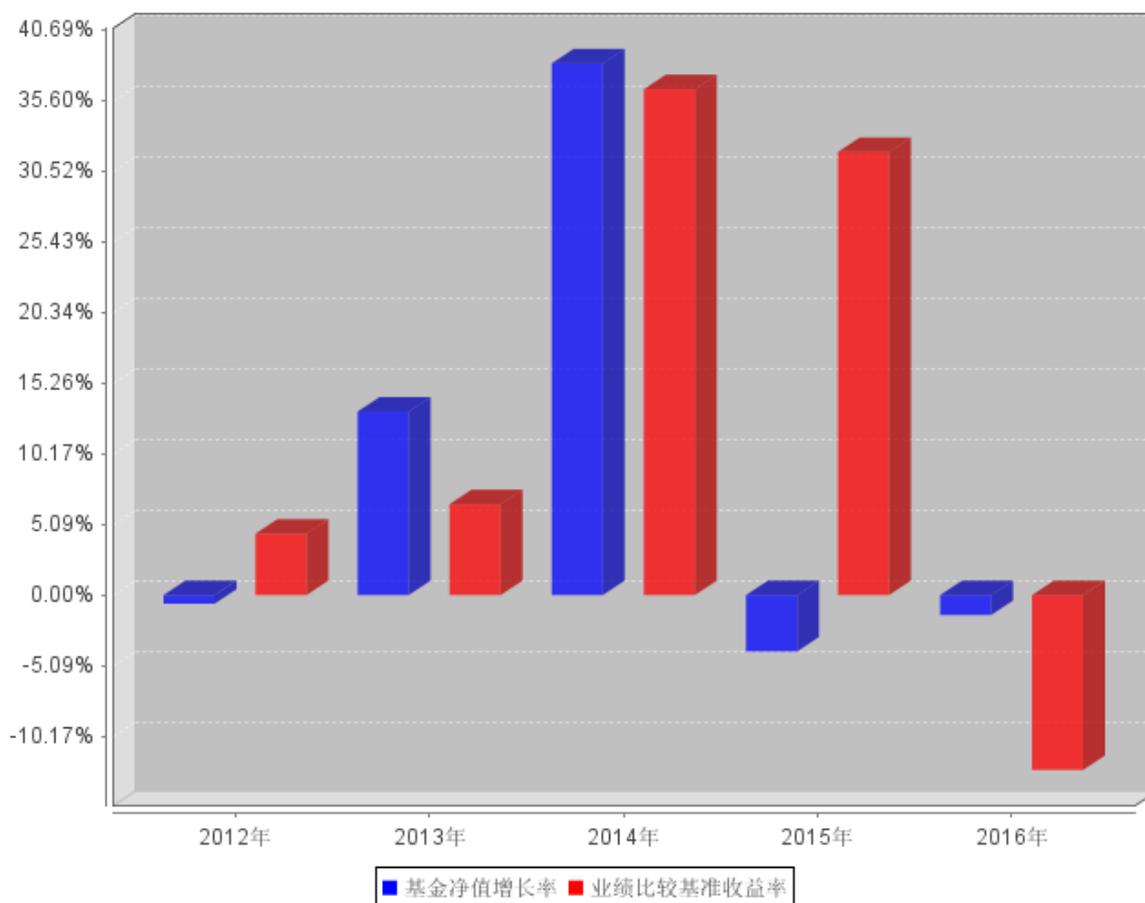
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金投资组合为：股票投资占基金资产的比例范围为 60-95%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-35%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金以及到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金以不低于 80%的股票资产投资于具有较高成长性和基本面良好的中小盘股票。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		
何以广	长城中小盘、长城久富基金的基金经理	2015年6月4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续博士。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》、《长城中小盘成长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

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，

因此本基金在 2016 年后半段主要投资了价值低估的公司。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在 2016 年的另一个投资主线。这是本基金对 2016 年行情和策略的基本回顾。

在操作层面，2016 年本基金的行业配置较为中性，保持了 70%-80%的较低仓位。投资风格方面，本基金主要配置了高成长、低估值的个股以及部分价值重估公司，包括消费电子、医药、食品饮料、房地产等。由于基金配置较为契合市场的风格，本基金在 2016 年取得了较好的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2016 年 1-12 月的净值增长率为-1.44%，在同类可比基金中业绩表现居于前列。

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。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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长城中小盘成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：长城中小盘成长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		20,686,750.76	5,664,706.01
结算备付金		1,036,776.66	894,424.44
存出保证金		75,981.49	134,646.62
交易性金融资产		70,121,827.42	84,454,605.39
其中：股票投资		70,121,827.42	84,454,605.39
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		1,992,256.62	3,891,918.79
应收利息		5,315.13	2,146.82
应收股利		-	-

应收申购款		1,067,225.56	476,901.14
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		94,986,133.64	95,519,349.21
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,966,108.62	-
应付赎回款		224,914.66	5,764,192.20
应付管理人报酬		110,548.60	107,620.89
应付托管费		18,424.79	17,936.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		594,880.02	450,742.79
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		44,688.56	166,156.63
负债合计		2,959,565.25	6,506,649.35
所有者权益:			
实收基金		79,025,088.37	75,322,310.50
未分配利润		13,001,480.02	13,690,389.36
所有者权益合计		92,026,568.39	89,012,699.86
负债和所有者权益总计		94,986,133.64	95,519,349.21

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.165 元，基金份额总额 79,025,088.37 份。

7.2 利润表

会计主体：长城中小盘成长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		4,541,439.73	11,311,836.78
1. 利息收入		173,764.01	103,774.19
其中：存款利息收入		137,928.39	103,774.19

债券利息收入		35,835.62	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,221,985.69	18,349,852.08
其中：股票投资收益		4,812,149.29	17,387,373.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-5,500.00	-
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		415,336.40	962,478.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-888,243.63	-7,302,085.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		33,933.66	160,295.52
减：二、费用		5,174,104.35	5,901,225.34
1. 管理人报酬		1,216,916.95	1,730,270.83
2. 托管费		202,819.51	288,378.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,461,412.72	3,511,270.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		292,955.17	371,305.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-632,664.62	5,410,611.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-632,664.62	5,410,611.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城中小盘成长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）	75,322,310.50	13,690,389.36	89,012,699.86

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-632,664.62	-632,664.62
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）	3,702,777.87	-56,244.72	3,646,533.15
其中：1. 基金申购款	34,456,399.11	1,911,123.85	36,367,522.96
2. 基金赎回款	-30,753,621.24	-1,967,368.57	-32,720,989.81
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）	79,025,088.37	13,001,480.02	92,026,568.39
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）	180,455,062.02	41,847,334.67	222,302,396.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,410,611.44	5,410,611.44
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）	-105,132,751.52	-33,567,556.75	-138,700,308.27
其中：1. 基金申购款	74,386,217.85	20,266,682.37	94,652,900.22
2. 基金赎回款	-179,518,969.37	-53,834,239.12	-233,353,208.49
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）	75,322,310.50	13,690,389.36	89,012,699.86

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

长城中小盘成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名为长城中小盘成长股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2010】1721号文“关于核准长城中小盘成长股票型证券投资基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司作为发起人于2010年12月20日至2011年1月25日向社会公开募集。基金合同于2011年1月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集规模为人民币953,329,491.75元,折合953,329,491.75份基金份额。本基金的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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。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“长城中小盘成长股票型证券投资基金”更名为“长城中小盘成长混合型证券投资基金”,基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板)、债券、货币市场工具、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。如法律法规或监管机构今后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为:中证700指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%

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 年度期间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、会计估计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 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	312,395,164.22	13.76%	499,299,063.17	21.90%
东方证券	-	-	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间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：本基金于本期及上年度可比期间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	290,934.38	13.76%	86,543.96	14.55%
东方证券	-	-	-	-
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	455,465.58	21.82%	40,230.21	8.93%
东方证券	-	-	-	-

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	1,216,916.95	1,730,270.83
其中：支付销售机构的客户维护费	355,143.95	519,328.46

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 110,548.60 元。(2015 年末，人民币 107,620.89 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	202,819.51	288,378.57

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 18,424.79 元。(2015 年末，人民币 17,936.84 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：本基金本期及上年度可比期间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	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
基金合同生效日（2011年1月27日）持有的基金份额	20,003,000.15	20,003,000.15
期初持有的基金份额	20,003,000.15	20,003,000.15
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	20,003,000.15	20,003,000.15
期末持有的基金份额占基金总份额比例	25.3122%	26.5565%

注：基金管理人认购本基金的费率与本基金法律文件规定一致。

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：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金份额。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	20,686,750.76	120,844.35	5,664,706.01	81,690.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

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。

7.4.9 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	2017年11月20日	新股锁定	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
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	11,278	45,112.00	45,112.00	-
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	-
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	2,078	6,379.46	6,379.46	-

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	-	-	250,000	3,071,068.00	3,132,500.00	-

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

注：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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：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。

出回购证券款余额为人民币 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

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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、存出保证金、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 66,906,192.78 元, 划分为第二层次的余额为人民币 3,215,634.64 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 73,915,595.39 元, 划分为第二层次的余额为人民币 10,539,010.00 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	70,121,827.42	73.82
	其中：股票	70,121,827.42	73.82
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	21,723,527.42	22.87
7	其他各项资产	3,140,778.80	3.31
8	合计	94,986,133.64	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	2,096,400.00	2.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,666,035.42	53.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,827,000.00	4.16
F	批发和零售业	7,176,480.00	7.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	4,418,412.00	4.80
K	房地产业	2,937,500.00	3.19
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	-	-
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	70,121,827.42	76.20

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	250,000	3,132,500.00	3.40
2	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	3.34
3	002217	合力泰	170,000	3,043,000.00	3.31
4	000910	大亚圣象	155,000	2,960,500.00	3.22
5	601155	新城控股	250,000	2,937,500.00	3.19
6	000568	泸州老窖	88,400	2,917,200.00	3.17
7	600211	西藏药业	52,000	2,815,280.00	3.06
8	002126	银轮股份	290,000	2,810,100.00	3.05
9	600132	重庆啤酒	150,000	2,767,500.00	3.01
10	002583	海能达	205,000	2,708,050.00	2.94

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）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	300156	神雾环保	19,710,939.64	22.14
2	601009	南京银行	15,318,474.82	17.21
3	002247	帝龙文化	15,145,450.39	17.01
4	000403	ST 生化	13,242,191.40	14.88
5	002310	东方园林	12,962,060.39	14.56
6	002464	金利科技	11,503,188.61	12.92
7	002007	华兰生物	11,395,139.14	12.80
8	002142	宁波银行	10,833,394.97	12.17
9	600491	龙元建设	10,763,792.12	12.09
10	002234	民和股份	10,720,448.00	12.04
11	603866	桃李面包	10,428,965.42	11.72

12	300202	聚龙股份	10,392,598.81	11.68
13	002221	东华能源	9,615,517.60	10.80
14	002746	仙坛股份	9,327,007.46	10.48
15	300237	美晨科技	9,315,134.01	10.46
16	300059	东方财富	8,708,873.40	9.78
17	600837	海通证券	8,679,687.62	9.75
18	600779	水井坊	8,633,395.78	9.70
19	002206	海利得	8,472,829.55	9.52
20	600521	华海药业	8,219,726.93	9.23
21	600419	天润乳业	7,481,478.85	8.40
22	002043	兔宝宝	6,521,223.05	7.33
23	002138	顺络电子	6,499,984.14	7.30
24	300078	思创医惠	6,388,545.94	7.18
25	000915	山大华特	6,352,699.00	7.14
26	000036	华联控股	6,103,006.63	6.86
27	600172	黄河旋风	6,042,991.16	6.79
28	002548	金新农	5,960,595.68	6.70
29	002342	巨力索具	5,853,263.83	6.58
30	601677	明泰铝业	5,800,402.33	6.52
31	600303	曙光股份	5,633,444.00	6.33
32	600782	新钢股份	5,575,382.98	6.26
33	300097	智云股份	5,516,858.10	6.20
34	600079	人福医药	5,509,258.22	6.19
35	002404	嘉欣丝绸	5,364,619.00	6.03
36	002743	富煌钢构	5,363,827.64	6.03
37	600589	广东榕泰	5,254,762.52	5.90
38	300049	福瑞股份	5,244,488.00	5.89
39	000910	大亚圣象	5,225,616.99	5.87
40	300221	银禧科技	5,218,495.95	5.86
41	002635	安洁科技	5,217,693.20	5.86
42	000568	泸州老窖	5,104,802.60	5.73
43	002583	海能达	5,035,397.73	5.66
44	600395	盘江股份	4,953,390.80	5.56
45	002643	万润股份	4,933,890.35	5.54
46	300267	尔康制药	4,929,034.40	5.54
47	300322	硕贝德	4,918,656.92	5.53

48	600068	葛洲坝	4,903,894.00	5.51
49	000488	晨鸣纸业	4,885,690.92	5.49
50	000625	长安汽车	4,867,453.17	5.47
51	300219	鸿利智汇	4,857,355.20	5.46
52	002586	围海股份	4,855,873.00	5.46
53	600211	西藏药业	4,771,676.00	5.36
54	002217	合力泰	4,696,177.00	5.28
55	600519	贵州茅台	4,663,310.27	5.24
56	300258	精锻科技	4,638,443.00	5.21
57	002574	明牌珠宝	4,470,631.13	5.02
58	300040	九洲电气	4,447,618.97	5.00
59	601939	建设银行	4,351,500.00	4.89
60	600498	烽火通信	4,312,784.52	4.85
61	002727	一心堂	4,273,471.00	4.80
62	300014	亿纬锂能	4,213,126.00	4.73
63	600095	哈高科	4,178,983.38	4.69
64	000971	高升控股	4,083,245.50	4.59
65	600967	北方创业	4,023,862.00	4.52
66	300036	超图软件	4,019,351.20	4.52
67	600216	浙江医药	4,002,045.36	4.50
68	002361	神剑股份	3,982,180.14	4.47
69	002751	易尚展示	3,949,586.50	4.44
70	600664	哈药股份	3,946,260.19	4.43
71	000911	南宁糖业	3,924,468.75	4.41
72	601607	上海医药	3,899,977.78	4.38
73	000012	南玻A	3,872,136.59	4.35
74	002742	三圣股份	3,871,492.75	4.35
75	600506	香梨股份	3,847,546.04	4.32
76	300166	东方国信	3,837,297.04	4.31
77	600639	浦东金桥	3,835,639.00	4.31
78	002580	圣阳股份	3,800,165.00	4.27
79	300263	隆华节能	3,750,929.60	4.21
80	600221	海南航空	3,668,500.00	4.12
81	600306	*ST 商城	3,570,769.00	4.01
82	600016	民生银行	3,559,864.00	4.00
83	000933	*ST 神火	3,494,914.00	3.93

84	002565	顺灏股份	3,481,488.00	3.91
85	601633	长城汽车	3,445,918.90	3.87
86	600439	瑞贝卡	3,398,822.11	3.82
87	600338	西藏珠峰	3,374,547.00	3.79
88	002523	天桥起重	3,305,120.64	3.71
89	600327	大东方	3,272,684.67	3.68
90	000825	太钢不锈	3,234,000.00	3.63
91	300302	同有科技	3,200,075.00	3.60
92	603968	醋化股份	3,198,416.00	3.59
93	600369	西南证券	3,183,477.00	3.58
94	300342	天银机电	3,142,207.00	3.53
95	600844	丹化科技	3,073,679.99	3.45
96	002509	天广中茂	3,071,068.00	3.45
97	002775	文科园林	3,067,426.00	3.45
98	002366	台海核电	3,042,181.00	3.42
99	600708	光明地产	3,028,375.94	3.40
100	601155	新城控股	3,025,801.41	3.40
101	002667	鞍重股份	3,018,804.00	3.39
102	000060	中金岭南	2,989,657.23	3.36
103	002271	东方雨虹	2,956,495.03	3.32
104	300408	三环集团	2,864,613.93	3.22
105	002078	太阳纸业	2,863,133.62	3.22
106	000709	河钢股份	2,839,804.62	3.19
107	002341	新纶科技	2,823,817.00	3.17
108	002504	弘高创意	2,822,374.00	3.17
109	000401	冀东水泥	2,819,357.80	3.17
110	300394	天孚通信	2,810,280.00	3.16
111	002358	森源电气	2,806,438.17	3.15
112	600502	安徽水利	2,777,808.71	3.12
113	600074	保千里	2,771,709.20	3.11
114	002299	圣农发展	2,766,660.00	3.11
115	000952	广济药业	2,757,254.00	3.10
116	600869	智慧能源	2,721,510.82	3.06
117	601857	中国石油	2,713,000.00	3.05
118	600117	西宁特钢	2,705,099.35	3.04
119	600477	杭萧钢构	2,702,364.40	3.04

120	600166	福田汽车	2,663,661.00	2.99
121	600883	博闻科技	2,659,842.07	2.99
122	603528	多伦科技	2,659,577.05	2.99
123	002126	银轮股份	2,624,976.00	2.95
124	300174	元力股份	2,617,014.66	2.94
125	000976	春晖股份	2,601,629.00	2.92
126	600132	重庆啤酒	2,580,592.00	2.90
127	601166	兴业银行	2,578,500.00	2.90
128	300210	森远股份	2,573,379.44	2.89
129	002594	比亚迪	2,563,130.00	2.88
130	000018	神州长城	2,561,140.43	2.88
131	600791	京能置业	2,560,984.00	2.88
132	002088	鲁阳节能	2,542,559.72	2.86
133	300287	飞利信	2,538,252.00	2.85
134	002233	塔牌集团	2,536,365.76	2.85
135	600691	阳煤化工	2,524,601.49	2.84
136	601328	交通银行	2,523,000.00	2.83
137	002456	欧菲光	2,516,220.80	2.83
138	000413	东旭光电	2,514,461.00	2.82
139	600277	亿利洁能	2,513,875.00	2.82
140	002061	*ST江化	2,511,020.00	2.82
141	601099	太平洋	2,506,901.50	2.82
142	300320	海达股份	2,501,549.00	2.81
143	002671	龙泉股份	2,501,248.00	2.81
144	002440	闰土股份	2,494,162.37	2.80
145	601800	中国交建	2,487,605.12	2.79
146	300236	上海新阳	2,479,985.40	2.79
147	300008	天海防务	2,479,001.90	2.78
148	600685	中船防务	2,470,786.00	2.78
149	002582	好想你	2,460,764.10	2.76
150	002169	智光电气	2,460,590.42	2.76
151	600569	安阳钢铁	2,440,000.00	2.74
152	300312	邦讯技术	2,438,570.70	2.74
153	002665	首航节能	2,428,714.98	2.73
154	600073	上海梅林	2,408,345.00	2.71
155	000541	佛山照明	2,403,965.00	2.70

156	601818	光大银行	2,392,000.00	2.69
157	300364	中文在线	2,391,389.00	2.69
158	601668	中国建筑	2,383,000.00	2.68
159	600259	广晟有色	2,369,207.00	2.66
160	300246	宝莱特	2,364,301.00	2.66
161	603306	华懋科技	2,364,182.73	2.66
162	002006	精功科技	2,354,146.90	2.64
163	300128	锦富新材	2,339,149.36	2.63
164	300203	聚光科技	2,335,821.00	2.62
165	600373	中文传媒	2,335,115.61	2.62
166	300182	捷成股份	2,331,751.36	2.62
167	601636	旗滨集团	2,331,677.00	2.62
168	600975	新五丰	2,329,559.77	2.62
169	300185	通裕重工	2,328,569.78	2.62
170	002155	湖南黄金	2,307,590.00	2.59
171	002551	尚荣医疗	2,301,369.00	2.59
172	600798	宁波海运	2,301,161.67	2.59
173	600136	当代明诚	2,299,135.11	2.58
174	000005	世纪星源	2,287,566.61	2.57
175	002533	金杯电工	2,284,704.81	2.57
176	000820	神雾节能	2,272,396.01	2.55
177	002157	正邦科技	2,271,349.00	2.55
178	001979	招商蛇口	2,257,513.00	2.54
179	000968	*ST 煤气	2,256,658.00	2.54
180	002458	益生股份	2,230,564.80	2.51
181	000812	陕西金叶	2,228,339.26	2.50
182	000573	粤宏远 A	2,200,609.00	2.47
183	600475	华光股份	2,198,101.00	2.47
184	300518	盛讯达	2,188,937.28	2.46
185	002372	伟星新材	2,170,905.40	2.44
186	000750	国海证券	2,167,999.00	2.44
187	002056	横店东磁	2,161,519.63	2.43
188	300299	富春通信	2,145,016.98	2.41
189	000858	五粮液	2,144,013.00	2.41
190	000778	新兴铸管	2,142,000.00	2.41
191	600887	伊利股份	2,134,262.26	2.40

192	000926	福星股份	2,127,745.00	2.39
193	002277	友阿股份	2,102,575.00	2.36
194	002532	新界泵业	2,101,567.62	2.36
195	002294	信立泰	2,097,244.33	2.36
196	300037	新宙邦	2,083,680.00	2.34
197	300309	吉艾科技	2,066,060.00	2.32
198	600593	大连圣亚	2,050,065.00	2.30
199	300284	苏交科	2,042,875.00	2.30
200	601186	中国铁建	2,034,400.00	2.29
201	300161	华中数控	2,024,089.00	2.27
202	601398	工商银行	2,020,000.00	2.27
203	603017	中衡设计	2,012,005.95	2.26
204	002171	楚江新材	2,006,206.00	2.25
205	000920	南方汇通	1,978,070.65	2.22
206	000949	新乡化纤	1,975,988.15	2.22
207	300476	胜宏科技	1,971,258.00	2.21
208	603609	禾丰牧业	1,963,758.00	2.21
209	600658	电子城	1,957,178.99	2.20
210	300316	晶盛机电	1,952,332.76	2.19
211	603008	喜临门	1,945,381.00	2.19
212	002452	长高集团	1,941,585.00	2.18
213	300197	铁汉生态	1,936,013.82	2.17
214	300389	艾比森	1,935,000.00	2.17
215	002258	利尔化学	1,934,445.00	2.17
216	601211	国泰君安	1,926,000.00	2.16
217	600146	商赢环球	1,916,489.00	2.15
218	000822	山东海化	1,907,562.00	2.14
219	300093	金刚玻璃	1,880,848.00	2.11
220	002323	雅百特	1,877,028.00	2.11
221	000823	超声电子	1,873,656.00	2.10
222	600512	腾达建设	1,870,665.00	2.10
223	002670	国盛金控	1,855,128.95	2.08
224	603021	山东华鹏	1,849,777.00	2.08
225	600750	江中药业	1,848,442.00	2.08
226	600500	中化国际	1,841,912.25	2.07
227	600075	新疆天业	1,836,958.00	2.06

228	601006	大秦铁路	1,830,000.00	2.06
229	002170	芭田股份	1,828,968.00	2.05
230	601169	北京银行	1,821,685.94	2.05
231	600821	津劝业	1,817,383.20	2.04
232	002408	齐翔腾达	1,815,348.40	2.04
233	002092	中泰化学	1,805,516.00	2.03
234	000400	许继电气	1,801,989.00	2.02
235	600865	百大集团	1,784,782.05	2.01

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	300156	神雾环保	18,392,290.71	20.66
2	601009	南京银行	16,287,526.87	18.30
3	002247	帝龙文化	15,891,197.96	17.85
4	002310	东方园林	13,386,005.50	15.04
5	002464	金利科技	12,687,408.00	14.25
6	002007	华兰生物	12,092,328.57	13.58
7	000403	ST 生化	11,237,143.76	12.62
8	600491	龙元建设	10,999,389.00	12.36
9	300202	聚龙股份	10,499,698.35	11.80
10	002234	民和股份	10,379,124.24	11.66
11	002746	仙坛股份	10,168,330.31	11.42
12	002142	宁波银行	9,755,418.16	10.96
13	300237	美晨科技	9,655,715.24	10.85
14	600419	天润乳业	9,584,557.90	10.77
15	002206	海利得	9,408,684.81	10.57
16	603866	桃李面包	9,155,530.70	10.29
17	600779	水井坊	9,022,577.51	10.14
18	600521	华海药业	8,736,270.44	9.81
19	300059	东方财富	8,606,931.60	9.67
20	300097	智云股份	8,008,691.17	9.00
21	600837	海通证券	7,721,448.95	8.67
22	002138	顺络电子	7,191,861.08	8.08
23	000036	华联控股	7,050,722.00	7.92
24	600589	广东榕泰	7,009,981.44	7.88

25	000915	山大华特	6,801,430.97	7.64
26	600172	黄河旋风	6,591,914.20	7.41
27	300078	思创医惠	6,535,894.79	7.34
28	002221	东华能源	6,475,006.72	7.27
29	002043	兔宝宝	6,389,791.13	7.18
30	300049	福瑞股份	5,967,482.25	6.70
31	300258	精锻科技	5,851,276.98	6.57
32	600303	曙光股份	5,758,965.00	6.47
33	002548	金新农	5,678,538.06	6.38
34	002404	嘉欣丝绸	5,610,222.63	6.30
35	300221	银禧科技	5,574,960.00	6.26
36	300040	九洲电气	5,529,992.33	6.21
37	002643	万润股份	5,472,424.00	6.15
38	002743	富煌钢构	5,430,687.00	6.10
39	600782	新钢股份	5,322,923.28	5.98
40	300014	亿纬锂能	5,117,515.66	5.75
41	000625	长安汽车	5,092,319.54	5.72
42	300219	鸿利智汇	5,061,943.65	5.69
43	600079	人福医药	5,059,897.00	5.68
44	002635	安洁科技	5,047,465.00	5.67
45	600395	盘江股份	5,042,341.00	5.66
46	300322	硕贝德	4,892,586.17	5.50
47	300267	尔康制药	4,821,239.92	5.42
48	600068	葛洲坝	4,802,165.92	5.39
49	002727	一心堂	4,784,824.20	5.38
50	600519	贵州茅台	4,656,034.00	5.23
51	000488	晨鸣纸业	4,407,869.29	4.95
52	601939	建设银行	4,403,100.00	4.95
53	600306	*ST 商城	4,343,310.92	4.88
54	600095	哈高科	4,310,569.08	4.84
55	600967	北方创业	4,250,771.04	4.78
56	600498	烽火通信	4,237,177.33	4.76
57	300037	新宙邦	4,137,926.00	4.65
58	300036	超图软件	4,128,030.43	4.64
59	002574	明牌珠宝	4,112,359.00	4.62
60	002751	易尚展示	4,008,962.00	4.50
61	002361	神剑股份	4,001,491.50	4.50
62	000971	高升控股	4,001,191.00	4.50

63	300166	东方国信	3,976,336.20	4.47
64	600216	浙江医药	3,970,564.00	4.46
65	002742	三圣股份	3,939,379.20	4.43
66	000012	南玻A	3,908,137.99	4.39
67	601607	上海医药	3,892,587.69	4.37
68	600639	浦东金桥	3,886,139.00	4.37
69	000911	南宁糖业	3,878,368.55	4.36
70	300263	隆华节能	3,767,197.10	4.23
71	600221	海南航空	3,623,400.00	4.07
72	300342	天银机电	3,620,578.00	4.07
73	002341	新纶科技	3,611,558.74	4.06
74	002169	智光电气	3,609,592.46	4.06
75	002580	圣阳股份	3,589,609.00	4.03
76	601633	长城汽车	3,577,715.00	4.02
77	300093	金刚玻璃	3,517,845.88	3.95
78	600016	民生银行	3,488,927.00	3.92
79	002342	巨力索具	3,468,258.00	3.90
80	002523	天桥起重	3,415,386.73	3.84
81	002565	顺灏股份	3,338,869.97	3.75
82	300038	梅泰诺	3,329,777.00	3.74
83	601677	明泰铝业	3,307,659.41	3.72
84	000933	*ST神火	3,297,466.40	3.70
85	600369	西南证券	3,277,550.00	3.68
86	603968	醋化股份	3,272,769.25	3.68
87	600338	西藏珠峰	3,241,629.70	3.64
88	600708	光明地产	3,230,241.12	3.63
89	600327	大东方	3,211,537.00	3.61
90	000825	太钢不锈	3,192,909.32	3.59
91	002366	台海核电	3,182,742.00	3.58
92	300408	三环集团	3,115,499.76	3.50
93	002667	鞍重股份	3,110,777.30	3.49
94	300250	初灵信息	3,101,022.60	3.48
95	300302	同有科技	3,083,791.00	3.46
96	600074	保千里	3,045,999.00	3.42
97	002775	文科园林	3,034,486.00	3.41
98	000952	广济药业	3,015,088.00	3.39
99	300174	元力股份	3,012,083.80	3.38
100	002586	围海股份	2,978,326.24	3.35

101	000060	中金岭南	2,954,549.47	3.32
102	600865	百大集团	2,933,282.25	3.30
103	002271	东方雨虹	2,913,916.38	3.27
104	600844	丹化科技	2,902,906.00	3.26
105	000401	冀东水泥	2,897,671.98	3.26
106	601857	中国石油	2,847,173.78	3.20
107	000709	河钢股份	2,834,838.54	3.18
108	000976	春晖股份	2,818,601.48	3.17
109	002078	太阳纸业	2,808,201.00	3.15
110	600502	安徽水利	2,782,395.00	3.13
111	300245	天玑科技	2,744,333.05	3.08
112	300394	天孚通信	2,742,556.00	3.08
113	002583	海能达	2,725,286.89	3.06
114	603528	多伦科技	2,678,311.70	3.01
115	002299	圣农发展	2,675,257.80	3.01
116	002504	弘高创意	2,670,389.00	3.00
117	600869	智慧能源	2,670,166.73	3.00
118	600117	西宁特钢	2,651,591.00	2.98
119	601668	中国建筑	2,645,700.00	2.97
120	600883	博闻科技	2,620,415.28	2.94
121	002671	龙泉股份	2,619,258.16	2.94
122	000413	东旭光电	2,615,319.00	2.94
123	600136	当代明诚	2,575,096.00	2.89
124	600277	亿利洁能	2,570,120.80	2.89
125	002233	塔牌集团	2,560,647.00	2.88
126	002088	鲁阳节能	2,557,724.47	2.87
127	601099	太平洋	2,555,373.00	2.87
128	002582	好想你	2,549,883.88	2.86
129	000018	神州长城	2,547,023.65	2.86
130	002456	欧菲光	2,545,303.89	2.86
131	000968	*ST 煤气	2,541,657.72	2.86
132	002358	森源电气	2,511,311.32	2.82
133	002665	首航节能	2,510,581.30	2.82
134	300008	天海防务	2,504,778.00	2.81
135	300287	飞利信	2,503,164.00	2.81
136	600569	安阳钢铁	2,492,000.00	2.80
137	002061	*ST 江化	2,491,867.21	2.80
138	601800	中国交建	2,489,956.73	2.80

139	600146	商赢环球	2,489,920.00	2.80
140	002440	闰土股份	2,478,249.69	2.78
141	001979	招商蛇口	2,457,871.69	2.76
142	601818	光大银行	2,456,000.00	2.76
143	002395	双象股份	2,452,020.00	2.75
144	002452	长高集团	2,444,852.90	2.75
145	000910	大亚圣象	2,441,313.04	2.74
146	601328	交通银行	2,423,100.00	2.72
147	300236	上海新阳	2,405,862.00	2.70
148	300182	捷成股份	2,399,962.47	2.70
149	300320	海达股份	2,394,680.20	2.69
150	300364	中文在线	2,376,779.60	2.67
151	000541	佛山照明	2,370,160.00	2.66
152	600685	中船防务	2,369,016.00	2.66
153	600975	新五丰	2,357,672.00	2.65
154	002594	比亚迪	2,352,226.49	2.64
155	002502	骅威文化	2,346,578.00	2.64
156	601636	旗滨集团	2,346,000.00	2.64
157	002056	横店东磁	2,340,001.00	2.63
158	300299	富春通信	2,337,090.00	2.63
159	600073	上海梅林	2,329,318.90	2.62
160	002155	湖南黄金	2,327,476.00	2.61
161	300312	邦讯技术	2,313,858.00	2.60
162	002533	金杯电工	2,313,353.00	2.60
163	600373	中文传媒	2,301,600.00	2.59
164	600798	宁波海运	2,294,388.00	2.58
165	603306	华懋科技	2,284,123.00	2.57
166	300368	汇金股份	2,282,348.00	2.56
167	600259	广晟有色	2,261,392.00	2.54
168	300185	通裕重工	2,256,594.00	2.54
169	002458	益生股份	2,241,663.00	2.52
170	300456	耐威科技	2,235,899.00	2.51
171	000005	世纪星源	2,232,021.21	2.51
172	000820	神雾节能	2,229,055.10	2.50
173	300051	三五互联	2,225,249.00	2.50
174	002766	索菱股份	2,224,605.00	2.50
175	002551	尚荣医疗	2,205,822.93	2.48
176	600791	京能置业	2,188,532.84	2.46

177	600211	西藏药业	2,175,738.00	2.44
178	300518	盛讯达	2,174,148.60	2.44
179	300246	宝莱特	2,172,839.00	2.44
180	002006	精功科技	2,169,337.14	2.44
181	300476	胜宏科技	2,167,983.00	2.44
182	002532	新界泵业	2,162,572.84	2.43
183	000568	泸州老窖	2,153,811.52	2.42
184	603017	中衡设计	2,147,882.00	2.41
185	300259	新天科技	2,147,593.76	2.41
186	300175	朗源股份	2,144,972.00	2.41
187	000750	国海证券	2,144,000.00	2.41
188	300333	兆日科技	2,142,021.00	2.41
189	002171	楚江新材	2,131,165.00	2.39
190	000858	五粮液	2,126,000.00	2.39
191	002294	信立泰	2,111,904.60	2.37
192	002372	伟星新材	2,106,195.99	2.37
193	002277	友阿股份	2,103,695.18	2.36
194	000926	福星股份	2,101,415.00	2.36
195	300338	开元仪器	2,086,332.00	2.34
196	000949	新乡化纤	2,076,714.35	2.33
197	300284	苏交科	2,073,211.00	2.33
198	000573	粤宏远 A	2,072,927.21	2.33
199	002157	正邦科技	2,059,403.83	2.31
200	603008	喜临门	2,057,594.00	2.31
201	000778	新兴铸管	2,051,791.98	2.31
202	600887	伊利股份	2,051,434.50	2.30
203	300128	锦富新材	2,043,409.02	2.30
204	000920	南方汇通	2,035,567.00	2.29
205	300309	吉艾科技	2,014,135.92	2.26
206	000622	*ST 恒立	2,005,161.37	2.25
207	601398	工商银行	1,995,000.00	2.24
208	600658	电子城	1,994,861.00	2.24
209	600228	昌九生化	1,994,428.00	2.24
210	000812	陕西金叶	1,989,894.97	2.24
211	600466	蓝光发展	1,979,047.00	2.22
212	601186	中国铁建	1,973,825.00	2.22
213	300411	金盾股份	1,970,523.00	2.21
214	300161	华中数控	1,960,113.00	2.20

215	000975	银泰资源	1,960,000.00	2.20
216	300389	艾比森	1,950,615.90	2.19
217	603678	火炬电子	1,946,830.00	2.19
218	002217	合力泰	1,945,640.00	2.19
219	601211	国泰君安	1,937,003.00	2.18
220	300143	星河生物	1,931,542.00	2.17
221	600475	华光股份	1,921,520.92	2.16
222	002670	国盛金控	1,908,041.00	2.14
223	002258	利尔化学	1,904,941.93	2.14
224	600075	新疆天业	1,902,841.99	2.14
225	600889	南京化纤	1,894,782.00	2.13
226	002467	二六三	1,892,252.00	2.13
227	300355	蒙草生态	1,882,391.15	2.11
228	300197	铁汉生态	1,881,348.94	2.11
229	600512	腾达建设	1,878,204.00	2.11
230	603609	禾丰牧业	1,877,763.50	2.11
231	601616	广电电气	1,872,252.00	2.10
232	600506	香梨股份	1,863,920.00	2.09
233	000822	山东海化	1,856,676.14	2.09
234	002323	雅百特	1,841,293.00	2.07
235	600750	江中药业	1,835,979.00	2.06
236	300048	合康新能	1,835,357.00	2.06
237	002408	齐翔腾达	1,830,580.00	2.06
238	002376	新北洋	1,830,032.00	2.06
239	002515	金字火腿	1,815,936.20	2.04
240	002494	华斯股份	1,812,981.98	2.04
241	600978	宜华生活	1,812,728.00	2.04
242	000889	茂业通信	1,804,895.00	2.03
243	300018	中元股份	1,803,400.00	2.03
244	000715	中兴商业	1,802,414.00	2.02
245	601169	北京银行	1,797,860.12	2.02
246	002170	芭田股份	1,787,300.83	2.01
247	300378	鼎捷软件	1,785,300.00	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	1,126,970,335.83
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,145,227,019.46
--------------	------------------

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，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	75,981.49
2	应收证券清算款	1,992,256.62
3	应收股利	-
4	应收利息	5,315.13
5	应收申购款	1,067,225.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,140,778.80

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	3,132,500.00	3.40	重大事项停牌
2	002821	凯莱英	3,071,977.41	3.34	新股锁定

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
3,090	25,574.46	25,916,908.03	32.80%	53,108,180.34	67.20%

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	-	-

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 (2011 年 1 月 27 日) 基金份额总额	953,329,491.75
本报告期期初基金份额总额	75,322,310.50
本报告期基金总申购份额	34,456,399.11
减:本报告期基金总赎回份额	30,753,621.24
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	79,025,088.37

§ 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

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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肆万元。

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六年。

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	
平安证券	1	792,868,774.98	34.92%	738,398.76	34.92%	-
华西证券	2	461,684,800.52	20.33%	429,965.96	20.33%	-
安信证券	2	371,956,786.04	16.38%	346,404.27	16.38%	-
长城证券	1	312,395,164.22	13.76%	290,934.38	13.76%	-
申万宏源	1	138,863,091.20	6.12%	129,323.49	6.12%	-
东北证券	2	100,828,969.77	4.44%	93,901.96	4.44%	-
海通证券	2	92,138,782.51	4.06%	85,808.49	4.06%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内共新增 9 个交易单元（华西证券 2 个交易单元、信达证券 1 个交易单元、平安证券 1 个交易单元、浙商证券 1 个交易单元、东北证券 2 个交易单元、华鑫证券 2 个交易单元），减少中泰证券 1 个交易单元，截止本报告期末共计 19 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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (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
平安证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	5,005,500.00	100.00%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-