

# 长城久鼎保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长城久鼎保本
基金主代码	002542
交易代码	002542
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 7 月 21 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	3,424,038,327.07 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	<p>本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在固定收益类资产和风险资产之间的大类资产配置策略；另一层为固定收益类资产的投资策略和风险资产的投资策略。</p> <p>本基金采用固定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例，以保证基金资产在 3 年保本周期末本金安全，并力争实现基金资产的保值增值。</p>
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率。

风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
--------	--

### 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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	29,168,903.44
本期利润	61,945,578.98
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期基金份额净值增长率	1.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0143
期末基金资产净值	3,474,565,076.67
期末基金份额净值	1.015

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本基金合同于 2016 年 07 月 21 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

#### 3.2 基金净值表现

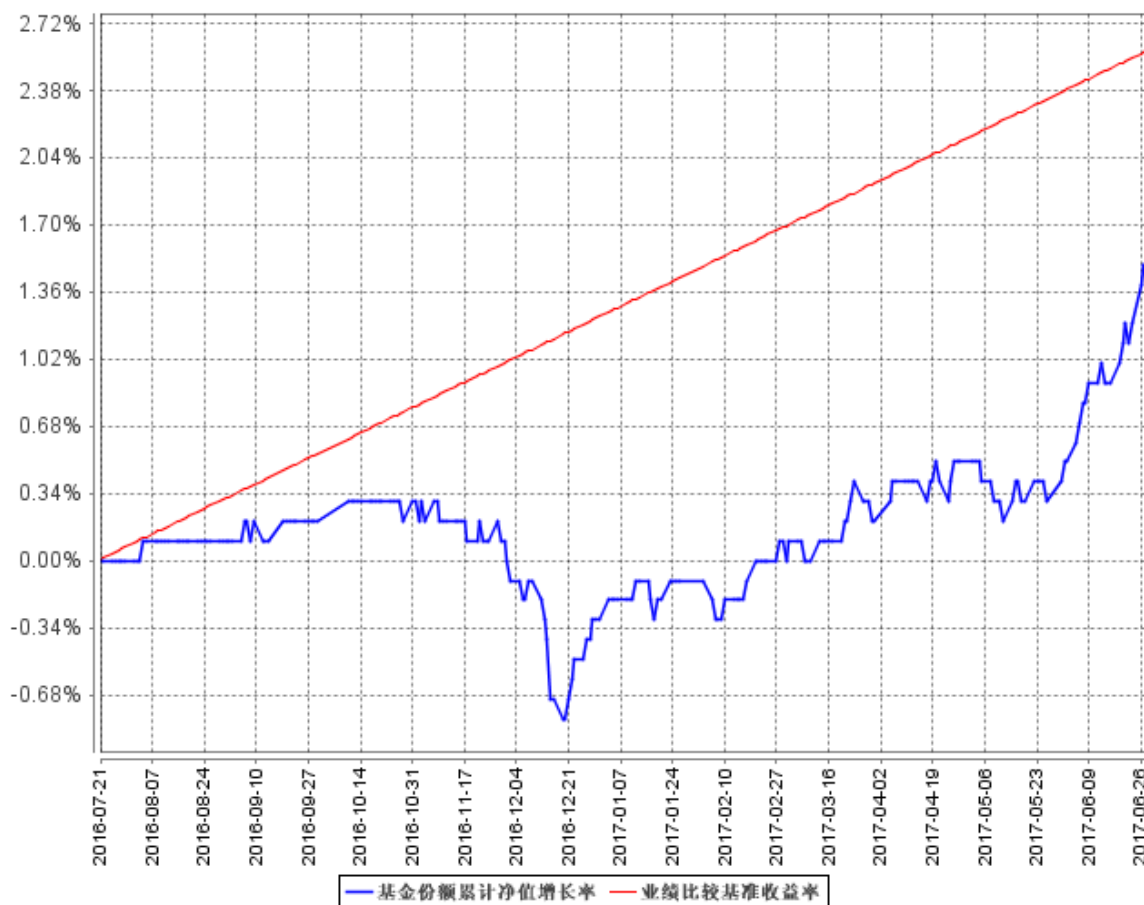
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.10%	0.08%	0.23%	0.01%	0.87%	0.07%
过去三个月	1.30%	0.08%	0.69%	0.01%	0.61%	0.07%
过去六个月	1.81%	0.07%	1.36%	0.01%	0.45%	0.06%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

自基金合同 生效起至今	1.50%	0.07%	2.60%	0.01%	-1.10%	0.06%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

### 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：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

③本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

## § 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。截止本报告期末，公司管理的基金有：久嘉证券投资基金（2017 年 7 月 5 日起由封闭式基金转为开放式基金，并更名为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金）、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、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置

混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
马强	长城久鑫保本、长城新策略混合、长城新优选混合、长城久安保本、长城久润保本、长城久益保本、长城久鼎保本、长城久盛安稳债券基金的基金经理	2016 年 7 月 26 日	-	5 年	男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012 年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、自 2015 年 1 月 9 日至 2015 年 6 月 23 日担任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”和“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”基金经理助理，自 2015 年 3 月 9 日至 2015 年 6 月 23 日担任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理，自 2015 年 6 月 24 日至 2017 年 3 月 16 日担任“长城久恒灵活配



					置混合型证券投资基金” 基金经理。
陈良栋	长城保 本、长城 久祥保 本、长城 久安保 本、长城 久益保 本、长城 久鼎保 本、长城 新兴产 业混合 基金的 基金经 理	2016 年 8 月 25 日	-	6 年	男，中国籍，清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。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。

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》、《长城久鼎保本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。

### 4.3.2 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

上半年经济平稳运行，工业增加值、固定资产投资、企业利润均稳步上行，PPI 高位震荡略有回落，CPI 仍处底部，社会消费品增速平稳。房地产销量持续增长，随着调控继续升温，多地出台限购限贷政策，控制资产泡沫，一二线成交回落，但三四线城市销售火爆，去库存效果显著。国内流动性市场在 MPA 季度考核下，稳中趋紧，进入六月份后，央行针对 MLF 续期操作，资金面情绪恢复。未来资管新规的出台将消除不少监管套利，银行理财增速放缓，市场流动性预期增量边际效应趋弱。境外方面，发达经济体开始探讨货币政策常态化进程，美联储今年已两次加息，并将在年内探讨缩表事宜，加拿大首次加息，英国及欧盟也在逐渐靠近。

整体回顾来看，上半年股票市场走出整体振荡，结构分化行情，以白酒、家电、电子和银行为代表的大盘蓝筹股，以及白马成长股，走出一波持续上涨行情，而以计算机、传媒、农林牧渔和纺织服装为代表的中小板公司持续创新低，市场偏好业绩确定度高的绩优股。上半年债券市场，在金融去杠杆方向下，监管政策收紧，市场持续调整，在阶段性资金紧张情绪中，收益率上行后高位震荡，最后一个月受政策呵护有所下行。

本基金在股票组合的操作上，根据安全垫积累情况保持相对中性仓位，偏重配置白马成长股和大盘蓝筹股，并积极在超跌的中小盘个股中挑选被错杀的个股。在固定收益组合操作上，适度降低了组合久期，继续优化组合信用资质，同时，在季末资金紧张时，配置了部分协议存款。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 1.81%，本基金比较基准收益率为 1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济仍具较强韧性，预计将保持稳健增长势头，但是需要关注房地产调控政策带来的滞后影响，以及金融去杠杆等政策的影响，导致市场对未来宏观经济走势的预期变化。股票市场下半年我们认为在宏观经济、政策导向和市场选择等多重因素共同作用下，市场继续回归基本面，偏好业绩好，估值合理的优质公司。下半年基金将以优质蓝筹股和白马成长股为底仓，积极寻找被错杀的中小股票。债券市场经过自去年四季度开始的调整以来，目前位置逐渐具备配置价值。监管政策依旧是市场的主要变动驱动因素。下半年债券市场的投资上，首先严防信用风险，同时，保持组合中性久期，并择机参与利率债波段机会。

#### 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、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”）在对长城久鼎保本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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		6,686,210.71	201,048,982.01
结算备付金		3,494,099.64	713,119.32
存出保证金		94,288.92	116,431.94
交易性金融资产		1,896,737,391.75	2,277,609,349.06
其中：股票投资		161,977,591.75	35,410,345.36
基金投资		-	-
债券投资		1,734,759,800.00	2,242,199,003.70
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		1,552,100,640.00	1,229,065,723.60
应收证券清算款		11,586,746.06	-
应收利息		21,156,665.06	37,535,104.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	99.05
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,491,856,042.14	3,746,088,809.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	2,700,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		12,561,117.59	5,796,418.36
应付管理人报酬		3,440,704.82	3,821,948.79
应付托管费		573,450.80	636,991.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		321,033.55	188,812.55
应交税费		-	-
应付利息		-	933.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		394,658.71	152,720.67
负债合计		17,290,965.47	13,297,825.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		3,424,038,327.07	3,743,179,616.84
未分配利润		50,526,749.60	-10,388,632.96
所有者权益合计		3,474,565,076.67	3,732,790,983.88
负债和所有者权益总计		3,491,856,042.14	3,746,088,809.49

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.015 元，基金份额总额 3,424,038,327.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		89,117,207.75
1.利息收入		65,856,113.55
其中：存款利息收入		27,697,012.36
债券利息收入		29,817,050.77
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		8,342,050.42
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,118,188.03
其中：股票投资收益		916,638.11
基金投资收益		-
债券投资收益		-13,310,323.78
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		1,275,497.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		32,776,675.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		1,602,606.69
<b>减：二、费用</b>		27,171,628.77
1. 管理人报酬		21,493,596.87
2. 托管费		3,582,266.12
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		956,475.40
5. 利息支出		905,163.72
其中：卖出回购金融资产支出		905,163.72
6. 其他费用		234,126.66



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,945,578.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,945,578.98

注：本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	3,743,179,616.84	-10,388,632.96	3,732,790,983.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,945,578.98	61,945,578.98
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）	-319,141,289.77	-1,030,196.42	-320,171,486.19
其中：1.基金申购款	349,823.41	-122.73	349,700.68
2.基金赎回款	-319,491,113.18	-1,030,073.69	-320,521,186.87
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)	3,424,038,327.07	50,526,749.60	3,474,565,076.67

注：本基金基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 何伟	_____ 熊科金	_____ 赵永强
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城久鼎保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，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[2016]445 号文“关于准予长城久鼎保本混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自 2016 年 7 月 11 日至 2016 年 7 月 15 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60737541\_H07 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 3,876,282,246.39 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 516,962.85 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 3,876,799,209.24 元，折合 3,876,799,209.24 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”)。

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金将投资对象主要分为固定收益类资产和风险资产，其中固定收益类资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债和债券回购等)、银行存款等；风险资产为股票、权证和中小企业私募债券等。本基金按照 CPPI 策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中，股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

#### **6.4.2 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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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、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。

#### **6.4.3 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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 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**

本基金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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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。

##### **6.4.5.2 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。

##### **6.4.5.3 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。

## 6.4.6 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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

#### 6.4.8 本报告期的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	22,116,629.77	3.36%

注：本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行债券交易。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本期未通过关联交易单元进行债券回购交易。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	20,597.36	3.36%	20,597.36	6.45%

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。

本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,493,596.87
其中：支付销售机构的客户维护费	10,552,834.28

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

2) 本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,582,266.12

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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) 本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：2016 年 7 月 21 日为本基金合同生效日，本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资本基金份额，本期末亦未持有本基金份额，且无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.4.2 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。

### 6.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	6,686,210.71	205,132.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行同业利率计息。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效，无上年度可比期间数据。

## 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 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



002859	洁美科技	2017年 3月24 日	2018 年4月 9日	新股锁 定	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017年 3月31 日	2018 年4月 12日	新股锁 定	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017年 6月5日	2017 年7月 7日	新股未 上市	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年 6月15 日	2017 年7月 17日	新股未 上市	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017年 6月26 日	2017 年7月 3日	新股未 上市	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年 6月30 日	2017 年7月 12日	新股未 上市	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017年 6月27 日	2017 年7月 5日	新股未 上市	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 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。

#### 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 2017 年 6 月 30 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 161,903,482.44 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,734,833,909.31 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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	161,977,591.75	4.64
	其中：股票	161,977,591.75	4.64
2	固定收益投资	1,734,759,800.00	49.68
	其中：债券	1,734,759,800.00	49.68
	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	1,552,100,640.00	44.45
	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	10,180,310.35	0.29
7	其他各项资产	32,837,700.04	0.94
8	合计	3,491,856,042.14	100.00

### 7.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	114,856,671.91	3.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,205,200.60	0.47

F	批发和零售业	6,435,382.80	0.19
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	7,639.62	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,393,782.26	0.50
L	租赁和商务服务业	7,078,914.56	0.20
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	161,977,591.75	4.66

### 7.3 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	002236	大华股份	2,493,912	56,886,132.72	1.64
2	002450	康得新	790,255	17,796,542.60	0.51
3	600466	蓝光发展	2,015,502	17,393,782.26	0.50
4	002217	合力泰	1,126,200	11,126,856.00	0.32
5	000895	双汇发展	426,100	10,119,875.00	0.29
6	600477	杭萧钢构	593,410	9,055,436.60	0.26
7	000581	威孚高科	293,437	7,600,018.30	0.22

8	600068	葛洲坝	636,100	7,149,764.00	0.21
9	002027	分众传媒	514,456	7,078,914.56	0.20
10	002589	瑞康医药	417,882	6,435,382.80	0.19

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

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002450	康得新	65,577,258.28	1.76
2	002236	大华股份	21,856,919.03	0.59
3	600068	葛洲坝	17,705,770.35	0.47
4	600466	蓝光发展	17,402,033.98	0.47
5	000018	神州长城	15,811,575.60	0.42
6	600109	国金证券	14,008,456.36	0.38
7	600066	宇通客车	13,975,260.13	0.37
8	002027	分众传媒	13,921,733.28	0.37
9	601997	贵阳银行	11,059,129.40	0.30
10	601186	中国铁建	11,020,517.98	0.30
11	601800	中国交建	10,862,139.00	0.29
12	601668	中国建筑	10,753,247.00	0.29
13	002048	宁波华翔	10,637,524.11	0.28
14	600029	南方航空	10,495,578.32	0.28
15	002043	兔宝宝	10,471,421.04	0.28
16	002217	合力泰	10,357,334.80	0.28
17	000895	双汇发展	9,806,934.00	0.26

18	000333	美的集团	7,419,932.00	0.20
19	000858	五 粮 液	7,399,046.00	0.20
20	600308	华泰股份	7,378,814.51	0.20

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。

#### 7.4.2 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	002450	康得新	50,201,817.15	1.34
2	000018	神州长城	15,036,816.82	0.40
3	600066	宇通客车	13,677,811.72	0.37
4	600109	国金证券	13,306,220.00	0.36
5	601997	贵阳银行	11,547,697.85	0.31
6	601186	中国铁建	11,158,353.24	0.30
7	601668	中国建筑	10,974,637.15	0.29
8	002236	大华股份	10,787,741.87	0.29
9	002048	宁波华翔	10,653,190.06	0.29
10	601800	中国交建	10,539,972.36	0.28
11	600029	南方航空	10,145,018.00	0.27
12	600068	葛洲坝	9,189,849.78	0.25
13	300072	三聚环保	8,526,407.17	0.23
14	300182	捷成股份	8,257,132.00	0.22
15	000333	美的集团	8,192,766.00	0.22
16	002027	分众传媒	7,910,488.55	0.21
17	000858	五 粮 液	7,854,782.00	0.21
18	600176	中国巨石	7,516,898.40	0.20
19	603816	顾家家居	7,355,743.00	0.20

20	600308	华泰股份	7,283,898.00	0.20
----	--------	------	--------------	------

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。

### 7.4.3 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	377,687,487.91
卖出股票收入（成交）总额	282,753,071.79

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。

### 7.5 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	9,990,000.00	0.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,157,059,800.00	33.30
	其中：政策性金融债	1,084,671,000.00	31.22
4	企业债券	469,990,000.00	13.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	97,720,000.00	2.81
10	合计	1,734,759,800.00	49.93

注：其他为地方政府债。

### 7.6 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	160420	16 农发 20	3,500,000	341,215,000.00	9.82
2	160415	16 农发 15	1,900,000	186,637,000.00	5.37
3	136702	16 华润 02	1,800,000	174,636,000.00	5.03
4	130408	13 农发 08	1,700,000	169,966,000.00	4.89
5	136426	16 电投 01	1,400,000	138,614,000.00	3.99

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。



## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 7.12.3 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	94,288.92
2	应收证券清算款	11,586,746.06
3	应收股利	-
4	应收利息	21,156,665.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,837,700.04

#### **7.12.4 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。

#### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本期末持有的前十名股票不存在流通受限的情况。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
18,570	184,385.48	7,329,748.99	0.21%	3,416,708,578.08	99.79%

### 8.2 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	29,704.32	0.0009%

### 8.3 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。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年7月21日）基金份额总额	3,876,799,209.24
本报告期期初基金份额总额	3,743,179,616.84
本报告期基金总申购份额	349,823.41
减：本报告期基金总赎回份额	319,491,113.18
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	3,424,038,327.07

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
海通证券	2	178,558,006.97	27.09%	166,291.19	27.09%	-
方正证券	2	173,273,218.51	26.29%	161,369.35	26.29%	-
申万宏源	1	146,389,177.60	22.21%	136,332.67	22.21%	-
安信证券	2	135,305,575.27	20.53%	126,010.35	20.53%	-
长城证券	1	22,116,629.77	3.36%	20,597.36	3.36%	-
光大证券	1	3,469,098.63	0.53%	3,230.82	0.53%	-
华西证券	2	19,220.00	0.00%	17.89	0.00%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富 富证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共新增西藏东方财富证券 2 个交易单元；截止本报告期末共计 21 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。

### 10.7.2 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
海通证券	-	-	3,034,400,000.00	17.24%	-	-
方正证券	175,000.00	0.02%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
安信证券	12,419,515.20	1.43%	5,623,000,000.00	31.94%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	8,787,700,000.00	49.92%	-	-
华西证券	-	-	159,700,000.00	0.91%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	853,100,770.94	98.55%	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。