

长城久嘉创新成长灵活配置混合型
证券投资基金（原久嘉证券投资基金转型）
2017 年年度报告摘要

2017 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：2018 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金由原久嘉证券投资基金转型而成。本管理人以通讯方式组织召开了久嘉证券投资基金基金份额持有人大会，大会于 2017 年 5 月 23 日表决通过了《关于久嘉证券投资基金转型有关事项的议案》（详见 2017 年 5 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登的《久嘉证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》）。久嘉证券投资基金于 2017 年 07 月 05 日终止上市，由封闭式基金转型为开放式基金，调整存续期限、投资目标、范围和策略，修订基金合同和招募说明书，并更名为“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”。自 2017 年 07 月 05 日起，由《久嘉证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《久嘉证券投资基金基金合同》自同日起失效。

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 2018 年 03 月 29 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。

长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2017 年 07 月 05 日起至 12 月 31 日止，原久嘉证券投资基金报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 07 月 04 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	长城久嘉创新成长混合
基金主代码	004666
交易代码	004666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 7 月 5 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	877,838,351.94 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	长城久嘉封闭
场内简称	基金久嘉
基金主代码	184722
交易代码	184722
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002 年 7 月 5 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	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2002 年 8 月 27 日

注：本基金于 2017 年 07 月 05 日终止上市，由封闭式基金转型为开放式基金，名称变更为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金重点投资在我国经济转型过程中具有良好成长性的创新型上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力求实现超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；

	<p>对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。</p> <p>本基金所指的创新成长主题相关行业指在中国经济结构转型及产业升级的进程中，通过技术创新、服务创新、产品创新、商业模式创新等手段实现成长的行业。其中，技术创新是指企业应用新知识、新技术、新工艺，开发生产新的产品，提供新的服务，或提高产品质量、降低产品成本，占据市场并实现市场价值的活动；服务及产品创新是指通过提供全新的产品或服务、开创新的产业领域，或以以前所未有的方式提供已有的产品或服务，提升企业的核心竞争优势；商业模式创新是指企业通过商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等多方面的创新，通过这些创新实现了企业成本的降低、盈利的增加和竞争实力的提高。</p>
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	为投资者减少和分散投资风险, 确保基金资产的安全并谋求长期稳定的收益。
投资策略	根据中国证券市场的特点, 本基金将极其注重对市场整体趋势的把握, 重视对投资的市场时机选择。本基金将注重评判与把握不同类别投资市场的整体风险与收益, 在不同阶段合理配置基金资产在股票、债券、现金的分配比例。
业绩比较基准	上证 A 股指数
风险收益特征	中性的风险偏好, 力争实现年度内基金单位资产净值在市场下跌时跌幅不高于比较基准跌幅的 60%, 在市场上涨时增幅不低于比较基准的 70%。

注：本基金于 2017 年 07 月 05 日终止上市，由封闭式基金转型为开放式基金，名称变更为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金。

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	贺倩
	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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年7月5日(基金合同生效日)至2017年12月31日
本期已实现收益	27,194,111.26
本期利润	-6,170,658.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0043
本期基金份额净值增长率	-0.48%
3.1.2 期末数据和指标	2017年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.0114
期末基金资产净值	901,848,199.58
期末基金份额净值	1.0274

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本基金自 2017 年 7 月 5 日起，由《久嘉证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《久嘉证券投资基金基金合同》自同日起失效。

④本基金已于 2017 年 8 月 3 日对由基金久嘉转型而来的长城久嘉创新成长混合型基金份额进行了份额折算，折算比例为 0.967689850。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年1月1日至 2017年7月4日	2016年	2015年
本期已实现收益	-82,809,697.78	35,543,651.69	656,352,821.63
本期利润	-11,785,065.49	-352,622,127.76	852,742,478.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0059	-0.1763	0.4264
本期基金份额净值增长率	-0.43%	-11.60%	41.94%
3.1.2 期末数据和指标	2017年7月4日	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0241	0.0288	0.2635
期末基金资产净值	1,993,796,526.45	2,057,581,591.94	2,886,203,719.70
期末基金份额净值	0.9969	1.0288	1.4431

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。

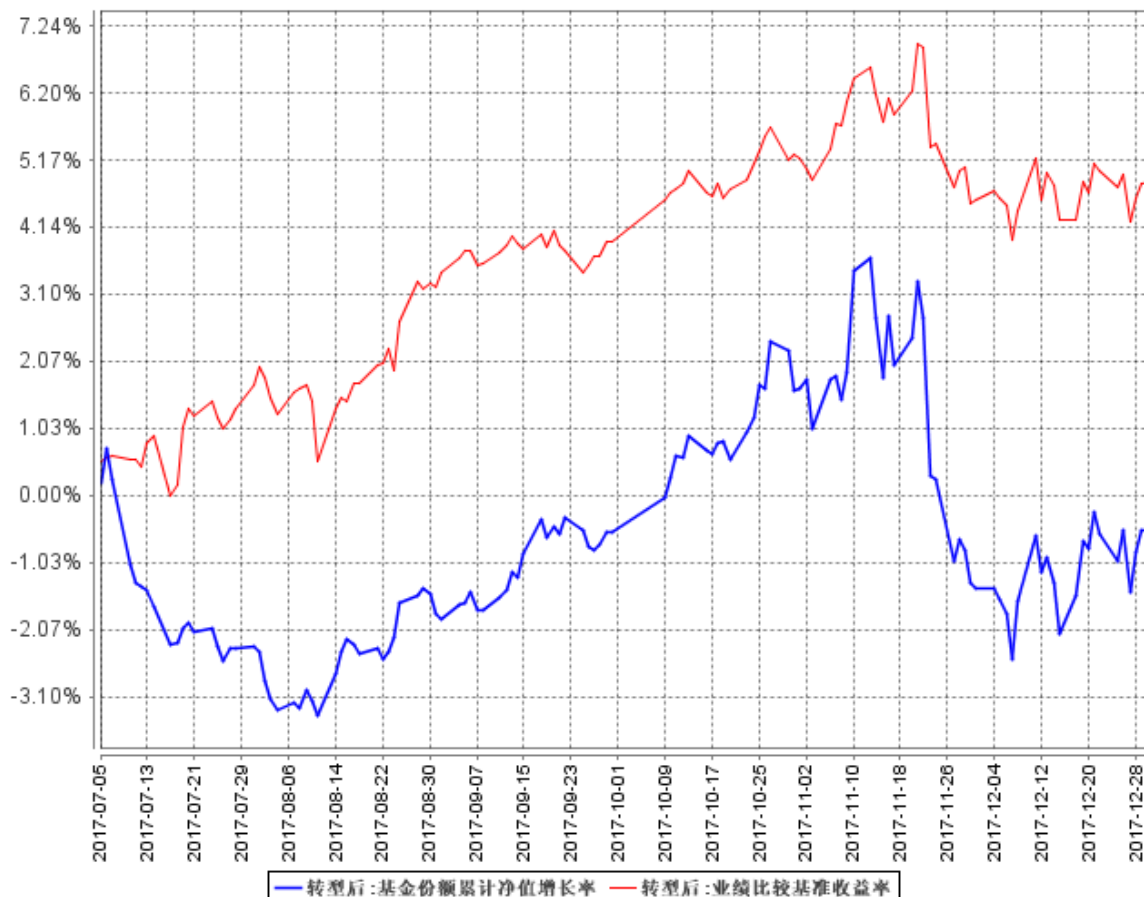
3.2 基金净值表现（转型后）

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	0.04%	0.64%	0.88%	0.38%	-0.84%	0.26%
自基金转型起至今	-0.48%	0.50%	4.83%	0.35%	-5.31%	0.15%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



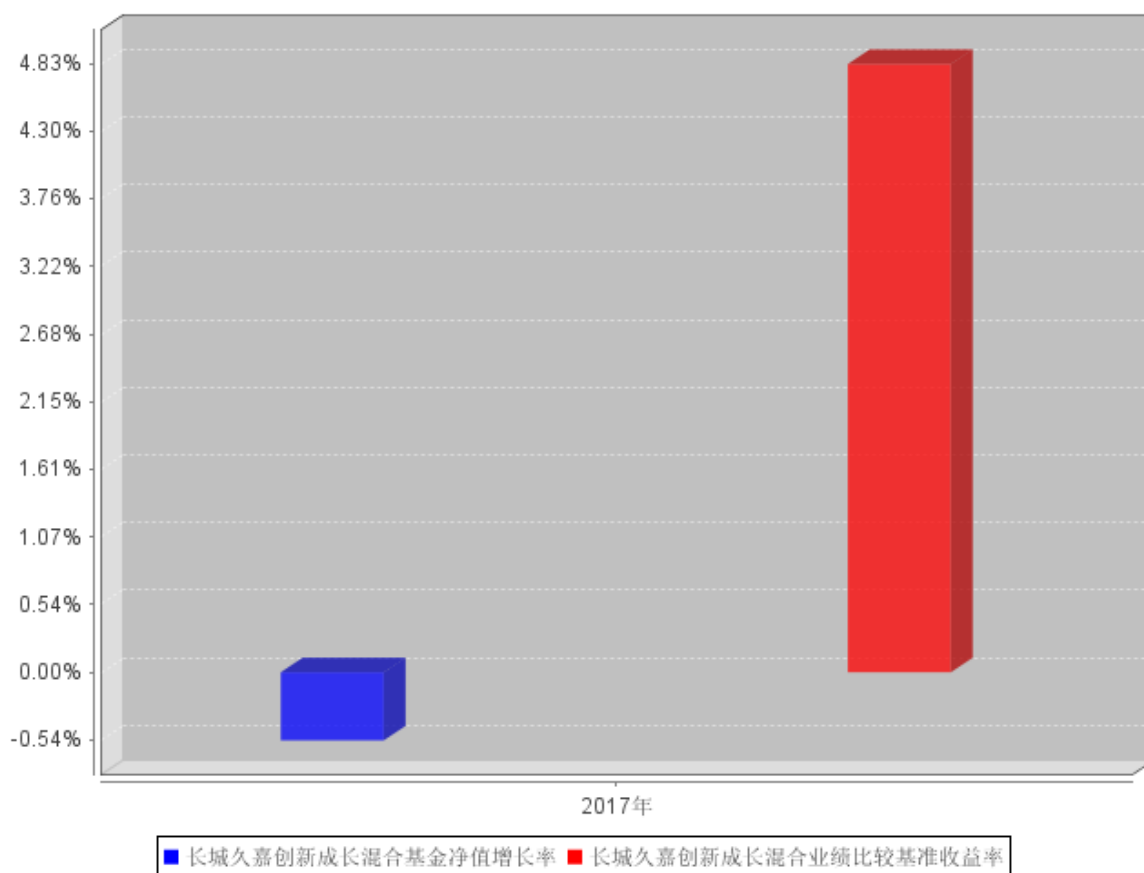
注：①本基金合同规定本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资具有创新成长主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

②本基金的建仓期为自基金转型之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

③本基金转型日期为 2017 年 7 月 5 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

3.2.3 自基金转型以来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

长城久嘉创新成长混合自基金合同生效以来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



注：基金转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

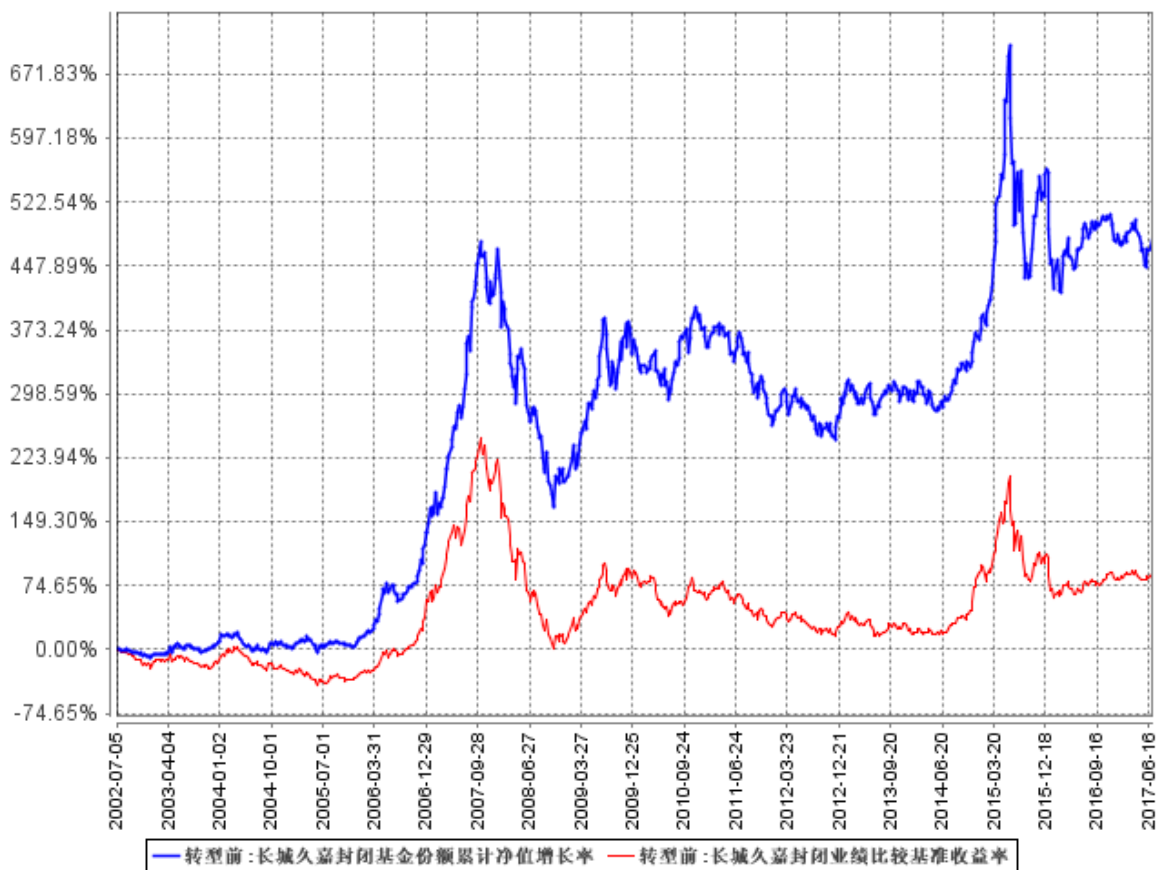
3.2 基金净值表现（转型前）

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
2017年4月1日至2017年7月4日	-2.07%	1.94%	-0.93%	1.32%	-1.14%	0.62%
2017年1月1日至2017年7月4日	-0.43%	1.53%	2.89%	1.23%	-3.32%	0.30%
2016年7月1日至2017年7月4日	-0.40%	1.35%	9.03%	1.35%	-9.43%	0.00%
2014年7月1日至2017年7月4日	48.11%	3.13%	56.79%	3.72%	-8.68%	-0.59%
2012年7月1日至2017年7月4日	51.67%	2.73%	43.46%	3.27%	8.21%	-0.54%
2002年7月5日至2017年7月4日	472.60%	2.95%	86.99%	3.53%	385.61%	-0.58%

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

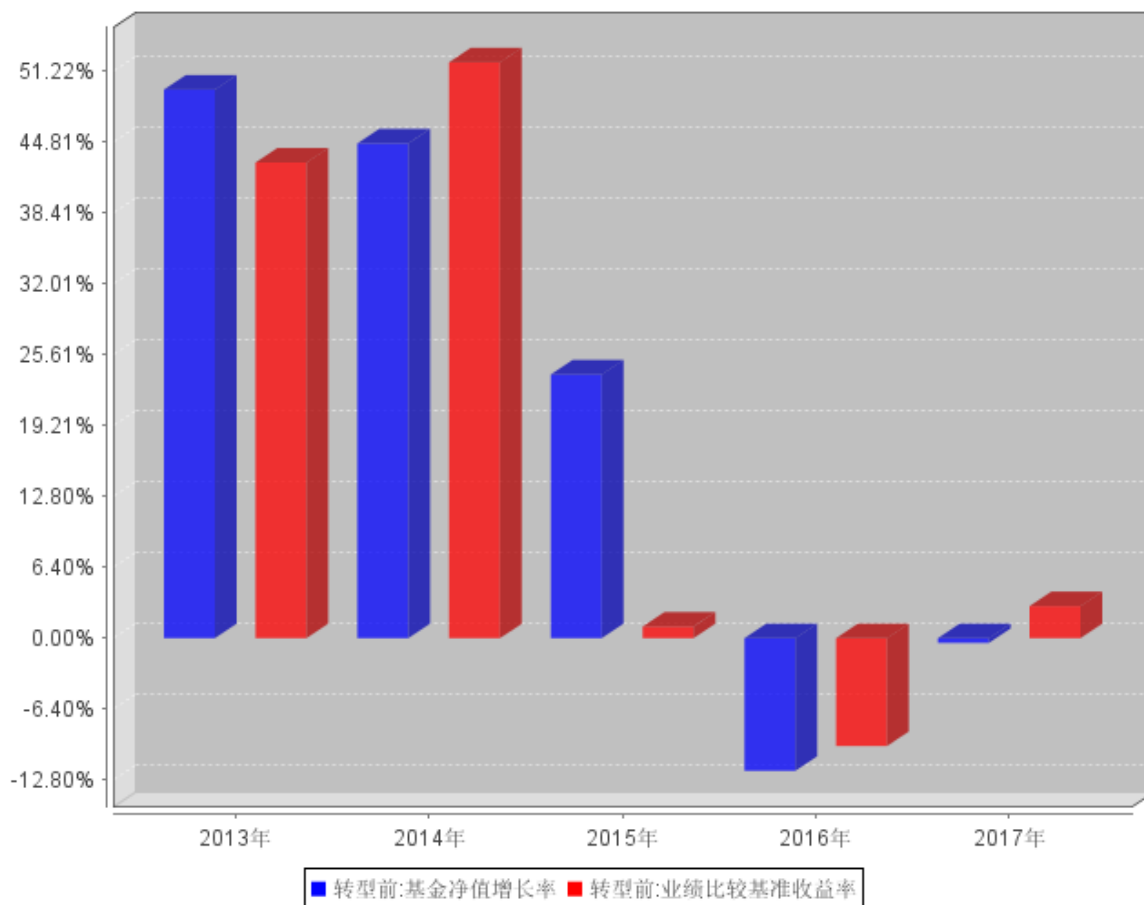
长城久嘉封闭基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同约定：本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。

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

转型前

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年1月1日 -2017年7月4日	0.2600	52,000,000.00	-	52,000,000.00	
2016年1月1日 -2016年12月31日	2.3800	476,000,000.00	-	476,000,000.00	
2015年1月1日 -2015年12月31日	-	-	-	-	
合计	2.6400	528,000,000.00	-	528,000,000.00	

转型后

注：转型后报告期内本基金未实施利润分配。

§ 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。截止本报告期末，公司管理的基金有：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、长城收益宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
乔春	长城久嘉创新成长混合型基金、长城环保和长城双动力基金的基金经理	2017年7月5日	2017年8月18日	7年	男，中国籍，中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士。2010年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员，“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理助理，“久嘉证券投资基金（该基金自2017年7月5日起转型为“长城久嘉创新成长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”和“长城双动力混合型证券投资基金”的基金经理。
蒋劲刚	长城久惠保本、长城久鑫保本、长城久祥保本、长城久源保本和长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理	2017年7月5日	-	19年	男，中国籍。天津大学材料系工学学士、天津大学管理学院工学硕士。曾就职于深圳市华为技术有限公司、海南富岛资产管理有限公司。2001年10月进入长城基金管理有限公司，历任运行保障部交易室交易员、交易主管、研究部行业研究员、机构理财部投资经理、长城消费增值混合型证券投资基金的基金经理、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理、研究部总经理、长城久泰、长城品牌、	2017年8月18日	-	17年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券股份有限公司投资银行部，2001年10月进入长城基金管理有限公司，曾任基金经理助理、“长城安心回报混合型证券投资基金”，“长城中小盘

	长城久兆和长城久嘉创新成长混合型基金基金经理				成长混合型证券投资基金”基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。
龙宇飞	长城消费混合、长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理	2017年10月18日	-	6年	吉林大学制药工程学士，中国科学院细胞生物学博士。曾就职于中信建投证券股份有限公司（2011年7月至2013年6月）、中国人寿资产管理有限公司（2013年7月至2015年4月）、中欧基金管理有限公司（2015年4月至2017年8月）。2017年9月进入长城基金管理有限公司，曾任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理助理。
龙宇飞	长城久嘉创新成长混合型基金基金经理助理	2017年9月18日	2017年10月18日	6年	吉林大学制药工程学士，中国科学院细胞生物学博士。曾就职于中信建投证券股份有限公司（2011年7月至2013年6月）、中国人寿资产管理有限公司（2013年7月至2015年4月）、中欧基金管理有限公司（2015年4月至2017年8月）。2017年9月进入长城基金管理有限公司，曾任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理助理。

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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
蒋劲刚	久嘉证券投资基金、长城久惠保本、长城	2012年3月7日	-	19年	男，中国籍。天津大学材料系工学学士、天津大学管理学院工学硕士。曾就职于深圳市华为技术有限公司、海南富岛资产管理有限公司。

	久鑫保本、长城久祥保本和长城久源保本的基金经理				2001年10月进入长城基金管理有限公司，历任运行保障部交易室交易员、交易主管、研究部行业研究员、机构理财部投资经理、长城消费增值混合型证券投资基金的基金经理、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
乔春	久嘉证券投资基金、长城环保、长城双动力基金的基金经理	2014年9月16日	-	7年	男，中国籍，中南大学环境工程专业工学学士、南开大学金融学硕士。2010年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员，“长城安心回报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》、《长城久嘉创新成长灵活配置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

2017 年，在中央供给侧结构性改革成效显著、国内需求持续温和好转、全球经济复苏导致国内出口回暖的背景下，国内宏观经济景气程度明显回升，制造业 PMI 全年处于扩张区间，PPI 处于近六年以来高位，GDP 增长 6.9%，七年来首次提速。宏观经济的景气复苏也传导到上市公司，A 股公司盈利取得了较快增长，全部 A 股 2017 年三季报（年报尚未披露完毕）净利同比增速 18.3%，剔除金融后增速 35.1%（根据海通证券策略团队统计），增速为 2011 年以来新高。因此，本基金过去一年主要配置了受益于宏观经济回暖，估值与增速相匹配的行业和标的。

本基金由于 2017 年三季度进行了封闭式基金向开放式基金的转换，考虑到基金规模的较大波动，下半年采取了相对保守的仓位控制策略，降低了基金净值的波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后：

截至 2017 年 12 月 31 日，长城久嘉创新成长混合份额净值为 1.0274 元，自 2017 年 7 月 5 日起至 2017 年 12 月 31 日止，基金份额净值增长率为-0.48%，业绩比较基准收益率 4.83%。

转型前：

截至 2017 年 7 月 4 日，长城久嘉封闭份额净值为 0.9969 元，自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 7 月 4 日止，基金份额净值增长率为-0.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，未来一段时间我国宏观经济仍处于良好态势中，2016 年三季度 PPI 转正后国内经济快速复苏，目前逐渐进入整固期。中国未来将进入发展质量重于发展速度的新时代，过去高速发展带来的粗放式机会将被高质量增长的结构性的机会取代，在供给侧改革持续推进下，“补短板”成为我们接下来的关注重点，我们认为会有一批体现消费升级、产业升级、具备国际竞争力的企业从各行各业中走出来，这些企业是未来中国经济的支柱，同时也将为投资人创造长期超额收益。

关于消费升级，过去一年很多消费领域在经济复苏的背景下，都经历了新一轮的消费升级，如可选消费品中的汽车、高端白酒和家电等，必选消费品中的乳制品等，未来一年我们将持续关注此类消费领域的投资机会。

关于产业升级，中国在部分制造业领域已经出现具备国际竞争力的优秀企业；而在更多的领域，中国企业背靠广阔而高速增长的市场、坐拥工程师红利，正在加速追赶国际一线企业。我们将自下而上寻找这些领域的投资机会。

除了宏观经济和行业运行情况外，我们也将紧密跟踪金融去杠杆背景下流动性的变化，关注强监管下政策导向的变化，这些因素将对市场的利率水平和风险偏好产生较大影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人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、运行保障部总经理、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。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。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。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

转型前：本基金于 2017 年 4 月 18 日进行了利润分配，共分配 52,000,000.00 元，是对 2016 年度利润进行的分配。

转型后：报告期内本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长城基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告（转型后）

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。

§ 6 审计报告（转型前）

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（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	148,146,401.43
结算备付金	3,157,898.25
存出保证金	1,245,963.66
交易性金融资产	693,606,771.05
其中：股票投资	665,213,737.45
基金投资	-
债券投资	28,393,033.60
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	200,014,420.02
应收证券清算款	-
应收利息	1,783,492.20
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,047,954,946.61
负债和所有者权益	本期末 2017 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	141,570,381.51
应付赎回款	726,474.67
应付管理人报酬	1,034,089.30
应付托管费	198,903.96
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,899,470.58
应交税费	6,609.30
应付利息	-

应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	670,817.71
负债合计	146,106,747.03
所有者权益：	
实收基金	907,146,719.28
未分配利润	-5,298,519.70
所有者权益合计	901,848,199.58
负债和所有者权益总计	1,047,954,946.61

注：1) 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0274 元，基金份额总额 877,838,351.94 份。

2) 本基金合同于 2017 年 7 月 5 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.2 利润表

会计主体：长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	12,536,615.83
1. 利息收入	12,010,254.05
其中：存款利息收入	1,503,394.21
债券利息收入	6,080,857.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,426,002.38
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	27,825,227.55
其中：股票投资收益	53,953,934.19
基金投资收益	-
债券投资收益	-25,742,465.22
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	-386,241.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-33,364,769.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,065,904.10
减：二、费用	18,707,274.44
1. 管理人报酬	9,699,077.89

2. 托管费	1,806,306.03
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	6,963,805.35
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	238,085.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,170,658.61
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,170,658.61

注：本基金合同于 2017 年 7 月 5 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 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）	2,000,000,000.00	-6,203,473.55	1,993,796,526.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,170,658.61	-6,170,658.61
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）	-1,092,853,280.72	7,075,612.46	-1,085,777,668.26
其中：1. 基金申购款	668,244,032.58	-9,667,012.66	658,577,019.92
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,761,097,313.30	16,742,625.12	-1,744,354,688.18
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）	907,146,719.28	-5,298,519.70	901,848,199.58

注：本基金合同于 2017 年 7 月 5 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

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：

<u>何伟</u>	<u>熊科金</u>	<u>赵永强</u>
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

长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),是根据中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)2017年4月13日证监许可[2017]516号文“关于准予久嘉证券投资基金变更注册的批复”及原久嘉证券投资基金(以下简称“基金久嘉”)基金份额持有人大会2017年5月23日决议通过的《关于久嘉证券投资基金转型有关事项的议案》,由原基金久嘉转型而来。原基金久嘉为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限为15年期,发行规模为20亿份基金份额。根据深交所深证上[2017]419号《终止上市通知书》,自2017年7月5日起,原基金久嘉终止上市,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,原《久嘉证券投资基金基金合同》终止,《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记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”)。

根据《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金集中申购结果暨原久嘉证券投资基金份额折算结果公告》,本基金以2017年8月3日为原基金久嘉的基金份额折算基准日,经基金管理人计算并经基金托管人复核的折算前基金份额净值为人民币0.9677元,精确到小数点后第9位为0.967689850(小数点后第10位舍去),本基金管理人按照0.967689850的折算比例对折算基准日登记在册的由原基金久嘉转型而来的本基金基金份额进行折算,折算后的基金份额净值为人民币1.0000元,折算后的基金份额数为折算前的基金份额数乘以折算比例,采用循环进位的方式保留到小数点后两位,由原基金久嘉基金份额折算后的基金份额总额为1,935,379,700.18份。基金管理人已根据上述折算比例,对各原基金久嘉份额持有人的基金份额进行了计算,并由登记机构进行投资人相应基金份额的过户登记。

本基金于基金合同生效后自2017年7月5日至2017年8月1日期间内开放集中申购,共募集人民币153,708,770.19元,其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息人民币68,710.05元,业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(2017)验字第60737541_H04

号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。上述集中申购募集资金已按基金份额净值 1.0000 元折合为 153,708,770.19 份基金份额。

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）、国债、金融债、次级债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、货币市场工具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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中投资具有创新成长主题相关的证券不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 7 月 5 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间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 日至 12 月 31 日。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 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；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值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方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值。

(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的基金资产净值的 1.50%的年费率计提；

(2) 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；

(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)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式为现金分红；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购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；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，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

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(以下简称“估值业务指引”),自2017年12月21日起,本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。相关估值技术变更对本基金2017年12月31日的基金资产净值及2017年会计期间净损益无重大影响。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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，资管产品管理人未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的除外。资管产品管理人

可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

7.4.6.3 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
中国农业银行	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 2017年7月5日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	212,621,915.69	4.84%

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本期未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本期未通过关联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 2017年7月5日(基金合同生效日)至2017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	198,015.08	4.84%	198,015.08	10.43%

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
	2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	9,699,077.89
其中：支付销售机构的客户维护费	591,772.78

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	1,806,306.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期末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
	2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2017)	44,988,500.00

年 7 月 5 日)持有的基金份额	
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-1,453,585.18
减: 期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	43,534,914.82
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.96%

注: 本基金转型日为 2017 年 7 月 5 日。本基金管理人转型前持有久嘉证券投资基金份额为 44,988,500.00 份, 于 2017 年 8 月 3 日按照 0.967689850 的比例折算, 折算后的长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金确权份额为 43,534,914.82 份。

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本基金其他关联方于本期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	
	2017 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	148,146,401.43	1,394,789.97

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管, 并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: 本基金于本期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 利润分配情况

注: 本基金合同于 2017 年 7 月 5 日生效, 本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.10 期末(2017 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.10.1.1 受限证券类别: 股票

金额单位: 人民币元

7.4.10.1.1 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	说明
002859	洁美	2017 年 3 月	2018 年 4	新股锁	29.82	33.80	16,665	198,780.12	563,277.00	-

	科技	24 日	月 9 日	定						
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

注：根据洁美科技 2017 年半年度权益分派实施公告，洁美科技以公司现有总股本 102,280,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送 4.00 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 15 股，除权除息日为 2017 年 9 月 15 日。本基金所持有的洁美科技获得转增股 9,999 股。

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	说明
123003	蓝思转债	2017/12/8	2018/1/17	新债未上市	100.00	100.00	917	91,700.00	91,700.00	-

7.4.10.2 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
300156	神雾环保	2017 年 7 月 17 日	重大事项停牌	23.68	2018 年 1 月 17 日	21.74	1,100,018	32,165,773.37	26,048,426.24	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	重大事项停牌	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项停牌	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11.1 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。

7.4.11.2 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 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 639,125,889.61 元,划分为第二层次的余额为人民币 54,480,881.44 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划分为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。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：久嘉证券投资基金

报告截止日：2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 7 月 4 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	349,815,688.12	205,222,739.52
结算备付金	1,157,410.97	2,300,601.82
存出保证金	728,543.13	391,336.93
交易性金融资产	1,638,143,223.64	1,844,411,598.82
其中：股票投资	1,231,308,278.64	1,411,970,314.02
基金投资	-	-
债券投资	406,834,945.00	432,441,284.80
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	-	-
应收利息	8,876,935.10	9,559,192.24
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,998,721,800.96	2,061,885,469.33
负债和所有者权益	本期末 2017 年 7 月 4 日	上年度末 2016 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	3,250.00	2,100.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	328,420.81	2,637,794.31
应付托管费	54,736.81	439,632.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,060,812.96	858,741.40
应交税费	6,609.30	6,609.30

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	471,444.63	359,000.00
负债合计	4,925,274.51	4,303,877.39
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	-6,203,473.55	57,581,591.94
所有者权益合计	1,993,796,526.45	2,057,581,591.94
负债和所有者权益总计	1,998,721,800.96	2,061,885,469.33

注：1) 报告截止日 2017 年 7 月 4 日(基金合同失效前日)，基金份额净值人民币 0.9969 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

2) 自 2017 年 7 月 5 日起，由《久嘉证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

7.2 利润表

会计主体：久嘉证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	15,325,711.64	-306,381,219.39
1. 利息收入	9,731,304.33	19,337,722.68
其中：存款利息收入	809,166.02	1,469,494.00
债券利息收入	8,730,691.92	17,797,228.58
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	191,446.39	71,000.10
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-65,430,224.98	62,446,837.38
其中：股票投资收益	-70,689,823.34	53,094,664.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-630.00	-1,757,648.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,260,228.36	11,109,821.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	71,024,632.29	-388,165,779.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	27,110,777.13	46,240,908.37
1. 管理人报酬	15,425,603.32	32,851,228.71
2. 托管费	2,570,933.93	5,475,204.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,625,515.92	5,930,569.57
5. 利息支出	-	71,118.06
其中：卖出回购金融资产支出	-	71,118.06
6. 其他费用	488,723.96	1,912,787.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-11,785,065.49	-352,622,127.76
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-11,785,065.49	-352,622,127.76

注：2017年7月4日为基金合同失效前日，本期是指2017年1月1日至2017年7月4日，上年度可比期间是指2016年1月1日至2016年12月31日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：久嘉证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年7月4日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年7月4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）	2,000,000,000.00	57,581,591.94	2,057,581,591.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,785,065.49	-11,785,065.49
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-52,000,000.00	-52,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	-6,203,473.55	1,993,796,526.45
项目	上年度可比期间 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）	2,000,000,000.00	886,203,719.70	2,886,203,719.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-352,622,127.76	-352,622,127.76
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-476,000,000.00	-476,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	57,581,591.94	2,057,581,591.94

注：2017 年 7 月 4 日为基金合同失效前日，本期是指 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日，上年度可比期间是指 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

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	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

久嘉证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监基金字[2002]11号文《关于同意久富证券投资基金上市、续期并扩募及久嘉证券投资基金设立的批复》的核准,由长城基金管理有限公司和西北证券有限责任公司作为发起人设立,发行规模为20亿份基金份额。本基金的基金合同生效日为2002年7月5日。本基金为契约型封闭式基金,存续期为15年。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上(2002)53号文审核同意,于2002年8月27日在深交所挂牌交易。本基金的基金管理人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(“中国农业银行”)。

根据中国证监会2017年4月13日证监许可[2017]516号文“关于准予久嘉证券投资基金变更注册的批复”、久嘉证券投资基金基金份额持有人大会2017年5月23日决议通过的《关于久嘉

证券投资基金转型有关事项的议案》及深交所深证上[2017]419 号《终止上市通知书》，自 2017 年 7 月 5 日起，本基金终止上市，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”，基金转型为契约型开放式，存续期限不定。原《久嘉证券投资基金基金合同》终止，《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。

本基金将投资于具有良好流动性和收益性的，国内依法公开发行的、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。基金的股票投资部分主要投资于成长型公司与价值型公司股票。

本基金的业绩比较基准为上证 A 股指数。

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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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。

根据《久嘉证券投资基金基金合同》的规定，本基金存续期至 2017 年 7 月 4 日。于 2017 年 7 月 5 日本基金由封闭式基金转为开放式基金，因此本基金本财务报表仍以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 2017 年 7 月 4 日(基金合同失效前日)的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日(基金合同失效前日)止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与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计除以下说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致：

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(以下简称“估值业务指引”)，自 2017 年 12 月 21 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。相关估值技术变更对本基金 2017 年 12 月 31 日的

基金资产净值及 2017 年会计期间净损益无重大影响。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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，资管产品管理

人未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的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

7.4.6.3 个人所得税

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

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

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国农业银行	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东
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 2017年1月1日至2017年7月4日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	23,907,857.41	0.43%	139,766,949.72	3.69%

7.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年7月4日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长城证券	-	-	130,000,000.00	44.83%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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7月4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	22,265.84	0.43%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	130,165.28	3.69%	34,950.46	4.07%

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 2017年1月1日至2017年7 月4日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	15,425,603.32
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：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，基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理费。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（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

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
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,570,933.93	5,475,204.74

注：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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2002 年 7 月 5 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	44,988,500.00	44,988,500.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	44,988,500.00	44,988,500.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.25%	2.25%

注：于 2017 年 7 月 4 日，长城基金管理有限公司运用固有资金投资于本基金的总份额为 44,988,500.00 份，其中：15,000,000.00 份作为发起人初始持有的份额，29,988,500.00 份是本基金设立以后增加持有的份额。

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。本基金发起人期末持有本基金份额的情况，具体详见 7.4.7.9。

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 2017年1月1日至2017年7月4日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	349,815,688.12	763,235.60	205,222,739.52	1,435,417.73

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并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：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资 形式 发放总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2017年4月 17日	2017年4月 18日	2017年4月 18日	0.2600	52,000,000.00	-	52,000,000.00	
合计	-	-	-	0.2600	52,000,000.00	-	52,000,000.00	

7.4.10 期末（2017年7月4日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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

7.4.10.1.1 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	说明
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年12月1日	新股锁定	8.03	40.10	26,007	208,836.21	1,042,880.70	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月20日	新股锁定	10.60	21.64	36,764	389,698.40	795,572.96	-
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年4月9日	新股锁定	29.82	73.70	6,666	198,780.12	491,284.20	-
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	-
603933	睿能	2017年6月	2017年7月	新股未上市	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

	科技	月 28 日	月 6 日	上市						
603757	大元泵业	2017 年 7 月 3 日	2017 年 7 月 11 日	新股未上市	22.42	22.42	744	16,680.48	16,680.48	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股未上市	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
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	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股未上市	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
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	-

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌股票

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
300145	中金环境	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	16.92	2017 年 10 月 31 日	17.11	4,600,007	61,196,829.61	77,832,118.44	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末(2017 年 7 月 4 日)止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元,无质押债券。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2017 年 7 月 4 日)止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元,无质押债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.11.1 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。

7.4.11.2 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、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 7 月 4 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 1,153,356,987.25 元,划分为第二层次的余额为人民币 484,786,236.39 元,无划分为第三层次的余额。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 1,329,612,429.79 元,划分为第二层次的余额为人民币 514,799,169.03 元,无划分为第三层次的余额。

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。

第三层级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（转型后）

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	665,213,737.45	63.48
	其中：股票	665,213,737.45	63.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,393,033.60	2.71
	其中：债券	28,393,033.60	2.71
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	200,014,420.02	19.09
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	151,304,299.68	14.44
8	其他各项资产	3,029,455.86	0.29
9	合计	1,047,954,946.61	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	924,000.00	0.10
B	采矿业	27,924,000.00	3.10
C	制造业	385,937,774.54	42.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,637,200.00	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	11,157,942.76	1.24
H	住宿和餐饮业	9,601,714.00	1.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,089,314.55	2.56
J	金融业	127,541,825.20	14.14
K	房地产业	6,545,000.00	0.73
L	租赁和商务服务业	41,220,500.00	4.57
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,464,000.00	0.72
R	文化、体育和娱乐业	7,122,000.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	665,213,737.45	73.76

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	000333	美的集团	1,100,000	60,973,000.00	6.76
2	601398	工商银行	9,300,000	57,660,000.00	6.39
3	601888	中国国旅	950,000	41,220,500.00	4.57
4	600201	生物股份	1,138,400	36,132,816.00	4.01
5	000895	双汇发展	1,321,450	35,018,425.00	3.88
6	600036	招商银行	1,200,000	34,824,000.00	3.86
7	300156	神雾环保	1,100,018	26,048,426.24	2.89
8	000858	五粮液	306,400	24,475,232.00	2.71
9	300145	中金环境	2,000,007	23,900,083.65	2.65
10	601336	新华保险	300,026	21,061,825.20	2.34

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601888	中国国旅	76,732,963.39	8.51
2	000333	美的集团	69,641,021.53	7.72
3	000895	双汇发展	66,741,153.40	7.40
4	601398	工商银行	63,863,000.00	7.08
5	600036	招商银行	62,269,183.40	6.90
6	000651	格力电器	57,964,810.70	6.43
7	601336	新华保险	56,253,530.45	6.24
8	601318	中国平安	55,010,557.50	6.10
9	600201	生物股份	48,635,134.47	5.39

10	002185	华天科技	41,749,703.32	4.63
11	000001	平安银行	40,088,506.56	4.45
12	300072	三聚环保	37,359,646.66	4.14
13	002508	老板电器	33,333,162.72	3.70
14	600426	华鲁恒升	32,802,157.44	3.64
15	600887	伊利股份	30,962,565.28	3.43
16	002217	合力泰	30,667,869.00	3.40
17	002372	伟星新材	29,644,775.24	3.29
18	002050	三花智控	29,501,289.90	3.27
19	000968	蓝焰控股	29,099,555.06	3.23
20	000063	中兴通讯	28,588,168.61	3.17
21	000858	五粮液	28,244,835.66	3.13
22	002078	太阳纸业	26,122,252.54	2.90
23	002572	索菲亚	25,658,068.95	2.85
24	601225	陕西煤业	23,281,501.66	2.58
25	600703	三安光电	22,073,487.45	2.45
26	000002	万科A	22,007,742.72	2.44
27	603801	志邦股份	21,097,120.23	2.34
28	603328	依顿电子	20,943,161.78	2.32
29	300182	捷成股份	20,064,031.48	2.22
30	002677	浙江美大	19,924,118.40	2.21
31	002128	露天煤业	19,865,531.00	2.20
32	601166	兴业银行	18,110,098.78	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000968	蓝焰控股	191,574,457.71	21.24
2	002508	老板电器	122,002,326.46	13.53
3	002185	华天科技	119,710,706.77	13.27
4	600885	宏发股份	101,029,400.81	11.20
5	600426	华鲁恒升	100,849,297.53	11.18
6	603898	好莱客	100,059,905.27	11.09
7	002677	浙江美大	69,278,469.95	7.68

8	000823	超声电子	68,945,339.24	7.64
9	002507	涪陵榨菜	64,972,390.93	7.20
10	002043	兔宝宝	56,246,531.00	6.24
11	600110	诺德股份	55,351,819.14	6.14
12	300156	神雾环保	53,724,868.00	5.96
13	000651	格力电器	51,984,690.50	5.76
14	300072	三聚环保	48,288,426.01	5.35
15	601318	中国平安	47,590,011.22	5.28
16	300138	晨光生物	44,179,612.65	4.90
17	601888	中国国旅	42,737,126.68	4.74
18	601155	新城控股	42,384,828.07	4.70
19	000001	平安银行	41,911,343.60	4.65
20	601336	新华保险	39,540,234.64	4.38
21	300145	中金环境	36,058,867.48	4.00
22	000895	双汇发展	32,387,214.02	3.59
23	600036	招商银行	32,291,956.00	3.58
24	002050	三花智控	30,955,360.98	3.43
25	000063	中兴通讯	30,789,820.96	3.41
26	002372	伟星新材	30,382,977.78	3.37
27	603626	科森科技	27,250,526.65	3.02
28	002078	太阳纸业	26,624,701.00	2.95
29	002572	索菲亚	25,053,029.00	2.78
30	600703	三安光电	22,669,407.80	2.51
31	603328	依顿电子	22,134,203.37	2.45
32	000002	万科A	22,104,535.90	2.45
33	603801	志邦股份	21,923,070.95	2.43
34	300182	捷成股份	20,608,047.02	2.29
35	300433	蓝思科技	20,496,122.40	2.27
36	300296	利亚德	19,041,303.69	2.11

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	1,912,127,797.13
卖出股票收入（成交）总额	2,482,551,475.04

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	27,628,970.00	3.06
	其中：政策性金融债	27,628,970.00	3.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	764,063.60	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,393,033.60	3.15

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	018002	国开 1302	273,500	27,628,970.00	3.06
2	110040	生益转债	3,150	341,082.00	0.04
3	110038	济川转债	3,120	331,281.60	0.04
4	123003	蓝思转债	917	91,700.00	0.01

注：报告期末本基金仅持有以上四只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

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

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内本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。

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,245,963.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,783,492.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,029,455.86

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	300156	神雾环保	26,048,426.24	2.89	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

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 投资组合报告（转型前）

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	1,231,308,278.64	61.60
	其中：股票	1,231,308,278.64	61.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,834,945.00	20.35
	其中：债券	406,834,945.00	20.35
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	350,973,099.09	17.56
8	其他资产	9,605,478.23	0.48
9	合计	1,998,721,800.96	100.00

8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	155,792,058.24	7.81
C	制造业	1,030,209,671.88	51.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	43,560,108.90	2.18
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	1,738,800.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	1,231,308,278.64	61.76

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	000968	蓝焰控股	10,700,004	155,792,058.24	7.81
2	603898	好莱客	3,194,779	113,286,863.34	5.68
3	600885	宏发股份	2,200,019	89,738,775.01	4.50
4	300145	中金环境	4,600,007	77,832,118.44	3.90
5	002508	老板电器	1,894,868	77,196,922.32	3.87
6	300156	神雾环保	2,380,794	76,304,447.70	3.83
7	000823	超声电子	5,200,032	76,076,468.16	3.82
8	002185	华天科技	10,500,018	75,075,128.70	3.77
9	600426	华鲁恒升	6,300,013	71,001,146.51	3.56
10	002043	兔宝宝	3,900,024	56,706,348.96	2.84

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	000968	蓝焰控股	156,513,969.67	7.61
2	603898	好莱客	110,133,600.30	5.35
3	002508	老板电器	99,525,037.81	4.84
4	300156	神雾环保	95,300,855.83	4.63
5	600885	宏发股份	95,073,644.63	4.62
6	000823	超声电子	93,972,644.13	4.57
7	002507	涪陵榨菜	91,427,435.62	4.44

8	002185	华天科技	75,903,108.56	3.69
9	300129	泰胜风能	73,485,333.29	3.57
10	002833	弘亚数控	71,615,509.15	3.48
11	600452	涪陵电力	71,476,507.27	3.47
12	600426	华鲁恒升	69,153,671.08	3.36
13	600803	新奥股份	68,123,389.91	3.31
14	300296	利亚德	65,054,341.34	3.16
15	600110	诺德股份	63,997,640.11	3.11
16	002043	兔宝宝	63,427,946.55	3.08
17	300415	伊之密	54,818,298.63	2.66
18	300138	晨光生物	53,848,069.90	2.62
19	600109	国金证券	53,085,265.04	2.58
20	300145	中金环境	51,510,669.01	2.50
21	000983	西山煤电	46,719,097.67	2.27
22	300323	华灿光电	45,626,410.09	2.22
23	002677	浙江美大	44,656,169.00	2.17

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	600803	新奥股份	68,771,802.45	3.34
2	600109	国金证券	64,691,492.18	3.14
3	002833	弘亚数控	64,153,259.60	3.12
4	600452	涪陵电力	60,737,609.86	2.95
5	600987	航民股份	53,941,707.80	2.62
6	000513	丽珠集团	52,619,558.54	2.56
7	300415	伊之密	50,548,663.19	2.46
8	300323	华灿光电	50,320,816.79	2.45
9	000963	华东医药	49,427,276.33	2.40
10	300129	泰胜风能	49,186,768.76	2.39
11	000722	湖南发展	44,896,264.52	2.18
12	002376	新北洋	42,963,084.14	2.09
13	000983	西山煤电	41,950,489.55	2.04
14	300296	利亚德	40,034,640.27	1.95
15	600519	贵州茅台	38,452,669.69	1.87
16	002008	大族激光	37,733,746.96	1.83

17	002507	涪陵榨菜	37,122,136.48	1.80
18	300197	铁汉生态	36,913,794.80	1.79
19	600566	济川药业	36,671,263.39	1.78
20	002245	澳洋顺昌	34,407,123.96	1.67

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	2,711,212,840.53
卖出股票收入（成交）总额	2,903,316,154.26

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	159,744,000.00	8.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	247,090,945.00	12.39
	其中：政策性金融债	247,090,945.00	12.39
4	企业债券	-	-
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	-	-
10	合计	406,834,945.00	20.41

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010107	21 国债(7)	1,560,000	159,744,000.00	8.01
2	150210	15 国开 10	1,200,000	119,136,000.00	5.98
3	130231	13 国开 31	1,000,000	99,820,000.00	5.01
4	018002	国开 1302	273,500	28,134,945.00	1.41

注：报告期末本基金仅持有以上四只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：报告期末（2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）），本基金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：报告期末（2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）），本基金未持有贵金属投资。

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：报告期末（2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）），本基金未持有权证。

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：报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）），本基金未参与股指期货交易。

8.10.2 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。

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

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：报告期内（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日（基金合同失效前日）），本基金未参与国债期货交易。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内本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。

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	728,543.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,876,935.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,605,478.23

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	300145	中金环境	77,832,118.44	3.90	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

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（转型后）

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
13,482	65,111.88	414,713,524.86	47.24%	463,124,827.08	52.76%

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	96.88	0.0000%

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。

§ 9 基金份额持有人信息（转型前）

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
13,793	145,001.09	1,167,586,931.00	58.38%	832,413,069.00	41.62%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国人寿保险股份有限公司	127,171,940.00	6.36%
2	泰康人寿保险有限责任公司－传统－普通保险产品-019L-CT001 深	92,423,204.00	4.62%
3	中国人寿资产管理有限公司	78,937,681.00	3.95%
4	伦敦市投资管理有限公司－客户资金	73,861,275.00	3.69%
5	建信人寿保险股份有限公司－普通	63,522,122.00	3.18%
6	泰康人寿保险有限责任公司－万能－个险万能	57,810,859.00	2.89%
7	长城基金管理有限公司	44,988,500.00	2.25%
8	姜国华	43,990,082.00	2.20%
9	中国太平洋财产保险－传统－普通保险产品-013C-CT001 深	41,899,910.00	2.09%
10	农银人寿保险股份有限公司－传统－普通保险产品	40,654,007.00	2.03%

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日（2017年7月5日）基金份额总额	2,000,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	646,650,401.84
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,704,191,750.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-64,620,299.82
本报告期期末基金份额总额	877,838,351.94

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人以通讯方式组织召开了久嘉证券投资基金基金份额持有人大会，于 2017 年 5 月 23 日表决通过了《关于久嘉证券投资基金转型有关事项的议案》：根据转型业务安排向深圳证券交易所申请终止基金久嘉的上市交易；久嘉证券投资基金的名称变更为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金，基金的运作方式由封闭式转为开放式，基金存续期变更为不定期，对基金的投资目标、投资范围和投资策略做适当调整，并对基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件做适当修订，具体内容详见本管理人于 2017 年 5 月 24 日发布的《久嘉证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。

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

本报告期内基金管理人无重大人事变动。自 2018 年 02 月 13 日起，桑煜先生不再担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

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

根据久嘉证券投资基金基金份额持有人大会决议，久嘉证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金，调整了投资目标、范围和策略。自 2017 年 07 月 05 日起，由《久嘉证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

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、久嘉证券投资基金本报告期审计费为六万元，长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金本报告期审计费为五万元。
- 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 9 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（转型后）**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	3	212,621,915.69	4.84%	198,015.08	4.84%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	714,020,656.21	16.26%	664,967.16	16.26%	-
广发证券	2	492,656,820.20	11.22%	458,811.58	11.22%	-
长江证券	1	651,061,710.30	14.82%	606,332.38	14.82%	-
申万宏源	2	180,664,300.69	4.11%	168,252.36	4.11%	-
中银国际	1	65,832,301.44	1.50%	61,309.71	1.50%	-
光大证券	1	121,123,545.75	2.76%	112,801.74	2.76%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	1,954,329,215.65	44.49%	1,820,069.70	44.49%	-

注：1、本报告期内共新增 31 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	100,000,000.00	0.82%	-	-

长江证券	59,273,787.00	32.42%	3,820,000,000.00	31.21%	-	-
申万宏源	122,819,318.40	67.17%	3,650,000,000.00	29.82%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	570,900,000.00	4.66%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	748,070.00	0.41%	4,100,000,000.00	33.49%	-	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	11,587,101,688.07	28.29%	1,478,065.18	28.29%	-
国泰君安	2	1,024,248,686.44	18.26%	953,884.23	18.26%	-
国信证券	2	899,542,583.23	16.03%	837,745.40	16.03%	-
招商证券	2	654,253,302.67	11.66%	609,306.96	11.66%	-
中信证券	2	581,060,963.83	10.36%	541,143.94	10.36%	-
中信建投	1	399,145,923.83	7.12%	371,722.72	7.11%	-
西南证券	1	269,969,096.94	4.81%	251,422.83	4.81%	-
中银国际	1	163,121,689.86	2.91%	151,915.68	2.91%	-
长城证券	3	23,907,857.41	0.43%	22,265.84	0.43%	-
银河证券	2	7,568,650.00	0.13%	7,048.74	0.13%	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：本报告期内无变化。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，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	15,500,759.60	100.00%	100,000,000.00	37.04%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	170,000,000.00	62.96%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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（转型后）

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170926-20171129	14,601,333.77	291,685,176.20	161,944,934.97	144,341,575.00	16.4428%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

注：封闭式基金久嘉证券投资基金于 2017 年 7 月 5 日转型为开放式基金长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金，上表投资者机构 1 转型前持有基金份额为 15,088,857.00 份，按 0.967689850 比例折算后的确权份额为 14,601,333.77 份，期初份额为确权后份额，在 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 7 月 4 日期间（转型前）该投资者持有基金份额比例未达到 20%。

12.2 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。