

# 长城久兆中小板 300 指数分级 证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 03 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的境内股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	57
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.....	57

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 .....	57
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 .....	57
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
8.12	投资组合报告附注 .....	57
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	59
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	60
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4	基金投资策略的改变 .....	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8	其他重大事件 .....	65
<b>§12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>70</b>
12.1	备查文件目录 .....	70
12.2	存放地点 .....	71
12.3	查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级		
基金主代码	162010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 1 月 30 日		
基金管理人	长城基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	26,844,377.77 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 2 月 21 日		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金的场内简称	长城久兆	中小 300A	中小 300B
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	18,110,052.77 份	3,493,730.00 份	5,240,595.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板 300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内,年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板 300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

	高收益产品。		
--	--------	--	--

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518026	100033
法定代表人		何伟	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
注册登记机构	中国证券登记结算公司深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	-4,364,973.32	-2,338,250.41	10,128,545.88
本期利润	-7,636,674.89	-6,002,767.86	9,280,452.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2609	-0.1073	0.2887
本期加权平均净值利润率	-23.88%	-10.55%	27.29%
本期基金份额净值增长率	-19.66%	47.33%	13.98%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
期末可供分配利润	7,204,380.45	11,899,980.41	8,793,195.70
期末可供分配基金份额利润	0.2684	0.4256	0.1826
期末基金资产净值	28,631,394.12	37,451,426.10	54,724,004.37
期末基金份额净值	1.067	1.340	1.137
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>	<b>2014 年末</b>
基金份额累计净值增长率	41.10%	75.64%	19.21%

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

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

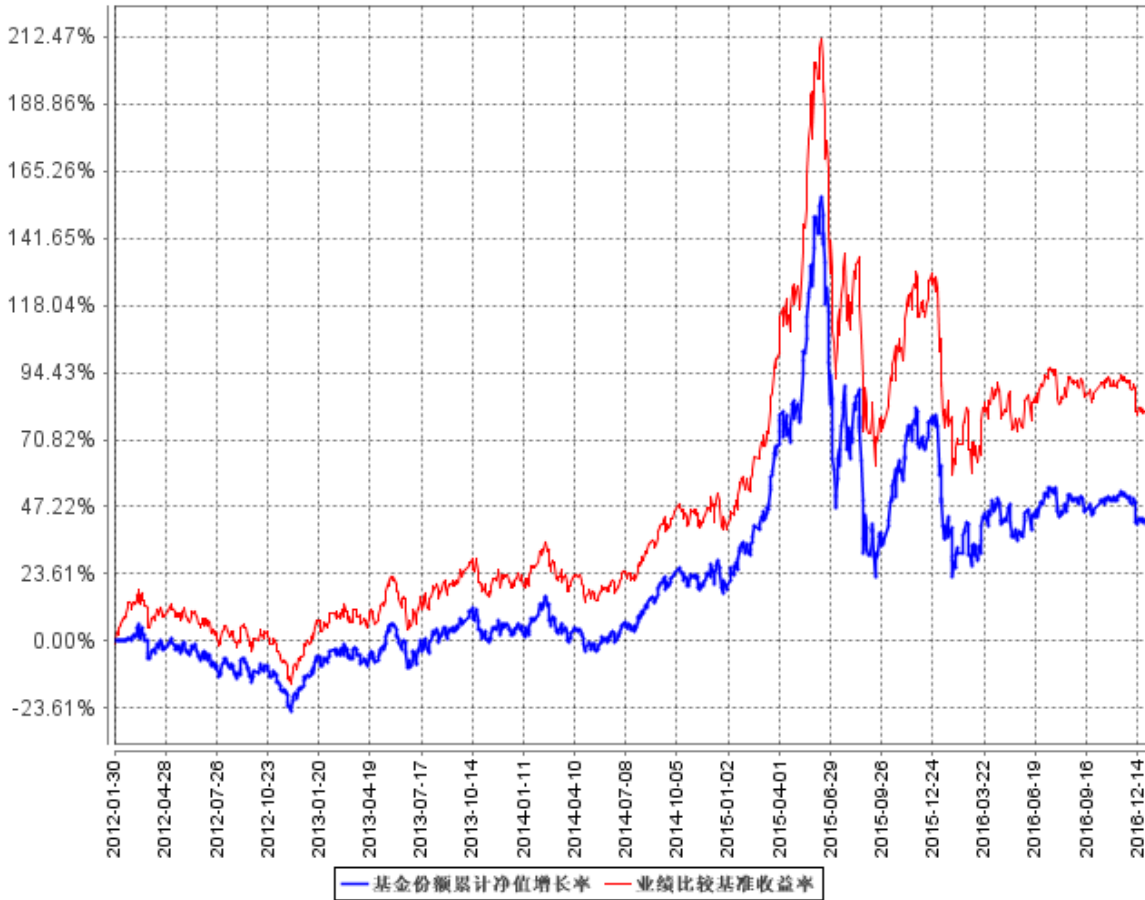
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.53%	0.79%	-3.93%	0.80%	0.40%	-0.01%
过去六个月	-4.99%	0.90%	-5.51%	0.89%	0.52%	0.01%
过去一年	-19.66%	1.82%	-19.82%	1.80%	0.16%	0.02%
过去三年	34.91%	2.06%	47.11%	1.94%	-12.20%	0.12%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	41.10%	1.81%	79.58%	1.74%	-38.48%	0.07%

### 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

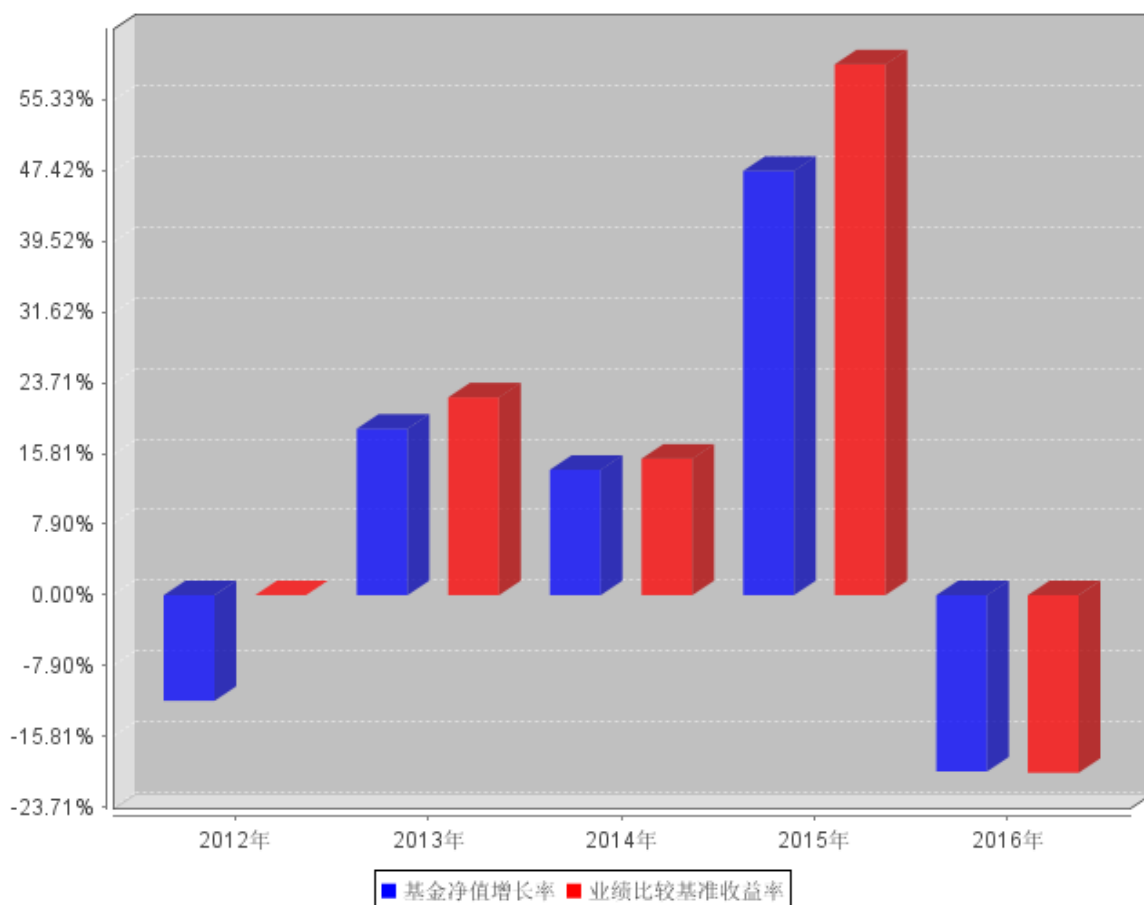


注：本基金合同规定本基金投资组合为：本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90% 的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 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比较

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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

## § 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		
余礼冰	长城久兆中小板 300 指数分级基金的基金经理	2012 年 4 月 17 日	-	15 年	女，中国籍，华中理工大学工学硕士。曾就职于富国基金、宝盈基金、友邦华泰基金等，2007 年加入长城基金管理有限公司，曾任研究部副总经理。2012 年 1 月至 2012 年 4 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资

					基金”基金经理助理，自 2012 年 4 月至今任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”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》、《长城久兆中小板 300 指数分级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

我们在报告期内严格遵守基金合同，通过投资约束和数量化控制，以中小板 300（价格）指数成分股为投资组合，采取完全复制策略，紧密跟踪指数走势，缩小跟踪误差。并采用程序化管理和人工管理的方式，处理基金日常运作中出现的基金规模流动性需求、组合偏差调整、风险平衡等事件，将本基金的跟踪误差控制在合理范围，使本基金成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

### 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-19.66%，本基金比较基准收益率为-19.82%。本报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 之内，年化跟踪误差控制在 4% 之内。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年 A 股市场全年下跌幅度较大，上证综指和沪深 300 指数分别下跌了-12.3%、-11.3%；创业板指数和中小板指数分别下跌了-27.7%、-22.9%，久兆分级基金跟踪的标的指数中小 300（价格）指数下跌了-20.9%。

国内市场，从经济基本面看，年底 12 月全国制造业 PMI 回落至 51.4，但仍在扩张区间。其中新订单指标高位走平于 53.2，指向内需仍相对稳定。从中观看，虽然下游地产、汽车需求已现回落，但前期有旺盛带动了中游水泥、化工、机械等行业需求回暖。生产指标回落至 53.3，是 PMI 回落的主因之一，表示生产扩张略有放缓，与 12 月发电耗煤增速小幅回落相印证。库存指标中，原材料、产成品库存双双回落，中小企业原材料补库存意愿或仍不足。预计 12 月 CPI 食品价格环涨 0.9%，受高基数影响 12 月 CPI 或小降至 2.2%。12 月 PMI 原材料购进价格创 11 年以来新高至 69.6，印证 12 月国内生资价格大涨，预测 12 月 PPI 环比继续上涨，通胀风险可控。流动性方面，我们预测货币利率稳定。

政策方面，习主席发表讲话称，2017 年是全面深化改革向纵深推进的关键一年，要加强对国企、财税、金融、土地、城镇化、社会保障、生态文明、对外开放等基础性重大改革的推进，抓好已出台改革方案的落地生根。习主席发表新年贺词，称 16 年对中国人民来说，是非凡的一年，“十三五”实现了开门红。即将到来的 2017 年，中国共产党将召开第十九次全国代表大会，全面

建成小康社会、全面深化改革、全面依法治国、全面从严治党要继续发力。

我们认为 A 股市场长期引来改革红利的基础已经具备，但中短期内震荡格局在 17 年将大概率继续演绎。中小板 300 指数做为新兴产业和大消费占比较高的市场代表性指数将受益改革和转型，长城久兆中小板 300 指数分级基金做为交易型投资工具，适合于投资者做为交易品种投资。我们将通过对基金合同的严格遵守，对跟踪误差的严格控制，将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监控和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

##### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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

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

##### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定：

本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2016 年 1 月 4 日起至 2016 年 2 月 25 日止连续 36 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元；自 2016 年 3 月 2 日起至 2016 年 5 月 20 日止连续 56 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元；自 2016 年 5 月 25 日起至 2016 年 8 月 3 日止连续 49 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元；自 2016 年 8 月 8 日起至 2016 年 10 月 25 日止连续 50 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元；自 2016 年 10 月 31 日起至 2016 年 12 月 30 日止连续 45 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》，本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第60737541_H14号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长城基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	乌爱莉
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	



会计师事务所的地址	中国北京
审计报告日期	2017 年 3 月 23 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,383,249.64	962,973.09
结算备付金		-	-
存出保证金		1,034.05	77,812.09
交易性金融资产	7.4.7.2	27,378,900.66	37,191,338.36
其中：股票投资		27,378,900.66	37,191,338.36
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	332.80	476.09
应收股利		-	-
应收申购款		1,108.67	3,462.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		28,764,625.82	38,236,062.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		12,400.37	585,521.21

应付管理人报酬		24,950.31	34,854.91
应付托管费		5,489.04	7,668.08
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	368.66	14,521.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	90,023.32	142,070.78
负债合计		133,231.70	784,636.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	20,299,917.77	21,323,709.39
未分配利润	7.4.7.10	8,331,476.35	16,127,716.71
所有者权益合计		28,631,394.12	37,451,426.10
负债和所有者权益总计		28,764,625.82	38,236,062.35

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，长城久兆中小板 300 指数分级份额净值人民币 1.067 元，长城中小 300A 指数的参考份额净值人民币 1.054 元，长城中小 300B 指数的参考份额净值人民币 1.075 元。基金份额总额为 26,844,377.77 份，其中长城久兆中小板 300 指数分级份额 18,110,052.77 份，长城中小 300A 指数份额 3,493,730.00 份，长城中小 300B 指数份额 5,240,595.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-6,738,805.51	-4,108,374.17
1.利息收入		23,567.50	42,366.76
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,556.08	42,343.84
债券利息收入		11.42	22.92
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）		-3,614,482.63	-841,621.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,821,808.12	-1,143,999.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,764.90	17,737.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	203,560.59	284,640.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,271,701.57	-3,664,517.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	123,811.19	355,397.57
<b>减：二、费用</b>		897,869.38	1,894,393.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	320,374.14	562,990.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	70,482.20	123,857.93
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	54,388.04	752,707.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	452,625.00	454,837.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,636,674.89	-6,002,767.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,636,674.89	-6,002,767.86

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

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）	21,323,709.39	16,127,716.71	37,451,426.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,636,674.89	-7,636,674.89
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）	-1,023,791.62	-159,565.47	-1,183,357.09
其中：1. 基金申购款	70,298,254.46	28,286,955.64	98,585,210.10

2. 基金赎回款	-71,322,046.08	-28,446,521.11	-99,768,567.19
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）	20,299,917.77	8,331,476.35	28,631,394.12
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）	45,930,808.67	8,793,195.70	54,724,004.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,002,767.86	-6,002,767.86
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）	-24,607,099.28	13,337,288.87	-11,269,810.41
其中：1. 基金申购款	137,451,442.32	140,227,257.48	277,678,699.80
2. 基金赎回款	-162,058,541.60	-126,889,968.61	-288,948,510.21
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）	21,323,709.39	16,127,716.71	37,451,426.10

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

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可【2011】1474 号文“关于核准长城久兆中小板 300 指数分级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向社会公开发行募集，首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。基金合同于 2012 年 01

月 30 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）。

本基金的基金份额包括长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“久兆 300 份额”）、“久兆稳健份额”与“久兆积极份额”。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为久兆 300 份额；场内认购的全部份额将按照基金合同约定比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。久兆 300 份额设置单独的基金代码，只接受场外与场内申购和赎回；久兆稳健份额、久兆积极份额交易代码不同，只上市交易，不接受申购和赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及基金合同等法律文件的规定，长城基金管理有限公司决定自 2015 年 6 月 8 日起将长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由“久兆稳健”（代码：150057）变更为“中小 300A”，将长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称“久兆积极”（代码：150058）变更为“中小 300B”。

本基金四份中小 300A 份额与六份中小 300B 份额的参考净值之和将等于十份久兆 300 份额的净值。中小 300A 份额的约定收益率为 5.8%。中小 300A 份额的约定收益率除以 365 得到中小 300A 份额的约定日简单收益率。中小 300A 份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用中小 300A 份额的约定日简单收益率单利进行计算。计算出中小 300A 份额的份额参考净值后，根据久兆 300 份额、中小 300A 份额、中小 300B 份额净值的关系，可以计算出中小 300B 份额的份额参考净值。

定期份额折算：自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止，本基金将按照基金合同规定进行基金的定期份额折算。本基金进行定期份额折算后，中小 300A 份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆 300 份额分配给中小 300A 份额持有人，中小 300A 份额的份额参考净值调整为 1.000 元；久兆 300 份额持有人持有的每十份久兆 300 份额将按四份中小 300A 份额获得新增久兆 300 份额的分配，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。

经过定期份额折算，久兆 300 份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，中小 300B 份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

不定期份额折算：本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或中小 300B

份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照基金合同规定进行基金的不定期份额折算。

当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。不定期份额折算后，持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应增加，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。持有人持有的中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额数在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

当中小 300B 份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应减少，中小 300B 份额持有人持有的中小 300B 份额数按照中小 300B 份额的折算比例相应减少。为保持中小 300A 份额和中小 300B 份额比例不变，中小 300A 份额的折算比例与中小 300B 份额相同，中小 300A 份额持有人持有的中小 300A 份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

本基金的业绩比较基准为：中小板 300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

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

##### （2）金融负债分类

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

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

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

##### 后续计量

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

##### 终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

##### 金融资产转移

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一



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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变

动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率逐日计提；
- (3) 在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率逐日计提。当本基金在某个季度的指数使用许可费不足 5 万元的收取下限时，本基金在该季度实际的指数使用许可费率将高于 0.02%。

基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。

- (4) 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；

- (5) 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**

本基金（包括久兆 300 份额、中小 300A 份额、中小 300B 份额）不进行收益分配。经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后如果终止中小 300A 份额与中小 300B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### **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**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

#### 1. 印花税

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

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2. 营业税、增值税、企业所得税

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

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

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

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

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

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

品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

### 3. 个人所得税

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,383,249.64	962,973.09
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,383,249.64	962,973.09

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		33,919,737.16	27,378,900.66	-6,540,836.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		33,919,737.16	27,378,900.66	-6,540,836.50
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		40,460,473.29	37,191,338.36	-3,269,134.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		40,460,473.29	37,191,338.36	-3,269,134.93

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均未持有因买断式逆回购交易获得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	332.25	437.59
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	0.55	38.50
合计	332.80	476.09

注：其他为应收结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	368.66	14,521.27
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	368.66	14,521.27

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	23.32	2,070.78
预提审计费用	40,000.00	90,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	90,023.32	142,070.78

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	27,957,708.32	21,323,709.39
本期申购	1,627,914.69	1,241,753.27
本期赎回 (以“-”号填列)	-1,366,173.29	-1,041,880.17
2016 年 1 月 29 日 基金拆分/份额折算前	28,219,449.72	21,523,582.49
基金拆分/份额折算变动份额	251,265.82	-
本期申购	91,329,348.66	69,056,501.19
本期赎回 (以“-”号填列)	-92,955,686.43	-70,280,165.91
本期末	26,844,377.77	20,299,917.77

注：1、根据长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2016 年 1 月 29 日为份额折算日，对久兆 300 份额的场外份额、场内份额和久兆稳健份额实施定期份额折算。

2、本基金本报告期申购包含基金转入的份额及金额，本期赎回包含基金转出的份额及金额。

3、根据《基金合同》规定：长城久兆中小板 300 指数分级份额只接受场外与场内申购和赎回；长城中小 300A 指数份额和长城中小 300B 指数份额只上市交易，不接受申购和赎回，因此上表不再单独披露长城中小 300A 指数份额和长城中小 300B 指数份额的情况。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,899,980.41	4,227,736.30	16,127,716.71
本期利润	-4,364,973.32	-3,271,701.57	-7,636,674.89
本期基金份额交易产生的变动数	-330,626.64	171,061.17	-159,565.47
其中：基金申购款	31,608,172.51	-3,321,216.87	28,286,955.64
基金赎回款	-31,938,799.15	3,492,278.04	-28,446,521.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,204,380.45	1,127,095.90	8,331,476.35

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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



活期存款利息收入	22,725.45	37,639.98
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	227.81	3,487.79
其他	602.82	1,216.07
合计	23,556.08	42,343.84

注：其他，2016 年度为申购款利息收入人民币 461.93 元以及结算保证金利息收入人民币 140.89 元；2015 年度为申购款利息收入人民币 35.28 元、结算保证金利息收入人民币 1,180.79 元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	18,803,608.03	250,430,905.15
减：卖出股票成本总额	22,625,416.15	251,574,904.50
买卖股票差价收入	-3,821,808.12	-1,143,999.35

#### 7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,676.32	42,966.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,900.00	25,200.00
减：应收利息总额	11.42	28.44
买卖债券差价收入	3,764.90	17,737.56

##### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券产生的收益/损失。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

##### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益/损失。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	203,560.59	284,640.74
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	203,560.59	284,640.74

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,271,701.57	-3,664,517.45
——股票投资	-3,271,701.57	-3,658,532.95
——债券投资	-	-5,984.50
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-3,271,701.57	-3,664,517.45

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	123,793.94	354,499.83
转出基金补偿收入	17.25	897.74
合计	123,811.19	355,397.57

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

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

交易所市场交易费用	54,388.04	752,707.67
银行间市场交易费用	-	-
合计	54,388.04	752,707.67

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	150,000.00	150,000.00
银行费用	2,625.00	4,837.81
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
合计	452,625.00	454,837.81

#### 7.4.7.21 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2017 年 1 月 29 日为份额折算日，对长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“长城久兆”）的场外份额、场内份额和长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额（简称“中小 300A”）实施定期份额折算，份额折算结果如下：

2017 年 1 月 26 日，长城久兆的场外份额经折算后的份额数采用四舍五入的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产；长城久兆的场内份额、中小 300A 份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产。份额折算比例四舍五入精确到小数点后第 9 位。

基金份额名称	折算前份额	新增份额 折算比例	折算后份额	折算后 基金 份额净值	折算后基金 份额累计净值
长城久兆场外份额	16,504,751.56	0.022521221	16,876,436.44	1.024	1.764
长城久兆场内份额	1,490,308.00	0.022521221	1,720,698.00	1.024	1.764
中小 300A 份额	3,495,854.00	0.056303054	3,495,854.00	1.000	1.290

投资者自公告之日起可查询经注册登记人及本公司确认的折算后份额。

自 2017 年 2 月 6 日起，本基金恢复申购、赎回、转托管（包括场外转托管和跨系统转托管）和配对转换业务，中小 300A 在深圳证券交易所复牌。

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项、份额折算及在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均未产生应付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	320,374.14	562,990.28
其中：支付销售机构的客户维护费	99,260.50	107,389.82

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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 24,950.31 元。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,482.20	123,857.93

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 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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 5,489.04 元。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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

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

注：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
中国建设银行	1,383,249.64	22,725.45	962,973.09	37,639.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：根据法律法规的规定及《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金（包括久兆 300 份额、中小 300A 份额、中小 300B 份额）不进行收益分配。

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

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	8.27	-	-	21,562	391,693.09	178,317.74	-
002400	省广股份	2016 年 11 月 28 日	重大事项停牌	13.79	-	-	9,954	205,424.28	137,265.66	-
002075	沙钢股	2016 年 9 月 13 日	重大事项停牌	16.12	-	-	7,800	112,008.00	125,736.00	-

	份	月 19 日	停牌								
002491	通鼎互 联	2016 年 12 月 22 日	重大事项 停牌	15.54	2017 年 1 月 03 日	15.89	6,300	104,706.00	97,902.00	-	
002462	嘉事堂	2016 年 9 月 28 日	重大事项 停牌	42.53	2017 年 1 月 12 日	38.98	2,200	82,280.00	93,566.00	-	
002602	世纪华 通	2016 年 12 月 15 日	重大事项 停牌	46.89	2017 年 1 月 9 日	50.00	1,900	36,955.00	89,091.00	-	
002440	闰土股 份	2016 年 10 月 24 日	重大事项 停牌	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	4,614	93,919.16	75,392.76	-	
002025	航天电 器	2016 年 9 月 12 日	重大事项 停牌	25.20	-	-	2,820	72,655.87	71,064.00	-	
002396	星网锐 捷	2016 年 9 月 12 日	重大事项 停牌	18.27	2017 年 2 月 21 日	18.35	3,526	96,987.33	64,420.02	-	
002156	通富微 电	2016 年 12 月 28 日	重大事项 停牌	11.38	2017 年 1 月 5 日	11.65	5,525	74,685.95	62,874.50	-	
002151	北斗星 通	2016 年 11 月 16 日	重大事项 停牌	31.90	2017 年 1 月 12 日	31.00	1,793	77,532.56	57,196.70	-	
002297	博云新 材	2016 年 6 月 20 日	重大事项 停牌	13.09	2017 年 1 月 4 日	13.40	3,966	67,678.70	51,914.94	-	
002681	奋达科 技	2016 年 12 月 19 日	重大事项 停牌	12.93	-	-	3,640	62,562.33	47,065.20	-	
002071	长城影 视	2016 年 6 月 16 日	重大事项 停牌	13.64	2017 年 1 月 3 日	15.00	3,206	64,126.57	43,729.84	-	

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险,是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。期末除 7.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的可回购交易债券的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。



本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款及存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,383,249.64	-	-	-	-	-	1,383,249.64
存出保证金	1,034.05	-	-	-	-	-	1,034.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-27,378,900.66	27,378,900.66
应收利息	-	-	-	-	-	332.80	332.80
应收申购款	-	-	-	-	-	1,108.67	1,108.67
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,384,283.69	-	-	-	-	-27,380,342.13	28,764,625.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,400.37	12,400.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,950.31	24,950.31
应付托管费	-	-	-	-	-	5,489.04	5,489.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	368.66	368.66
其他负债	-	-	-	-	-	90,023.32	90,023.32
负债总计	-	-	-	-	-	133,231.70	133,231.70
利率敏感度缺口	1,384,283.69	-	-	-	-	-	
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	962,973.09	-	-	-	-	-	962,973.09
存出保证金	77,812.09	-	-	-	-	-	77,812.09

交易性金融资产	-	-	-	-	-	37,191,338.36	37,191,338.36
应收利息	-	-	-	-	-	476.09	476.09
应收申购款	-	-	-	-	-	3,462.72	3,462.72
资产总计	1,040,785.18	-	-	-	-	37,195,277.17	38,236,062.35
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	585,521.21	585,521.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,854.91	34,854.91
应付托管费	-	-	-	-	-	7,668.08	7,668.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,521.27	14,521.27
其他负债	-	-	-	-	-	142,070.78	142,070.78
负债总计	-	-	-	-	-	784,636.25	784,636.25
利率敏感度缺口	1,040,785.18	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度期末均未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300(价格)指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金本报告期末面临的整体其他价格风险列示如下：

### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	27,378,900.66	95.63	37,191,338.36	99.31
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	27,378,900.66	95.63	37,191,338.36	99.31

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	1,869,484.69	2,212,884.63
	沪深 300 指数下降 5%	-1,869,484.69	-2,212,884.63

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

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

### 7.4.14.2 其他事项

#### (1) 公允价值

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

### 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 26,183,364.30 元, 划分为第二层次的余额为人民币 1,195,536.36 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 33,578,544.99 元, 划分为第二层次的余额为人民币 3,612,793.37 元, 无划分为第三层次余额。

### 公允价值所属层次间重大变动

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

### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

(2) 截至资产负债表日, 本基金的资产净值为人民币 28,631,394.12 元, 已连续超过 45 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。

(3) 除上述事项外, 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	27,378,900.66	95.18
	其中: 股票	27,378,900.66	95.18
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	1,383,249.64	4.81

7	其他各项资产	2,475.52	0.01
8	合计	28,764,625.82	100.00

## 8.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

### 8.2.1 期末指数投资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	474,184.20	1.66
B	采矿业	140,136.45	0.49
C	制造业	18,415,167.92	64.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,309.31	0.45
E	建筑业	876,984.84	3.06
F	批发和零售业	1,145,466.10	4.00
G	交通运输、仓储和邮政业	57,284.24	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,593,424.42	9.06
J	金融业	1,045,020.64	3.65
K	房地产业	238,263.67	0.83
L	租赁和商务服务业	523,941.49	1.83
M	科学研究和技术服务业	45,054.24	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	118,236.96	0.41
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	514,696.84	1.80
S	综合	-	-
	合计	26,316,171.32	91.91

### 8.2.2 期末积极投资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	83,545.00	0.29
C	制造业	726,544.94	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	120,591.40	0.42
F	批发和零售业	46,562.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	41,800.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,804.00	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	24,882.00	0.09
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	1,062,729.34	3.71

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002450	康得新	26,079	498,369.69	1.74
2	002415	海康威视	19,474	463,675.94	1.62
3	002024	苏宁云商	39,849	456,271.05	1.59

4	002304	洋河股份	5,843	412,515.80	1.44
5	002673	西部证券	15,550	322,973.50	1.13
6	002142	宁波银行	17,632	293,396.48	1.02
7	002594	比亚迪	5,808	288,541.44	1.01
8	002736	国信证券	18,338	285,155.90	1.00
9	002202	金风科技	16,461	281,647.71	0.98
10	002739	万达院线	5,000	270,350.00	0.94
11	002456	欧菲光	7,852	269,166.56	0.94
12	002230	科大讯飞	9,336	252,912.24	0.88
13	002241	歌尔股份	8,823	233,985.96	0.82
14	002065	东华软件	9,847	229,435.10	0.80
15	002252	上海莱士	9,736	224,804.24	0.79
16	002466	天齐锂业	6,771	219,718.95	0.77
17	002007	华兰生物	5,980	213,785.00	0.75
18	002236	大华股份	15,230	208,346.40	0.73
19	002313	日海通讯	8,710	202,943.00	0.71
20	002008	大族激光	8,817	199,264.20	0.70
21	002475	立讯精密	8,841	183,450.75	0.64
22	002129	中环股份	21,562	178,317.74	0.62
23	002310	东方园林	12,333	174,511.95	0.61
24	002085	万丰奥威	8,508	168,118.08	0.59
25	002405	四维图新	8,456	163,623.60	0.57
26	002183	怡亚通	14,916	161,987.76	0.57
27	002385	大北农	21,641	153,651.10	0.54
28	002572	索菲亚	2,700	146,232.00	0.51
29	002340	格林美	22,078	144,610.90	0.51
30	002500	山西证券	11,938	143,494.76	0.50
31	002407	多氟多	5,190	141,635.10	0.49
32	002460	赣锋锂业	5,298	140,449.98	0.49
33	002092	中泰化学	11,407	138,024.70	0.48
34	002400	省广股份	9,954	137,265.66	0.48
35	002081	金螳螂	13,969	136,756.51	0.48
36	002074	国轩高科	4,404	136,479.96	0.48
37	002508	老板电器	3,633	133,694.40	0.47
38	002030	达安基因	5,508	127,785.60	0.45
39	002075	沙钢股份	7,800	125,736.00	0.44
40	002038	双鹭药业	4,653	124,281.63	0.43
41	002292	奥飞娱乐	5,459	123,919.30	0.43
42	002266	浙富控股	21,334	122,883.84	0.43

43	002049	紫光国芯	3,729	122,833.26	0.43
44	002176	江特电机	10,142	120,994.06	0.42
45	002168	深圳惠程	7,567	120,012.62	0.42
46	002179	中航光电	3,268	118,595.72	0.41
47	002426	胜利精密	14,308	118,327.16	0.41
48	002573	清新环境	6,768	118,236.96	0.41
49	002701	奥瑞金	13,543	117,011.52	0.41
50	002470	金正大	14,734	116,398.60	0.41
51	002422	科伦药业	7,176	115,677.12	0.40
52	002439	启明星辰	5,546	115,301.34	0.40
53	002465	海格通信	9,863	114,903.95	0.40
54	002271	东方雨虹	5,261	114,111.09	0.40
55	002004	华邦健康	12,386	112,341.02	0.39
56	002353	杰瑞股份	5,487	111,386.10	0.39
57	002311	海大集团	7,274	109,473.70	0.38
58	002223	鱼跃医疗	3,525	109,345.50	0.38
59	002001	新和成	5,476	107,329.60	0.37
60	002294	信立泰	3,668	107,252.32	0.37
61	002221	东华能源	8,532	105,711.48	0.37
62	002051	中工国际	4,575	104,859.00	0.37
63	002018	华信国际	10,223	103,967.91	0.36
64	002665	首航节能	11,559	101,256.84	0.35
65	002410	广联达	6,926	101,119.60	0.35
66	002138	顺络电子	5,815	100,657.65	0.35
67	002013	中航机电	5,448	99,643.92	0.35
68	002131	利欧股份	6,233	99,416.35	0.35
69	002622	融钰集团	6,800	99,144.00	0.35
70	002146	荣盛发展	12,595	98,870.75	0.35
71	002152	广电运通	7,383	98,046.24	0.34
72	002491	通鼎互联	6,300	97,902.00	0.34
73	002250	联化科技	5,998	97,047.64	0.34
74	002048	宁波华翔	4,380	96,973.20	0.34
75	002191	劲嘉股份	9,288	96,688.08	0.34
76	002276	万马股份	6,409	96,327.27	0.34
77	002630	华西能源	7,749	95,545.17	0.33
78	002672	东江环保	5,421	95,409.60	0.33
79	002501	利源精制	7,749	95,080.23	0.33
80	002343	慈文传媒	2,100	94,857.00	0.33
81	002462	嘉事堂	2,200	93,566.00	0.33



82	002050	三花智控	8,392	92,647.68	0.32
83	002022	科华生物	4,628	92,560.00	0.32
84	002299	圣农发展	4,349	92,285.78	0.32
85	002108	沧州明珠	4,518	92,031.66	0.32
86	002273	水晶光电	4,558	90,704.20	0.32
87	002268	卫士通	2,872	90,238.24	0.32
88	002583	海能达	6,825	90,158.25	0.31
89	002281	光迅科技	1,145	89,882.50	0.31
90	002602	世纪华通	1,900	89,091.00	0.31
91	002424	贵州百灵	4,699	88,999.06	0.31
92	002384	东山精密	4,531	88,852.91	0.31
93	002153	石基信息	3,645	88,828.65	0.31
94	002544	杰赛科技	3,142	88,415.88	0.31
95	002408	齐翔腾达	8,029	88,319.00	0.31
96	002308	威创股份	5,958	87,820.92	0.31
97	002477	雏鹰农牧	17,185	86,268.70	0.30
98	002714	牧原股份	3,692	85,949.76	0.30
99	002185	华天科技	7,085	85,586.80	0.30
100	002155	湖南黄金	7,429	85,062.05	0.30
101	002657	中科金财	1,969	84,982.04	0.30
102	002027	分众传媒	5,800	82,766.00	0.29
103	002195	二三四五	7,266	82,251.12	0.29
104	002368	太极股份	2,654	81,238.94	0.28
105	002411	必康股份	2,990	80,879.50	0.28
106	002089	新海宜	5,698	80,854.62	0.28
107	002444	巨星科技	5,161	80,511.60	0.28
108	002217	合力泰	4,489	80,353.10	0.28
109	002312	三泰控股	9,166	80,202.50	0.28
110	002023	海特高新	5,782	80,022.88	0.28
111	002019	亿帆医药	5,228	79,936.12	0.28
112	002479	富春环保	5,379	79,716.78	0.28
113	002489	浙江永强	10,500	79,485.00	0.28
114	002078	太阳纸业	11,875	79,325.00	0.28
115	002668	奥马电器	1,100	78,045.00	0.27
116	002117	东港股份	2,598	77,810.10	0.27
117	002595	豪迈科技	3,682	77,506.10	0.27
118	002073	软控股份	6,819	77,395.65	0.27
119	002522	浙江众成	4,289	77,159.11	0.27
120	002326	永太科技	4,700	76,657.00	0.27

121	002190	成飞集成	2,381	76,144.38	0.27
122	002041	登海种业	4,011	75,727.68	0.26
123	002366	台海核电	1,411	75,657.82	0.26
124	002104	恒宝股份	6,412	75,597.48	0.26
125	002440	闰土股份	4,614	75,392.76	0.26
126	002375	亚厦股份	7,100	75,118.00	0.26
127	002570	贝因美	5,721	75,059.52	0.26
128	002589	瑞康医药	2,302	74,699.90	0.26
129	002224	三力士	4,900	73,696.00	0.26
130	002390	信邦制药	7,443	73,611.27	0.26
131	002447	壹桥股份	7,431	73,418.28	0.26
132	002640	跨境通	4,000	73,200.00	0.26
133	002358	森源电气	3,795	72,788.10	0.25
134	002002	鸿达兴业	9,883	72,541.22	0.25
135	002421	达实智能	10,998	72,366.84	0.25
136	002436	兴森科技	10,521	72,068.85	0.25
137	002047	宝鹰股份	7,700	71,995.00	0.25
138	002070	众和股份	5,185	71,967.80	0.25
139	002383	合众思壮	1,449	71,725.50	0.25
140	002028	思源电气	5,397	71,132.46	0.25
141	002025	航天电器	2,820	71,064.00	0.25
142	002638	勤上光电	7,705	70,886.00	0.25
143	002244	滨江集团	10,074	70,316.52	0.25
144	002174	游族网络	2,635	69,695.75	0.24
145	002429	兆驰股份	6,990	69,620.40	0.24
146	002325	洪涛股份	8,662	69,382.62	0.24
147	002603	以岭药业	4,012	69,166.88	0.24
148	002285	世联行	9,089	69,076.40	0.24
149	002303	美盈森	6,719	69,071.32	0.24
150	002052	同洲电子	6,125	68,600.00	0.24
151	002262	恩华药业	3,274	68,426.60	0.24
152	002099	海翔药业	8,054	68,297.92	0.24
153	002067	景兴纸业	10,200	68,136.00	0.24
154	002106	莱宝高科	6,033	67,810.92	0.24
155	002161	远望谷	5,842	67,358.26	0.24
156	002063	远光软件	5,125	67,342.50	0.24
157	002123	梦网荣信	4,392	65,880.00	0.23
158	002437	誉衡药业	7,919	65,490.13	0.23
159	002389	南洋科技	2,819	65,062.52	0.23

160	002339	积成电子	3,404	64,812.16	0.23
161	002055	得润电子	2,724	64,586.04	0.23
162	002396	星网锐捷	3,526	64,420.02	0.22
163	002481	双塔食品	7,100	64,397.00	0.22
164	002697	红旗连锁	7,909	63,904.72	0.22
165	002317	众生药业	5,144	63,528.40	0.22
166	002237	恒邦股份	5,523	63,514.50	0.22
167	002156	通富微电	5,525	62,874.50	0.22
168	002064	华峰氨纶	11,420	62,695.80	0.22
169	002480	新筑股份	5,476	62,152.60	0.22
170	002399	海普瑞	3,410	62,130.20	0.22
171	002261	拓维信息	5,210	62,103.20	0.22
172	002467	二六三	5,839	61,426.28	0.21
173	002277	友阿股份	4,266	61,259.76	0.21
174	002431	棕榈股份	6,683	61,216.28	0.21
175	002097	山河智能	6,809	60,940.55	0.21
176	002428	云南锗业	4,797	60,777.99	0.21
177	002344	海宁皮城	5,363	60,709.16	0.21
178	002505	大康农业	17,100	60,534.00	0.21
179	002005	德豪润达	10,524	60,513.00	0.21
180	002284	亚太股份	4,300	60,501.00	0.21
181	002474	榕基软件	4,449	60,328.44	0.21
182	002550	千红制药	8,326	60,113.72	0.21
183	002056	横店东磁	4,320	60,091.20	0.21
184	002031	巨轮智能	17,445	59,487.45	0.21
185	002341	新纶科技	2,818	59,431.62	0.21
186	002418	康盛股份	5,800	59,334.00	0.21
187	002121	科陆电子	6,710	59,182.20	0.21
188	002564	天沃科技	5,909	59,090.00	0.21
189	002709	天赐材料	1,400	59,038.00	0.21
190	002433	太安堂	5,437	58,937.08	0.21
191	002242	九阳股份	3,260	58,777.80	0.21
192	002318	久立特材	5,829	58,290.00	0.20
193	002010	传化智联	3,100	58,280.00	0.20
194	002364	中恒电气	2,800	58,240.00	0.20
195	002091	江苏国泰	4,374	57,999.24	0.20
196	002371	七星电子	2,179	57,961.40	0.20
197	002043	兔宝宝	5,000	57,850.00	0.20
198	002588	史丹利	5,066	57,499.10	0.20

199	002463	沪电股份	12,016	57,436.48	0.20
200	002251	步步高	3,491	57,426.95	0.20
201	002376	新北洋	4,627	57,374.80	0.20
202	002245	澳洋顺昌	6,422	57,284.24	0.20
203	002482	广田集团	6,190	57,257.50	0.20
204	002151	北斗星通	1,793	57,196.70	0.20
205	002517	恺英网络	1,700	57,052.00	0.20
206	002215	诺普信	5,141	56,962.28	0.20
207	002642	荣之联	2,833	56,943.30	0.20
208	002269	美邦服饰	11,361	56,918.61	0.20
209	002690	美亚光电	2,670	56,497.20	0.20
210	002563	森马服饰	5,500	56,485.00	0.20
211	002263	大东南	13,318	56,335.14	0.20
212	002283	天润曲轴	7,248	56,316.96	0.20
213	002625	龙生股份	1,500	56,190.00	0.20
214	002547	春兴精工	5,900	55,755.00	0.19
215	002130	沃尔核材	3,933	55,533.96	0.19
216	002332	仙琚制药	4,280	55,083.60	0.19
217	002128	露天煤业	6,404	55,074.40	0.19
218	002497	雅化集团	8,023	55,037.78	0.19
219	002503	搜于特	3,800	54,682.00	0.19
220	002471	中超控股	9,000	54,540.00	0.19
221	002649	博彦科技	1,400	54,460.00	0.19
222	002413	雷科防务	4,700	54,426.00	0.19
223	002699	美盛文化	1,600	54,080.00	0.19
224	002367	康力电梯	4,089	54,015.69	0.19
225	002011	盾安环境	5,616	53,464.32	0.19
226	002663	普邦股份	8,794	53,379.58	0.19
227	002154	报喜鸟	9,700	52,574.00	0.18
228	002249	大洋电机	6,077	52,444.51	0.18
229	002574	明牌珠宝	4,529	52,400.53	0.18
230	002414	高德红外	2,300	52,394.00	0.18
231	002095	生意宝	1,305	52,252.20	0.18
232	002329	皇氏集团	3,700	52,244.00	0.18
233	002029	七匹狼	5,104	52,111.84	0.18
234	002296	辉煌科技	3,300	52,107.00	0.18
235	002170	芭田股份	5,600	52,024.00	0.18
236	002298	中电鑫龙	3,767	52,022.27	0.18
237	002345	潮宏基	4,302	51,968.16	0.18

238	002551	尚荣医疗	2,605	51,865.55	0.18
239	002502	骅威文化	4,000	51,680.00	0.18
240	002177	御银股份	6,741	51,636.06	0.18
241	002416	爱施德	3,500	51,555.00	0.18
242	002488	金固股份	3,100	51,460.00	0.18
243	002197	证通电子	3,128	51,017.68	0.18
244	002254	泰和新材	4,108	50,774.88	0.18
245	002555	三七互娱	3,058	50,151.20	0.18
246	002721	金一文化	3,000	50,040.00	0.17
247	002020	京新药业	4,412	49,943.84	0.17
248	002556	辉隆股份	4,800	49,872.00	0.17
249	002229	鸿博股份	2,105	49,551.70	0.17
250	002267	陕天然气	5,067	48,592.53	0.17
251	002354	天神娱乐	700	48,412.00	0.17
252	002449	国星光电	3,623	48,113.44	0.17
253	002143	印纪传媒	1,487	47,896.27	0.17
254	002498	汉缆股份	11,100	47,730.00	0.17
255	002079	苏州固锝	5,146	47,188.82	0.16
256	002681	奋达科技	3,640	47,065.20	0.16
257	002288	超华科技	5,743	46,690.59	0.16
258	002604	龙力生物	4,086	46,457.82	0.16
259	002093	国脉科技	4,149	45,929.43	0.16
260	002658	雪迪龙	2,653	45,631.60	0.16
261	002309	中利科技	3,201	45,486.21	0.16
262	002773	康弘药业	800	45,432.00	0.16
263	002118	紫鑫药业	6,262	45,086.40	0.16
264	002178	延华智能	4,876	45,054.24	0.16
265	002280	联络互动	3,225	45,053.25	0.16
266	002334	英威腾	5,542	44,890.20	0.16
267	002527	新时达	3,345	44,856.45	0.16
268	002369	卓翼科技	4,380	44,763.60	0.16
269	002373	千方科技	3,238	44,684.40	0.16
270	002240	威华股份	3,862	44,683.34	0.16
271	002009	天奇股份	3,066	44,365.02	0.15
272	002071	长城影视	3,206	43,729.84	0.15
273	002581	未名医药	1,800	43,686.00	0.15
274	002737	葵花药业	1,296	43,662.24	0.15
275	002253	川大智胜	1,750	43,645.00	0.15
276	002568	百润股份	2,100	42,504.00	0.15

277	002036	联创电子	2,200	42,152.00	0.15
278	002751	易尚展示	900	41,796.00	0.15
279	002493	荣盛石化	2,662	41,048.04	0.14
280	002496	辉丰股份	8,287	41,020.65	0.14
281	002432	九安医疗	2,528	39,259.84	0.14
282	002717	岭南园林	1,500	38,970.00	0.14
283	002698	博实股份	2,468	38,426.76	0.13
284	002609	捷顺科技	2,400	38,400.00	0.13
285	002279	久其软件	2,200	37,730.00	0.13
286	002235	安妮股份	2,344	37,316.48	0.13
287	002577	雷柏科技	1,195	36,256.30	0.13
288	002233	塔牌集团	3,692	34,520.20	0.12
289	002702	海欣食品	1,800	34,272.00	0.12
290	002203	海亮股份	4,231	34,101.86	0.12
291	002378	章源钨业	3,438	33,658.02	0.12
292	002504	弘高创意	4,240	33,538.40	0.12
293	002181	粤传媒	4,228	33,316.64	0.12
294	002653	海思科	2,087	32,619.81	0.11
295	002315	焦点科技	494	29,783.26	0.10
296	002741	光华科技	1,500	29,280.00	0.10

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002716	金贵银业	5,200	120,328.00	0.42
2	002486	嘉麟杰	8,300	84,743.00	0.30
3	002628	成都路桥	8,612	81,383.40	0.28
4	002297	博云新材	3,966	51,914.94	0.18
5	002618	丹邦科技	2,000	50,500.00	0.18
6	002419	天虹商场	3,100	46,562.00	0.16
7	002461	珠江啤酒	3,800	45,790.00	0.16
8	002094	青岛金王	1,500	45,000.00	0.16
9	002683	宏大爆破	4,900	43,512.00	0.15
10	002021	中捷资源	4,800	42,480.00	0.15
11	002032	苏泊尔	1,200	41,904.00	0.15
12	002186	全聚德	1,900	41,800.00	0.15
13	002393	力生制药	1,000	41,300.00	0.14

14	002554	惠博普	4,900	40,033.00	0.14
15	002017	东信和平	2,500	39,450.00	0.14
16	002140	东华科技	2,900	39,208.00	0.14
17	002648	卫星石化	3,100	37,882.00	0.13
18	002322	理工环科	1,500	35,790.00	0.13
19	002565	顺灏股份	3,900	31,434.00	0.11
20	002166	莱茵生物	2,500	30,925.00	0.11
21	002490	山东墨龙	2,800	27,104.00	0.09
22	002016	世荣兆业	2,600	24,882.00	0.09
23	002401	中海科技	1,200	18,804.00	0.07

## 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	002739	万达院线	395,601.00	1.06
2	002241	歌尔股份	282,312.00	0.75
3	002268	卫士通	280,171.75	0.75
4	002673	西部证券	267,576.00	0.71
5	002375	亚厦股份	261,334.00	0.70
6	002353	杰瑞股份	241,996.00	0.65
7	002292	奥飞娱乐	234,406.00	0.63
8	002081	金螳螂	231,733.00	0.62
9	002002	鸿达兴业	205,567.00	0.55
10	002170	芭田股份	183,616.00	0.49
11	002304	洋河股份	182,616.00	0.49
12	002466	天齐锂业	179,382.00	0.48
13	002407	多氟多	169,400.00	0.45
14	002415	海康威视	166,339.00	0.44
15	002736	国信证券	157,610.00	0.42
16	002142	宁波银行	156,451.00	0.42
17	002456	欧菲光	152,301.00	0.41
18	002572	索菲亚	150,066.00	0.40
19	002309	中利科技	147,038.04	0.39

20	002589	瑞康医药	140,160.00	0.37
----	--------	------	------------	------

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	002183	怡亚通	1,253,429.70	3.35
2	002030	达安基因	516,617.07	1.38
3	002191	劲嘉股份	387,381.20	1.03
4	002024	苏宁云商	338,859.52	0.90
5	002018	华信国际	286,925.00	0.77
6	002091	江苏国泰	263,660.09	0.70
7	002219	恒康医疗	251,995.05	0.67
8	002415	海康威视	222,734.00	0.59
9	002174	游族网络	217,152.00	0.58
10	002092	中泰化学	211,419.00	0.56
11	002123	梦网荣信	206,953.70	0.55
12	002577	雷柏科技	205,706.92	0.55
13	002574	明牌珠宝	202,109.00	0.54
14	002450	康得新	199,012.84	0.53
15	002466	天齐锂业	197,289.22	0.53
16	002369	卓翼科技	188,646.92	0.50
17	002094	青岛金王	183,846.15	0.49
18	002111	威海广泰	175,405.60	0.47
19	002410	广联达	173,354.20	0.46
20	002622	融钰集团	169,970.00	0.45

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	16,084,680.02
卖出股票收入（成交）总额	18,803,608.03

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：本基金本报告期末未投资股指期货，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：本基金本报告期末未进行国债期货投资，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

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

### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,034.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	332.80
5	应收申购款	1,108.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,475.52

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	002297	博云新材	51,914.94	0.18	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

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
长城久兆中小板 300 指数分级	2,476	7,314.24	233,719.00	1.29%	17,876,333.77	98.71%
长城久兆稳健指数	206	16,959.85	27,192.00	0.78%	3,466,538.00	99.22%
长城久兆积极指数	850	6,165.41	888,713.00	16.96%	4,351,882.00	83.04%
合计	3,532	7,600.33	1,149,624.00	4.28%	25,694,753.77	95.72%

注：①对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

②以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

### 长城久兆稳健指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李时龙	1,909,759.00	54.66%
2	王丽春	282,842.00	8.10%
3	白志伟	282,391.00	8.08%
4	李文霞	254,918.00	7.30%
5	李惠霞	154,000.00	4.41%
6	李时龙	117,811.00	3.37%
7	傅效连	83,092.00	2.38%
8	吕利香	40,062.00	1.15%
9	罗杰	30,400.00	0.87%
10	上海明沚投资管理有限公司—明沚CTA 一号基金	20,000.00	0.57%

### 长城久兆积极指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东兴证券投资有限公司	888,641.00	16.96%
2	陈朝阳	406,900.00	7.76%
3	屈大虎	321,036.00	6.13%
4	袁成刚	135,600.00	2.59%
5	周晓虎	94,216.00	1.80%

6	叶彤	69,900.00	1.33%
7	伍徐远	67,362.00	1.29%
8	黄添胜	61,309.00	1.17%
9	吴柳梅	60,786.00	1.16%
10	金燕	58,363.00	1.11%

注：①持有人为场内持有人，占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例×100%。

②对于长城久兆稳健指数、长城久兆积极指数前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别份额总数。

③以基金账户为统计口径。

④以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长城久兆中小板 300 指数分级 (场内简称: 长城久兆)	-	-
	长城久兆稳健指数 (场内简称: 中小 300A)	-	-
	长城久兆积极指数 (场内简称: 中小 300B)	-	-
	合计	-	-

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	长城久兆中小板 300 指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长城久兆中小板 300 指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	0
	合计	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

项目	长城久兆中小板 300 指数分级	长城久兆稳健指 数	长城久兆积极指 数
基金合同生效日（2012 年 1 月 30 日）基金份额总额	919,797,702.13	18,458,033.00	27,687,050.00
本报告期期初基金份额总额	20,277,903.32	3,071,922.00	4,607,883.00
本报告期基金总申购份额	92,957,263.35	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	94,321,859.72	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-803,254.18	421,808.00	632,712.00
本报告期期末基金份额总额	18,110,052.77	3,493,730.00	5,240,595.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金定期份额折算中新增的份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

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

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

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

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

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

- 1、本期未有改聘会计师事务所。
- 2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币肆万元。
- 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自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 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	
兴业证券	1	31,941,744.21	91.56%	29,747.41	91.56%	-
国金证券	2	2,942,917.77	8.44%	2,740.73	8.44%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-

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 7 个专用交易单元（东吴证券、广发证券、海通证券分别新增 1 个交易单元；天风证券、中泰证券分别新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 51 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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	20,676.32	100.00%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-



长城证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所实施熔断对旗下基金相关业务影响的公告	本基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	长城基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停场内申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 8 日
6	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
7	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
8	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
9	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 14 日
10	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2016 年 1 月 20 日

		理人网站	
11	长城基金管理有限公司关于参加平安证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
12	长城基金管理有限公司于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 20 日
13	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持固定收益品种估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
14	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 26 日
15	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 27 日
16	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
17	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
18	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算期间中小 300A 份额复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 1 日
19	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 2 日
20	关于长城中小 300A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 2 日
21	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 2 日
22	长城基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 2 月 4 日

	调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
23	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
24	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 1 日
25	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 3 日
26	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 19 日
27	关于增加陆金所资管为长城旗下开放式基金代销机构并同时实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 21 日
28	长城基金关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 25 日
29	长城基金关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 3 月 30 日
30	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 6 日
31	长城基金关于大同证券有限责任公司开通旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 12 日
32	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
33	长城基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 5 月 6 日

	调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
34	长城基金关于增加富济财富为旗下开放式基金代销机构并开通转换定投等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
35	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
36	长城基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
37	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
38	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 1 日
39	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 3 日
40	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 6 日
41	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加国盛证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 16 日
42	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 18 日
43	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 6 月 30 日

44	关于旗下部分基金通过陆金所资管开通定期定额投资业务并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
45	长城基金管理有限公司关于参加兴业证券费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 1 日
46	长城基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 4 日
47	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 5 日
48	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 7 日
49	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 7 月 8 日
50	长城基金关于增加肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 8 月 31 日
51	长城基金关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 7 日
52	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 8 日
53	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 9 月 20 日
54	关于增加方正证券为长城旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 13 日
55	关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016 年 10 月 19 日

		券日报及本基金管理人网站	
56	关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 10 月 21 日
57	长城基金管理有限公司关于参加和讯科技费率优惠活动的公告（放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 11 日
58	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 12 日
59	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 11 月 29 日
60	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与中国民生银行直销银行“基金通”平台开展的申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 5 日
61	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 13 日
62	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 21 日
63	长城基金关于旗下部分开放式基金参与农业银行开展的基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 12 月 26 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）本基金设立等相关批准文件
- （二）《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会规定的其他文件

## 12.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)