

久嘉证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 15 |
| §7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表..... | 16 |
| 7.2 利润表..... | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |
| 7.4 报表附注..... | 20 |
| §8 投资组合报告 | 45 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 45 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 46 |
| 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..... | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 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..... | 52 |
| 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..... | 52 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 52 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 52 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 52 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 53 |
| §9 基金份额持有人信息 | 54 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 54 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 54 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 54 |
| §10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 55 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 55 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 56 |
| 10.8 其他重大事件 | 58 |
| §11 备查文件目录 | 63 |
| 11.1 备查文件目录 | 63 |
| 11.2 存放地点 | 63 |
| 11.3 查阅方式 | 63 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|--------------------|
| 基金名称 | 久嘉证券投资基金 |
| 场内简称 | 基金久嘉 |
| 基金简称 | 长城久嘉封闭 |
| 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 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 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%。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|------------------------------|--------------------|
| 名称 | | 长城基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 车君 | 林葛 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 95599 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 | 北京市东城区建国门内大街 69 号 |

| | | |
|-------|---------------------------------|------------------------------|
| 办公地址 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 518026 | 100031 |
| 法定代表人 | 何伟 | 周慕冰 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层 |
| 注册登记机构 | 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 | 35,543,651.69 | 656,352,821.63 | 57,869,179.06 |
| 本期利润 | -352,622,127.76 | 852,742,478.56 | 265,625,656.73 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1763 | 0.4264 | 0.1328 |
| 本期加权平均净值利润率 | -16.15% | 32.08% | 14.71% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.60% | 41.94% | 15.02% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配利润 | 57,581,591.94 | 527,045,298.94 | -129,307,522.69 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0288 | 0.2635 | -0.0647 |
| 期末基金资产净值 | 2,057,581,591.94 | 2,886,203,719.70 | 2,033,461,241.14 |
| 期末基金份额净值 | 1.0288 | 1.4431 | 1.0167 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 475.06% | 556.39% | 362.44% |

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。

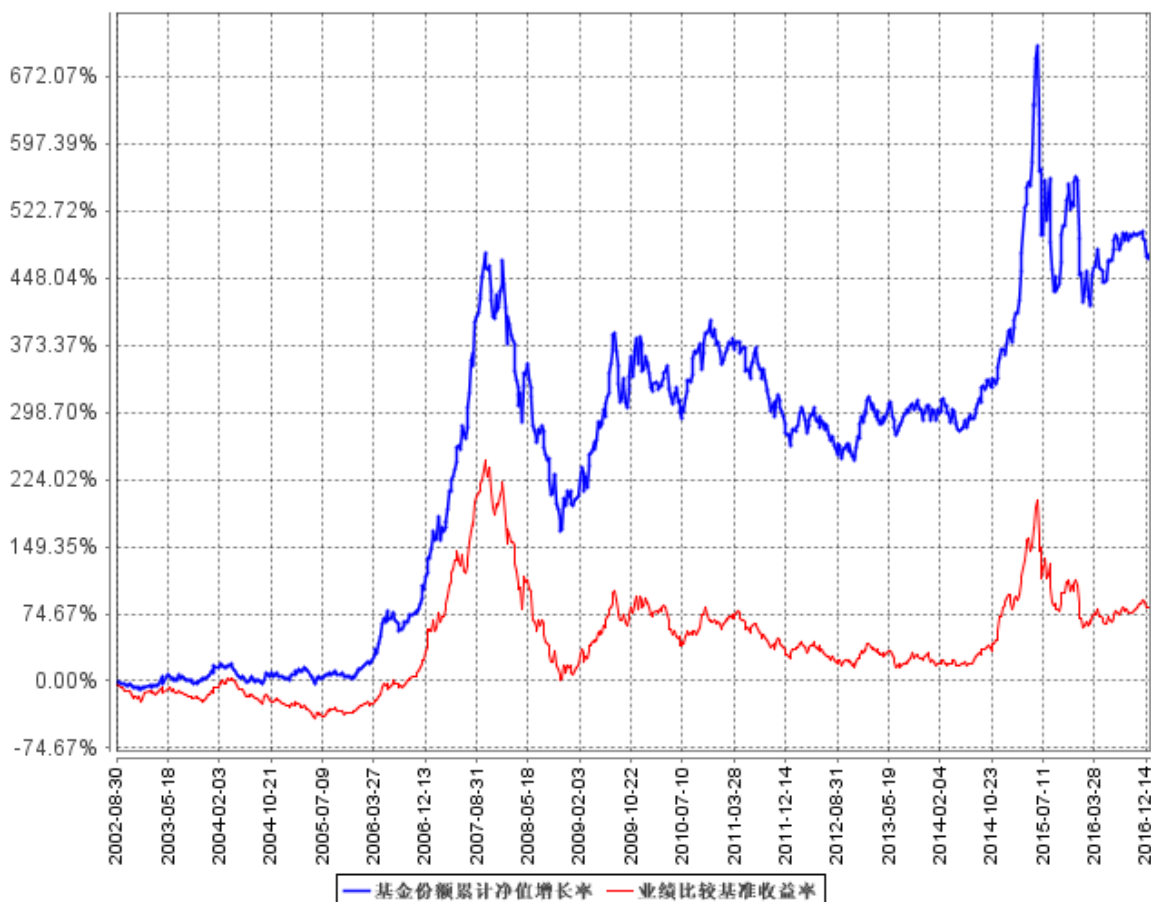
3.2 基金净值表现

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 | -2.33% | 1.12% | 3.32% | 1.49% | -5.65% | -0.37% |
| 过去六个月 | 0.03% | 1.17% | 5.97% | 1.48% | -5.94% | -0.31% |
| 过去一年 | -11.60% | 2.65% | -12.28% | 2.83% | 0.68% | -0.18% |
| 过去三年 | 45.34% | 3.16% | 47.77% | 3.79% | -2.43% | -0.63% |
| 过去五年 | 55.46% | 2.77% | 41.03% | 3.33% | 14.43% | -0.56% |
| 自基金合同生效起至今 | 475.06% | 2.99% | 81.74% | 3.58% | 393.32% | -0.59% |

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

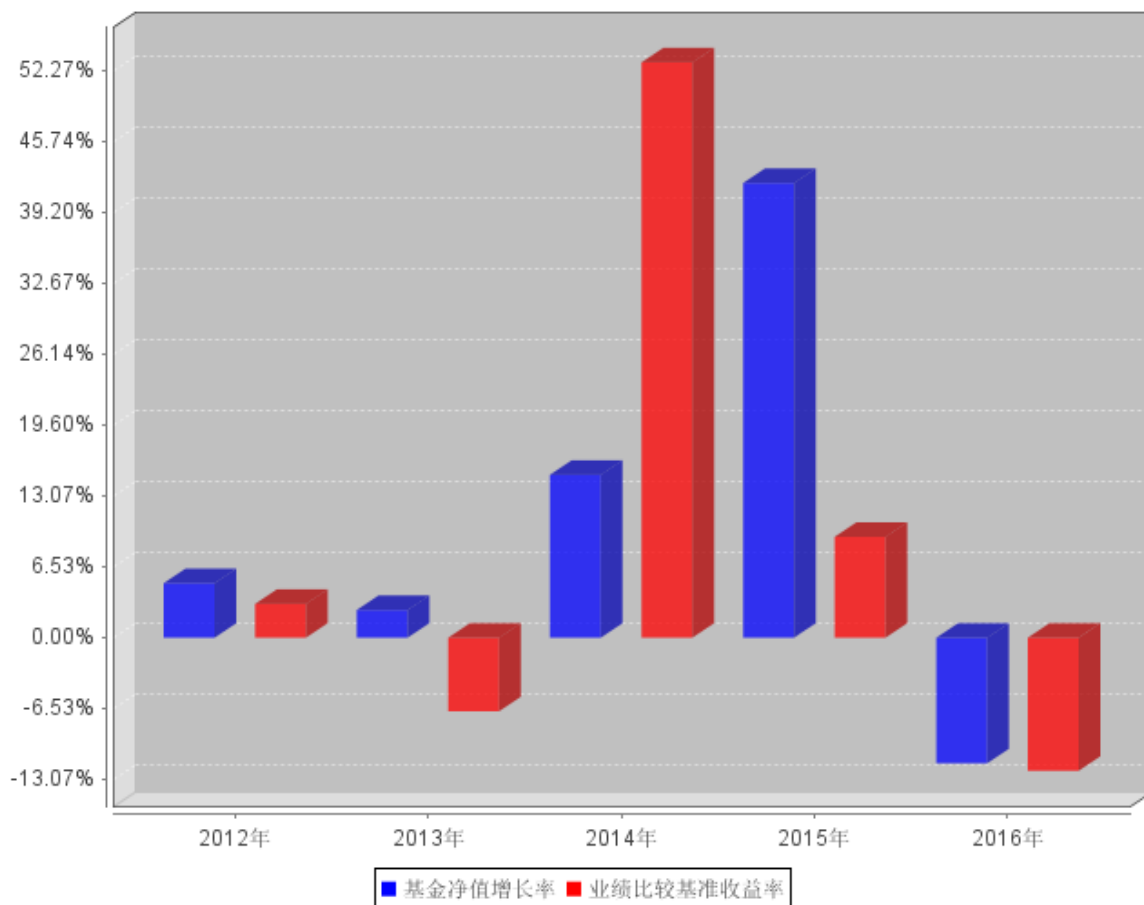
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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 |
|------|-------------|----------------|-----------|----------------|
| 2016 | 2.3800 | 476,000,000.00 | - | 476,000,000.00 |
| 2015 | - | - | - | - |
| 2014 | - | - | - | - |
| 合计 | 2.3800 | 476,000,000.00 | - | 476,000,000.00 |

§ 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 | | |
| 蒋劲刚 | 久嘉证券投资基金的基金经理 | 2012年3月7日 | - | 18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。 |
| 乔春 | 久嘉证券投资基金、长城环保基金的基金经理 | 2014 年 9 月 16 日 | - | 6 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》、《久嘉证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资

基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 A 股市场呈现整体重心下移的态势，结构分化明显。低估值的大盘蓝筹股走势平稳，而中小创等传统热门板块持续调整，可以说是看基本面的多了，炒概念炒题材的少了，这是对前几年市场上涨的修正，是市场挤泡沫的过程。在市场下跌中，我们也看到了一些积极的因素：管理层对市场的悉心呵护（如果断暂停熔断机制），改革稳步推进，去产能、降杠杆已取得初步成效，国内经济呈现出逐步企稳迹象。在市场调整过程中，根据市场节奏的变化，组合也相应的做了一些调整，并适当加强了一些波段性操作。目前组合的重点投资方向包括：消费类（医药、大众休闲娱乐和教育）、机械制造、建筑、环保等几个领域。我们希望通过这些领域的投资能给持有人带来长期稳定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016 年本基金份额净值增长率为-11.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以美联储加息为标志，预示着全球货币最宽松、利率最低的时期正在过去。国内货币政策的导向也是中性偏紧，降杠杆，防风险成为金融监管工作的重点。受流动性影响，A 股市场的估值水平会受到压制，国内经济进入中低速增长的新常态，业绩推动股指上升的动力也有限，但市场经过一段时间的调整后，目前估值整体水平处于相对合理。预期 17 年市场的波动性会减弱，投资者会更注重于基本面来选择行业和个股。受益于去产能政策的周期品行业中的龙头公司，消费类的稳定成长公司、以及电子、信息技术行业中的优质成长公司、涉及受国家政策扶持的一路一带、PPP 项目及环保类公司值得我们重点关注。

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及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内，于 2016 年 4 月 26 日进行了利润分配，共分配 476,000,000 元，是对 2015 年度利润进行的分配。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，在符合分红条件的前提下，将按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

§ 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2017）审字第 60737541_H01 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 | 久嘉证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 引言段 | 我们审计了后附的久嘉证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和以及 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，公允反映了久嘉证券投资基金 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：久嘉证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |

| | | | |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 205,222,739.52 | 181,592,527.96 |
| 结算备付金 | | 2,300,601.82 | 1,901,216.58 |
| 存出保证金 | | 391,336.93 | 700,165.96 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 1,844,411,598.82 | 2,694,755,926.58 |
| 其中：股票投资 | | 1,411,970,314.02 | 2,071,940,369.98 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 432,441,284.80 | 622,815,556.60 |
| 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 | 9,559,192.24 | 12,694,763.59 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,061,885,469.33 | 2,891,644,600.67 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年12月31日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 2,100.00 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 2,637,794.31 | 3,611,312.33 |
| 应付托管费 | | 439,632.38 | 601,885.36 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 858,741.40 | 762,073.98 |
| 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 | 7.4.7.8 | 359,000.00 | 459,000.00 |
| 负债合计 | | 4,303,877.39 | 5,440,880.97 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 57,581,591.94 | 886,203,719.70 |
| 所有者权益合计 | | 2,057,581,591.94 | 2,886,203,719.70 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,061,885,469.33 | 2,891,644,600.67 |

注：截至 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0288 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：久嘉证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | -306,381,219.39 | 906,889,937.16 |
| 1.利息收入 | | 19,337,722.68 | 23,900,168.99 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,469,494.00 | 1,269,308.10 |
| 债券利息收入 | | 17,797,228.58 | 22,535,444.97 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 71,000.10 | 95,415.92 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 62,446,837.38 | 686,600,111.24 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 53,094,664.92 | 671,677,194.37 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | -1,757,648.71 | -1,931,119.88 |
| 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 | 11,109,821.17 | 16,854,036.75 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | -388,165,779.45 | 196,389,656.93 |
| 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 | - | - |
| 减：二、费用 | | 46,240,908.37 | 54,147,458.60 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 32,851,228.71 | 39,703,376.64 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 5,475,204.74 | 6,617,229.45 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 5,930,569.57 | 7,409,356.50 |
| 5. 利息支出 | | 71,118.06 | 12,567.91 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 71,118.06 | 12,567.91 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 1,912,787.29 | 404,928.10 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -352,622,127.76 | 852,742,478.56 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -352,622,127.76 | 852,742,478.56 |

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：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） | 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 |
| 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） | 2,000,000,000.00 | 33,461,241.14 | 2,033,461,241.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 852,742,478.56 | 852,742,478.56 |
| 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） | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,000,000,000.00 | 886,203,719.70 | 2,886,203,719.70 |

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>彭洪波</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

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”）。

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、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《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企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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

后续计量

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

终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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 1.5% 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。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%；

(2) 基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；

(3) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(4) 基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

(5) 每一基金单位享有同等分配权。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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

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、地方政府债券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。

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 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 | 205,222,739.52 | 181,592,527.96 |
| 定期存款 | - | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - | - |
| 其他存款 | - | - |
| 合计： | 205,222,739.52 | 181,592,527.96 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,434,607,167.51 | 1,411,970,314.02 | -22,636,853.49 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 181,819,080.00 | 177,260,284.80 |
| | 银行间市场 | 256,992,710.00 | 255,181,000.00 |
| | 合计 | 438,811,790.00 | 432,441,284.80 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 1,873,418,957.51 | 1,844,411,598.82 | -29,007,358.69 |
| 项目 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 1,720,936,533.89 | 2,071,940,369.98 | 351,003,836.09 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 75,639,043.70 | 75,912,556.60 |
| | 银行间市场 | 539,021,928.23 | 546,903,000.00 |
| | 合计 | 614,660,971.93 | 622,815,556.60 |
| 资产支持证券 | - | - | - |

| | | | |
|----|------------------|------------------|----------------|
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 2,335,597,505.82 | 2,694,755,926.58 | 359,158,420.76 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产/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：本基金于本期末及上年度末均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 | 37,030.23 | 38,250.14 |
| 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 | 1,035.30 | 855.60 |
| 应收债券利息 | 9,520,950.61 | 12,655,342.75 |
| 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 | 176.10 | 315.10 |
| 合计 | 9,559,192.24 | 12,694,763.59 |

注：其他项目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 | 858,741.40 | 760,883.98 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | 1,190.00 |
| 合计 | 858,741.40 | 762,073.98 |

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 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付赎回费 | - | - |
| 预提审计费 | 100,000.00 | 100,000.00 |
| 应付券商交易单元保证金 | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 预提银行间账户维护费 | 9,000.00 | 9,000.00 |
| 预提信息披露费 | - | 100,000.00 |
| 合计 | 359,000.00 | 459,000.00 |

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 2,000,000,000.00 | 2,000,000,000.00 |

注：本基金成立时，基金发起人长城基金管理有限公司认购本基金份额 15,000,000.00 份，发起人西北证券有限责任公司认购本基金份额 5,000,000.00 份。上述发起人于基金成立时共计认购本基金份额占总份额的 1.00%。

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 | 527,045,298.94 | 359,158,420.76 | 886,203,719.70 |
| 本期利润 | 35,543,651.69 | -388,165,779.45 | -352,622,127.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -476,000,000.00 | - | -476,000,000.00 |
| 本期末 | 86,588,950.63 | -29,007,358.69 | 57,581,591.94 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

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

| | 31 日 | 日 |
|-----------|--------------|--------------|
| 活期存款利息收入 | 1,435,417.73 | 1,230,460.23 |
| 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 | 25,302.26 | 32,072.61 |
| 其他 | 8,774.01 | 6,775.26 |
| 合计 | 1,469,494.00 | 1,269,308.10 |

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016 年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 2,067,009,362.45 | 2,528,519,571.01 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,013,914,697.53 | 1,856,842,376.64 |
| 买卖股票差价收入 | 53,094,664.92 | 671,677,194.37 |

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 | 365,806,486.83 | 439,616,292.79 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 358,279,548.23 | 435,255,231.56 |
| 减：应收利息总额 | 9,284,587.31 | 6,292,181.11 |
| 买卖债券差价收入 | -1,757,648.71 | -1,931,119.88 |

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 11,109,821.17 | 16,854,036.75 |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 11,109,821.17 | 16,854,036.75 |

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 | -388,165,779.45 | 196,389,656.93 |
| ——股票投资 | -373,640,689.58 | 186,299,113.63 |
| ——债券投资 | -14,525,089.87 | 10,090,543.30 |
| ——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 | -388,165,779.45 | 196,389,656.93 |

7.4.7.18 其他收入

注：本基金于本期及上年度可比期间均未发生其他收入。

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 | 5,929,744.57 | 7,405,706.50 |
| 银行间市场交易费用 | 825.00 | 3,650.00 |
| 合计 | 5,930,569.57 | 7,409,356.50 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 100,000.00 | 100,000.00 |
| 信息披露费 | 300,000.00 | 200,000.00 |

| | | |
|-------|--------------|------------|
| 银行费用 | 1,667.29 | 4,028.10 |
| 上市年费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 账户维护费 | 37,400.00 | 40,900.00 |
| 分红手续费 | 1,413,720.00 | - |
| 合计 | 1,912,787.29 | 404,928.10 |

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

截至本财务报表批准报出日，除上述利润分配事项及在 7.4.6.2 营业税、增值税、企业所得税中披露的事项外，本基金无其他需作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：于本期，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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |

| | | | | |
|------|----------------|-------|----------------|--------|
| 长城证券 | 139,766,949.72 | 3.69% | 750,591,919.53 | 15.72% |
| 东方证券 | - | - | 116,392,995.37 | 2.44% |

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
| | 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% | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - |

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 长城证券 | 130,165.28 | 3.69% | 34,950.46 | 4.07% |
| 东方证券 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 长城证券 | 683,338.61 | 15.62% | - | - |
| 东方证券 | 105,963.95 | 2.42% | - | - |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 32,851,228.71 | 39,703,376.64 |
| 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）

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,475,204.74 | 6,617,229.45 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 基金合同生效日（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：于本期末，长城基金管理有限公司运用自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。

7.4.10.4.2 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：除基金管理人外，本基金的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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|--------------|---|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 205,222,739.52 | 1,435,417.73 | 181,592,527.96 | 1,230,460.23 |

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。

7.4.10.6 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

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 | 2016 年 4 月 25 日 | 2016 年 4 月 26 日 | 2016 年 4 月 26 日 | 2.3800 | 476,000,000.00 | | -476,000,000.00 | |
| 合计 | - | - | - | 2.3800 | 476,000,000.00 | | -476,000,000.00 | |

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------------|------------------|--------|-------|--------|--------------|------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 603823 | 百合花 | 2016 年 12 月 9 日 | 2017 年 12 月 20 日 | 新股锁定 | 10.60 | 32.74 | 36,764 | 389,698.40 | 1,203,653.36 | - |
| 603660 | 苏州科达 | 2016 年 11 月 21 日 | 2017 年 12 月 1 日 | 新股锁定 | 8.03 | 32.22 | 26,007 | 208,836.21 | 837,945.54 | - |
| 601375 | 中原证券 | 2016 年 12 月 20 日 | 2017 年 1 月 3 日 | 新股未上市 | 4.00 | 4.00 | 26,695 | 106,780.00 | 106,780.00 | - |
| 603228 | 景旺电子 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 6 日 | 新股未上市 | 23.16 | 23.16 | 3,491 | 80,851.56 | 80,851.56 | - |
| 603877 | 太平鸟 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 9 日 | 新股未上市 | 21.30 | 21.30 | 3,180 | 67,734.00 | 67,734.00 | - |
| 300583 | 赛托生物 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 6 日 | 新股未上市 | 40.29 | 40.29 | 1,582 | 63,738.78 | 63,738.78 | - |
| 603689 | 皖天然气 | 2016 年 12 月 30 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股未上市 | 7.87 | 7.87 | 4,818 | 37,917.66 | 37,917.66 | - |
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016 年 12 月 27 日 | 2017 年 1 月 5 日 | 新股未上市 | 10.44 | 10.44 | 2,316 | 24,179.04 | 24,179.04 | - |
| 603266 | 天龙股份 | 2016 年 12 月 30 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股未上市 | 14.63 | 14.63 | 1,562 | 22,852.06 | 22,852.06 | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016 年 12 月 28 日 | 2017 年 1 月 5 日 | 新股未上市 | 14.11 | 14.11 | 1,438 | 20,290.18 | 20,290.18 | - |
| 002840 | 华统股份 | 2016 年 12 月 29 日 | 2017 年 1 月 10 日 | 新股未上市 | 6.55 | 6.55 | 1,814 | 11,881.70 | 11,881.70 | - |
| 002838 | 道恩 | 2016 年 | 2017 年 | 新股未 | 15.28 | 15.28 | 681 | 10,405.68 | 10,405.68 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|------------|-------|------|------|-------|-----------|-----------|---|
| | 股份 | 12月28日 | 1月6日 | 上市 | | | | | | |
| 603186 | 华正新材 | 2016年12月26日 | 2017年1月3日 | 新股未上市 | 5.37 | 5.37 | 1,874 | 10,063.38 | 10,063.38 | - |
| 603032 | 德新交运 | 2016年12月27日 | 2017年1月5日 | 新股未上市 | 5.81 | 5.81 | 1,628 | 9,458.68 | 9,458.68 | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016年12月26日 | 2017年1月4日 | 新股未上市 | 9.30 | 9.30 | 1,006 | 9,355.80 | 9,355.80 | - |
| 300591 | 万里马 | 2016年12月30日 | 2017年1月10日 | 新股未上市 | 3.07 | 3.07 | 2,397 | 7,358.79 | 7,358.79 | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016年12月27日 | 2017年1月5日 | 新股未上市 | 4.94 | 4.94 | 1,380 | 6,817.20 | 6,817.20 | - |

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 300271 | 华宇软件 | 2016年12月19日 | 重大事项停牌 | 17.45 | - | - | 1,682,509 | 31,545,111.24 | 29,359,782.05 | - |
| 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 | 1,600,000 | 32,367,996.34 | 29,232,000.00 | - |
| 000050 | 深天马A | 2016年9月12日 | 重大事项停牌 | 18.82 | 2017年3月23日 | 20.70 | 1,015,663 | 21,448,288.17 | 19,114,777.66 | - |
| 300098 | 高新兴 | 2016年11月17日 | 重大事项停牌 | 15.84 | 2017年1月23日 | 14.26 | 250,000 | 3,945,000.00 | 3,960,000.00 | - |
| 603986 | 兆易创新 | 2016年9月19日 | 重大事项停牌 | 177.97 | 2017年3月13日 | 195.77 | 1,133 | 26,353.58 | 201,640.01 | - |

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

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 7.4.12 列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账

面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，其中投资于国债的比例不低于本基金资产净值的 20%，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受到市场利率变化的影响。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 201 6 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 | 205,222,739.52 | - | - | - | - | - | 205,222,739.52 |
| 结 算 备 付 金 | 2,300,601.82 | - | - | - | - | - | 2,300,601.82 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---|---------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 存出保证金 | 391,336.93 | - | - | - | - | - | 391,336.93 |
| 交易性金融资产 | - | - | 29,961,000.00 | 177,260,284.80 | 225,220,000.00 | 1,411,970,314.02 | 1,844,411,598.82 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 9,559,192.24 | 9,559,192.24 |
| 资产总计 | 207,914,678.27 | - | 29,961,000.00 | 177,260,284.80 | 225,220,000.00 | 1,421,529,506.26 | 2,061,885,469.33 |
| 负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,100.00 | 2,100.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,637,794.31 | 2,637,794.31 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 439,632.38 | 439,632.38 |
| 应付交易 | - | - | - | - | - | 858,741.40 | 858,741.40 |

| | | | | | | | |
|-----------------------|----------------|--------|----------------|----------------|----------------|--------------|----------------|
| 费用 | | | | | | | |
| 应交税费 | | - | - | - | - | 6,609.30 | 6,609.30 |
| 其他负债 | | - | - | - | - | 359,000.00 | 359,000.00 |
| 负债总计 | | - | - | - | - | 4,303,877.39 | 4,303,877.39 |
| 利率敏感度缺口 | 207,914,678.27 | | -29,961,000.00 | 177,260,284.80 | 225,220,000.00 | | |
| 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 181,592,527.96 | | - | - | - | - | 181,592,527.96 |
| 结算备付金 | 1,901,216.58 | | - | - | - | - | 1,901,216.58 |
| 存出保 | 700,165.96 | | - | - | - | - | 700,165.96 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|------------------|------------------|
| 证 金 | | | | | | | |
| 交易性金融资产 | | 90,063,000.00 | 265,817,000.00 | 13,464,756.60 | 253,470,800.00 | 2,071,940,369.98 | 2,694,755,926.58 |
| 应收利息 | | - | - | - | - | 12,694,763.59 | 12,694,763.59 |
| 资产总计 | 184,193,910.50 | 90,063,000.00 | 265,817,000.00 | 13,464,756.60 | 253,470,800.00 | 2,084,635,133.57 | 2,891,644,600.67 |
| 负 债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | | - | - | - | - | 3,611,312.33 | 3,611,312.33 |
| 应付托管费 | | - | - | - | - | 601,885.36 | 601,885.36 |
| 应付交易费用 | | - | - | - | - | 762,073.98 | 762,073.98 |
| 应交税费 | | - | - | - | - | 6,609.30 | 6,609.30 |
| 其他负债 | | - | - | - | - | 459,000.00 | 459,000.00 |

| | | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|----------------|---------------|----------------|--------------|--------------|
| 负债总计 | | | | | | 5,440,880.97 | 5,440,880.97 |
| 利率敏感度缺口 | 184,193,910.50 | 90,063,000.00 | 265,817,000.00 | 13,464,756.60 | 253,470,800.00 | | |

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时 | | |
|----|---------------------------|---------------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2016年12月31日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 利率上升 25 个基点 | -743,236.92 | -4,785,870.44 |
| | 利率下降 25 个基点 | 757,783.52 | 4,879,292.77 |

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

于本期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 | |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 1,411,970,314.02 | 68.62 | 2,071,940,369.98 | 71.79 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 432,441,284.80 | 21.02 | 622,815,556.60 | 21.58 |
| 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 | 1,844,411,598.82 | 89.64 | 2,694,755,926.58 | 93.37 |

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% | 93,833,405.50 | 73,553,883.13 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -93,833,405.50 | -73,553,883.13 |

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净值，负数表示可能减少基金净值。

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、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 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,无划分为第三层次余额。于 2015 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 1,956,509,569.98 元,划分为第二层次的余额为人民币 738,246,356.60 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,本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 1,411,970,314.02 | 68.48 |
| | 其中:股票 | 1,411,970,314.02 | 68.48 |
| 2 | 固定收益投资 | 432,441,284.80 | 20.97 |
| | 其中:债券 | 432,441,284.80 | 20.97 |
| | 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 | 207,523,341.34 | 10.06 |
| 7 | 其他各项资产 | 9,950,529.17 | 0.48 |
| 8 | 合计 | 2,061,885,469.33 | 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 | 14,974,500.00 | 0.73 |
| C | 制造业 | 835,468,915.68 | 40.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 39,905,579.66 | 1.94 |
| E | 建筑业 | 78,569,467.07 | 3.82 |
| F | 批发和零售业 | 43,542,500.00 | 2.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 53,457,622.20 | 2.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 100,211,012.41 | 4.87 |
| J | 金融业 | 109,652,780.00 | 5.33 |
| K | 房地产业 | 18,260,000.00 | 0.89 |
| L | 租赁和商务服务业 | 32,905,530.00 | 1.60 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,747,040.00 | 0.91 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 24,236,367.00 | 1.18 |
| 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 | 42,039,000.00 | 2.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,411,970,314.02 | 68.62 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 000513 | 丽珠集团 | 900,000 | 53,550,000.00 | 2.60 |
| 2 | 600987 | 航民股份 | 4,104,300 | 50,647,062.00 | 2.46 |
| 3 | 000963 | 华东医药 | 550,000 | 39,638,500.00 | 1.93 |
| 4 | 002376 | 新北洋 | 3,003,684 | 37,245,681.60 | 1.81 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 5 | 300182 | 捷成股份 | 2,867,040 | 29,559,182.40 | 1.44 |
| 6 | 300271 | 华宇软件 | 1,682,509 | 29,359,782.05 | 1.43 |
| 7 | 000902 | 新洋丰 | 2,606,516 | 29,349,370.16 | 1.43 |
| 8 | 002396 | 星网锐捷 | 1,600,000 | 29,232,000.00 | 1.42 |
| 9 | 300079 | 数码视讯 | 4,000,000 | 28,640,000.00 | 1.39 |
| 10 | 002245 | 澳洋顺昌 | 3,122,200 | 27,850,024.00 | 1.35 |
| 11 | 300017 | 网宿科技 | 501,174 | 26,867,938.14 | 1.31 |
| 12 | 000910 | 大亚圣象 | 1,395,201 | 26,648,339.10 | 1.30 |
| 13 | 002444 | 巨星科技 | 1,680,000 | 26,208,000.00 | 1.27 |
| 14 | 300145 | 中金环境 | 1,000,000 | 26,100,000.00 | 1.27 |
| 15 | 300351 | 永贵电器 | 1,000,000 | 25,670,000.00 | 1.25 |
| 16 | 300011 | 鼎汉技术 | 1,204,481 | 24,956,846.32 | 1.21 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 2,500,000 | 24,400,000.00 | 1.19 |
| 18 | 002345 | 潮宏基 | 2,008,700 | 24,265,096.00 | 1.18 |
| 19 | 600373 | 中文传媒 | 1,200,000 | 24,240,000.00 | 1.18 |
| 20 | 300190 | 维尔利 | 1,506,300 | 24,236,367.00 | 1.18 |
| 21 | 000530 | 大冷股份 | 2,200,000 | 23,892,000.00 | 1.16 |
| 22 | 002009 | 天奇股份 | 1,634,800 | 23,655,556.00 | 1.15 |
| 23 | 600369 | 西南证券 | 3,200,000 | 22,816,000.00 | 1.11 |
| 24 | 600502 | 安徽水利 | 2,262,370 | 22,578,452.60 | 1.10 |
| 25 | 300408 | 三环集团 | 1,409,176 | 22,377,714.88 | 1.09 |
| 26 | 002135 | 东南网架 | 3,004,758 | 21,874,638.24 | 1.06 |
| 27 | 000625 | 长安汽车 | 1,455,997 | 21,752,595.18 | 1.06 |
| 28 | 600015 | 华夏银行 | 2,000,000 | 21,700,000.00 | 1.05 |
| 29 | 600138 | 中青旅 | 1,000,000 | 20,970,000.00 | 1.02 |
| 30 | 002206 | 海利得 | 1,050,000 | 20,097,000.00 | 0.98 |
| 31 | 000722 | 湖南发展 | 1,406,000 | 19,979,260.00 | 0.97 |
| 32 | 000050 | 深天马A | 1,015,663 | 19,114,777.66 | 0.93 |
| 33 | 300197 | 铁汉生态 | 1,500,000 | 19,020,000.00 | 0.92 |
| 34 | 300207 | 欣旺达 | 1,358,300 | 18,880,370.00 | 0.92 |
| 35 | 002523 | 天桥起重 | 2,800,000 | 18,760,000.00 | 0.91 |
| 36 | 300284 | 苏交科 | 901,300 | 18,747,040.00 | 0.91 |
| 37 | 600219 | 南山铝业 | 6,000,000 | 18,540,000.00 | 0.90 |
| 38 | 600048 | 保利地产 | 2,000,000 | 18,260,000.00 | 0.89 |
| 39 | 002048 | 宁波华翔 | 821,500 | 18,188,010.00 | 0.88 |
| 40 | 600172 | 黄河旋风 | 1,004,100 | 17,953,308.00 | 0.87 |
| 41 | 300144 | 宋城演艺 | 850,000 | 17,799,000.00 | 0.87 |
| 42 | 600295 | 鄂尔多斯 | 1,801,600 | 17,097,184.00 | 0.83 |
| 43 | 002179 | 中航光电 | 449,916 | 16,327,451.64 | 0.79 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 44 | 600969 | 郴电国际 | 801,700 | 15,280,402.00 | 0.74 |
| 45 | 600075 | 新疆天业 | 1,200,000 | 14,928,000.00 | 0.73 |
| 46 | 300263 | 隆华节能 | 1,999,840 | 14,738,820.80 | 0.72 |
| 47 | 600787 | 中储股份 | 1,600,000 | 14,512,000.00 | 0.71 |
| 48 | 601688 | 华泰证券 | 800,000 | 14,288,000.00 | 0.69 |
| 49 | 300255 | 常山药业 | 1,800,000 | 14,220,000.00 | 0.69 |
| 50 | 600869 | 智慧能源 | 1,800,000 | 13,932,000.00 | 0.68 |
| 51 | 002142 | 宁波银行 | 800,000 | 13,312,000.00 | 0.65 |
| 52 | 601699 | 潞安环能 | 1,650,000 | 13,282,500.00 | 0.65 |
| 53 | 600109 | 国金证券 | 1,000,000 | 13,030,000.00 | 0.63 |
| 54 | 600519 | 贵州茅台 | 38,300 | 12,797,945.00 | 0.62 |
| 55 | 300071 | 华谊嘉信 | 1,210,500 | 11,935,530.00 | 0.58 |
| 56 | 600073 | 上海梅林 | 1,000,000 | 11,450,000.00 | 0.56 |
| 57 | 600350 | 山东高速 | 1,710,824 | 11,086,139.52 | 0.54 |
| 58 | 600491 | 龙元建设 | 909,600 | 10,496,784.00 | 0.51 |
| 59 | 603766 | 隆鑫通用 | 500,000 | 10,390,000.00 | 0.50 |
| 60 | 300259 | 新天科技 | 1,000,000 | 10,360,000.00 | 0.50 |
| 61 | 300050 | 世纪鼎利 | 779,742 | 10,222,417.62 | 0.50 |
| 62 | 300064 | 豫金刚石 | 874,200 | 9,922,170.00 | 0.48 |
| 63 | 600487 | 亨通光电 | 500,000 | 9,330,000.00 | 0.45 |
| 64 | 600584 | 长电科技 | 500,000 | 8,825,000.00 | 0.43 |
| 65 | 300274 | 阳光电源 | 800,000 | 8,432,000.00 | 0.41 |
| 66 | 300078 | 思创医惠 | 300,000 | 7,773,000.00 | 0.38 |
| 67 | 601126 | 四方股份 | 772,579 | 7,517,193.67 | 0.37 |
| 68 | 002367 | 康力电梯 | 550,000 | 7,265,500.00 | 0.35 |
| 69 | 603686 | 龙马环卫 | 211,400 | 7,001,568.00 | 0.34 |
| 70 | 300129 | 泰胜风能 | 800,000 | 7,000,000.00 | 0.34 |
| 71 | 300154 | 瑞凌股份 | 500,000 | 5,140,000.00 | 0.25 |
| 72 | 600388 | 龙净环保 | 400,000 | 4,948,000.00 | 0.24 |
| 73 | 000598 | 兴蓉环境 | 800,000 | 4,608,000.00 | 0.22 |
| 74 | 002051 | 中工国际 | 200,000 | 4,584,000.00 | 0.22 |
| 75 | 300098 | 高新兴 | 250,000 | 3,960,000.00 | 0.19 |
| 76 | 000501 | 鄂武商 A | 200,000 | 3,904,000.00 | 0.19 |
| 77 | 000823 | 超声电子 | 300,000 | 3,729,000.00 | 0.18 |
| 78 | 002249 | 大洋电机 | 200,000 | 1,726,000.00 | 0.08 |
| 79 | 000983 | 西山煤电 | 200,000 | 1,692,000.00 | 0.08 |
| 80 | 603823 | 百合花 | 36,764 | 1,203,653.36 | 0.06 |
| 81 | 300165 | 天瑞仪器 | 102,600 | 1,026,000.00 | 0.05 |
| 82 | 603660 | 苏州科达 | 26,007 | 837,945.54 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 83 | 002553 | 南方轴承 | 50,537 | 621,605.10 | 0.03 |
| 84 | 600996 | 贵广网络 | 12,500 | 234,875.00 | 0.01 |
| 85 | 603986 | 兆易创新 | 1,133 | 201,640.01 | 0.01 |
| 86 | 601375 | 中原证券 | 26,695 | 106,780.00 | 0.01 |
| 87 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641 | 88,403.48 | 0.00 |
| 88 | 603228 | 景旺电子 | 3,491 | 80,851.56 | 0.00 |
| 89 | 002832 | 比音勒芬 | 1,158 | 70,290.60 | 0.00 |
| 90 | 603577 | 汇金通 | 2,460 | 69,642.60 | 0.00 |
| 91 | 603218 | 日月股份 | 1,652 | 68,805.80 | 0.00 |
| 92 | 603877 | 太平鸟 | 3,180 | 67,734.00 | 0.00 |
| 93 | 300583 | 赛托生物 | 1,582 | 63,738.78 | 0.00 |
| 94 | 002826 | 易明医药 | 2,181 | 57,316.68 | 0.00 |
| 95 | 603416 | 信捷电气 | 1,076 | 53,886.08 | 0.00 |
| 96 | 002833 | 弘亚数控 | 2,743 | 48,331.66 | 0.00 |
| 97 | 603389 | 亚振家居 | 1,963 | 47,327.93 | 0.00 |
| 98 | 603058 | 永吉股份 | 3,869 | 42,675.07 | 0.00 |
| 99 | 603886 | 元祖股份 | 2,242 | 39,683.40 | 0.00 |
| 100 | 603689 | 皖天然气 | 4,818 | 37,917.66 | 0.00 |
| 101 | 300582 | 英飞特 | 1,359 | 35,157.33 | 0.00 |
| 102 | 603239 | 浙江仙通 | 924 | 29,059.80 | 0.00 |
| 103 | 002835 | 同为股份 | 1,126 | 24,220.26 | 0.00 |
| 104 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | 0.00 |
| 105 | 603266 | 天龙股份 | 1,562 | 22,852.06 | 0.00 |
| 106 | 300587 | 天铁股份 | 1,438 | 20,290.18 | 0.00 |
| 107 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | 0.00 |
| 108 | 002840 | 华统股份 | 1,814 | 11,881.70 | 0.00 |
| 109 | 002838 | 道恩股份 | 681 | 10,405.68 | 0.00 |
| 110 | 603186 | 华正新材 | 1,874 | 10,063.38 | 0.00 |
| 111 | 603032 | 德新交运 | 1,628 | 9,458.68 | 0.00 |
| 112 | 300586 | 美联新材 | 1,006 | 9,355.80 | 0.00 |
| 113 | 300591 | 万里马 | 2,397 | 7,358.79 | 0.00 |
| 114 | 300588 | 熙菱信息 | 1,380 | 6,817.20 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值 |
|----|------|------|----------|-----------|
|----|------|------|----------|-----------|

| | | | | 比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|--------|
| 1 | 002245 | 澳洋顺昌 | 72,239,420.79 | 2.50 |
| 2 | 600987 | 航民股份 | 50,018,235.33 | 1.73 |
| 3 | 300351 | 永贵电器 | 43,374,969.40 | 1.50 |
| 4 | 601699 | 潞安环能 | 42,661,966.80 | 1.48 |
| 5 | 002376 | 新北洋 | 39,719,477.46 | 1.38 |
| 6 | 300079 | 数码视讯 | 37,919,133.86 | 1.31 |
| 7 | 002206 | 海利得 | 35,881,350.44 | 1.24 |
| 8 | 600219 | 南山铝业 | 35,314,997.00 | 1.22 |
| 9 | 002396 | 星网锐捷 | 32,367,996.34 | 1.12 |
| 10 | 300271 | 华宇软件 | 31,545,111.24 | 1.09 |
| 11 | 002358 | 森源电气 | 29,565,726.12 | 1.02 |
| 12 | 600172 | 黄河旋风 | 28,632,285.05 | 0.99 |
| 13 | 600787 | 中储股份 | 27,109,613.62 | 0.94 |
| 14 | 000910 | 大亚圣象 | 26,857,479.35 | 0.93 |
| 15 | 300011 | 鼎汉技术 | 26,358,775.69 | 0.91 |
| 16 | 002033 | 丽江旅游 | 26,028,829.00 | 0.90 |
| 17 | 600303 | 曙光股份 | 25,990,044.32 | 0.90 |
| 18 | 300408 | 三环集团 | 25,591,854.36 | 0.89 |
| 19 | 300115 | 长盈精密 | 25,263,107.29 | 0.88 |
| 20 | 600502 | 安徽水利 | 24,985,627.37 | 0.87 |

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 | 600271 | 航天信息 | 57,849,819.67 | 2.00 |
| 2 | 002245 | 澳洋顺昌 | 49,224,143.73 | 1.71 |
| 3 | 600708 | 光明地产 | 39,186,250.52 | 1.36 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 39,160,743.92 | 1.36 |
| 5 | 601699 | 潞安环能 | 37,878,335.82 | 1.31 |
| 6 | 002157 | 正邦科技 | 37,078,367.05 | 1.28 |
| 7 | 002063 | 远光软件 | 34,869,554.04 | 1.21 |
| 8 | 601928 | 凤凰传媒 | 33,121,837.36 | 1.15 |
| 9 | 000977 | 浪潮信息 | 33,010,515.00 | 1.14 |
| 10 | 600787 | 中储股份 | 32,761,548.14 | 1.14 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 002358 | 森源电气 | 32,666,688.79 | 1.13 |
| 12 | 300115 | 长盈精密 | 31,556,699.70 | 1.09 |
| 13 | 002573 | 清新环境 | 29,898,823.34 | 1.04 |
| 14 | 000678 | 襄阳轴承 | 29,871,841.55 | 1.03 |
| 15 | 600303 | 曙光股份 | 29,572,116.00 | 1.02 |
| 16 | 300145 | 中金环境 | 29,249,203.49 | 1.01 |
| 17 | 002033 | 丽江旅游 | 29,057,709.10 | 1.01 |
| 18 | 601877 | 正泰电器 | 28,152,003.66 | 0.98 |
| 19 | 300237 | 美晨科技 | 27,978,786.00 | 0.97 |
| 20 | 601098 | 中南传媒 | 27,863,748.15 | 0.97 |

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 | 1,727,585,331.15 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,067,009,362.45 |

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 | 194,369,400.00 | 9.45 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 238,071,884.80 | 11.57 |
| | 其中：政策性金融债 | 238,071,884.80 | 11.57 |
| 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 | 432,441,284.80 | 21.02 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

| | | | | | |
|---|--------|---------------|-----------|----------------|------|
| 1 | 010107 | 21 国债(7) | 1,560,000 | 164,408,400.00 | 7.99 |
| 2 | 150210 | 15 国开 10 | 1,200,000 | 123,060,000.00 | 5.98 |
| 3 | 130231 | 13 国开 31 | 1,000,000 | 102,160,000.00 | 4.97 |
| 4 | 160011 | 16 付息国债 11 | 300,000 | 29,961,000.00 | 1.46 |
| 5 | 018002 | 国开 1302 | 122,820 | 12,851,884.80 | 0.62 |

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，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 | 391,336.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,559,192.24 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,950,529.17 |

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 | 300271 | 华宇软件 | 29,359,782.05 | 1.43 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002396 | 星网锐捷 | 29,232,000.00 | 1.42 | 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

| 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 |
| 17,811 | 112,290.16 | 1,190,746,890.00 | 59.54% | 809,253,110.00 | 40.46% |

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 | 伦敦市投资管理有限公司— 客户资金 | 127,924,475.00 | 6.40% |
| 2 | 泰康人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品 —019L-CT001 深 | 92,423,204.00 | 4.62% |
| 3 | 泰康人寿保险股份有限公司 —万能—一个险万能 | 78,548,056.00 | 3.93% |
| 4 | 建信人寿保险有限公司—普 通 | 63,522,122.00 | 3.18% |
| 5 | 中国人寿保险股份有限公司 | 57,406,870.00 | 2.87% |
| 6 | 中国证券金融股份有限公司 转融通担保证券账户 | 49,970,000.00 | 2.50% |
| 7 | 中国人寿资产管理有限公司 | 47,035,481.00 | 2.35% |
| 8 | 泰康人寿保险股份有限公司 —分红—个人分红 —019L-FH002 深 | 46,341,141.00 | 2.32% |
| 9 | 工银瑞信基金—农业银行— 吉祥人寿保险—吉祥人寿万 能产品 | 46,189,985.00 | 2.31% |
| 10 | 长城基金管理有限公司 | 44,988,500.00 | 2.25% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

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

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

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

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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十万元。

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 8 年。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信证券 | 2 | 1,363,193,514.10 | 36.00% | 1,269,542.21 | 36.00% | - |
| 东兴证券 | 1 | 673,659,177.34 | 17.79% | 627,378.11 | 17.79% | - |
| 中信建投 | 1 | 636,151,787.60 | 16.80% | 592,448.56 | 16.80% | - |
| 西南证券 | 1 | 589,971,484.09 | 15.58% | 549,439.82 | 15.58% | - |
| 招商证券 | 2 | 169,002,711.94 | 4.46% | 157,392.16 | 4.46% | - |
| 长城证券 | 3 | 139,766,949.72 | 3.69% | 130,165.28 | 3.69% | - |
| 国泰君安 | 2 | 104,150,074.42 | 2.75% | 96,995.25 | 2.75% | - |
| 银河证券 | 2 | 88,391,795.56 | 2.33% | 82,319.62 | 2.33% | - |
| 大同证券 | 1 | 22,474,089.90 | 0.59% | 20,930.12 | 0.59% | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：本报告期内共减少方正证券及其 1 个交易单元。截止本报告期末共计 31 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 107,927,640.40 | 70.66% | 160,000,000.00 | 55.17% | - | - |
| 中信建投 | 43,297,395.90 | 28.35% | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | 130,000,000.00 | 44.83% | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1,509,834.80 | 0.99% | - | - | - | - |
| 大同证券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 民族证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 |
| 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6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8日 |
| 4 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016年1月12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13日 |
| 6 | 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 | 2016年1月13日 |

| | | | |
|----|---------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| | | 券日报及本基金管理人网站 | |
| 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 14 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 20 日 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 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 |

| | | | |
|----|---------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| | | 理人网站 | |
| 14 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 2 月 4 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 2 月 26 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 3 月 1 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 3 月 3 日 |
| 18 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 3 月 19 日 |
| 19 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 4 月 6 日 |
| 20 | 久嘉证券投资基金 2015 年年度收益分配公告 | 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 4 月 20 日 |
| 21 | 长城基金管理有限公司关于调整 | 中国证券报、上海证 | 2016 年 4 月 21 日 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|--------------------------------|-----------------|
| | 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 | |
| 22 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 5 月 6 日 |
| 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 5 月 10 日 |
| 24 | 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 |
| 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 5 月 11 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 6 月 1 日 |
| 27 | 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 |
| 28 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证 | 2016 年 6 月 18 日 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|--------------------------------|------------------|
| | 的公告 | 券日报及本基金管理人网站 | |
| 29 | 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 |
| 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 7 月 5 日 |
| 31 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 7 月 7 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 7 月 8 日 |
| 33 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 9 月 8 日 |
| 34 | 关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2016 年 10 月 19 日 |
| 35 | 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 |
| 36 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证 | 2016 年 11 月 12 日 |

| | | | |
|----|---------------------------------|--------------------------------|------------------|
| | 的公告 | 券日报及本基金管理人网站 | |
| 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 12 月 13 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (二) 《久嘉证券投资基金基金合同》
- (三) 《久嘉证券投资基金招募说明书》
- (四) 《久嘉证券投资基金托管协议》
- (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

11.2 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

11.3 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