

长城医疗保健混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长城医疗保健混合
基金主代码	000339
交易代码	000339
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 28 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	117,279,070.92 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于医疗保健行业上市公司，在控制风险的前提下，采用积极主动的投资策略，力求实现超越业绩比较基准的表现。
投资策略	<p>本基金为混合型证券投资基金，将依据市场情况调整大类资产配置比例。本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。</p> <p>医疗保健行业包括化学制药行业、中药行业、生物制品行业、医药商业行业、医疗器械行业和医疗服务行业等子行业。本基金将根据不同子行业的商业模式、运行特点、行业竞争环境等因素进行差异化分析，精选不同子行业的优秀企业进行股票投资组合构建。</p>
业绩比较基准	90%×中证医药卫生指数收益率+10%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于指数型基金、股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金产品。

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	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	16,827,235.93	41,234,950.51	217,793,052.39
本期利润	17,230,947.02	-42,394,000.74	270,744,019.45
加权平均基金份额本期利润	0.1130	-0.2981	0.5191
本期基金份额净值增长率	9.98%	-3.09%	40.06%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5542	0.4134	0.4576
期末基金资产净值	182,277,444.73	174,221,168.15	394,525,557.29
期末基金份额净值	1.554	1.413	1.458

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

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

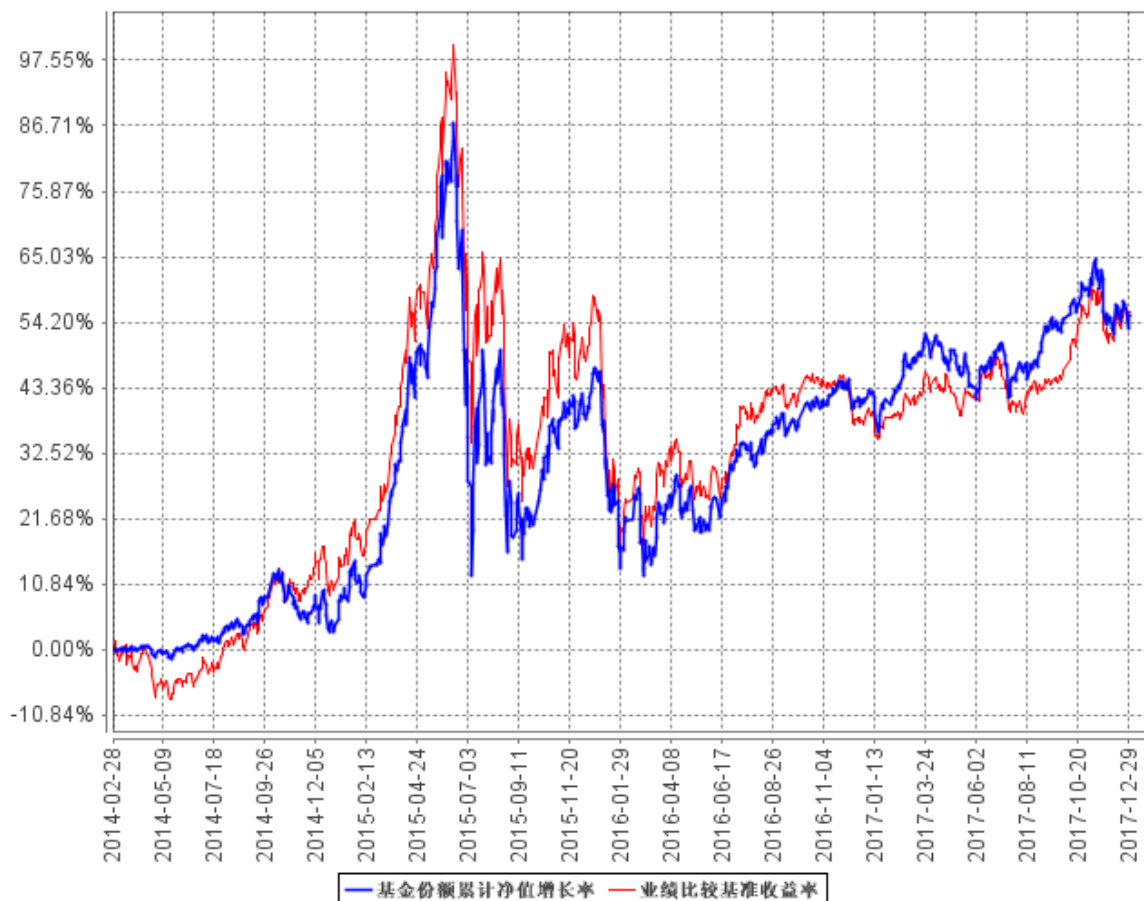
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.52%	0.92%	6.56%	0.93%	-6.04%	-0.01%
过去六个月	3.67%	0.82%	5.05%	0.77%	-1.38%	0.05%
过去一年	9.98%	0.76%	12.40%	0.69%	-2.42%	0.07%
过去三年	49.28%	1.69%	40.65%	1.65%	8.63%	0.04%
自基金合同生效起至今	55.40%	1.53%	55.73%	1.52%	-0.33%	0.01%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

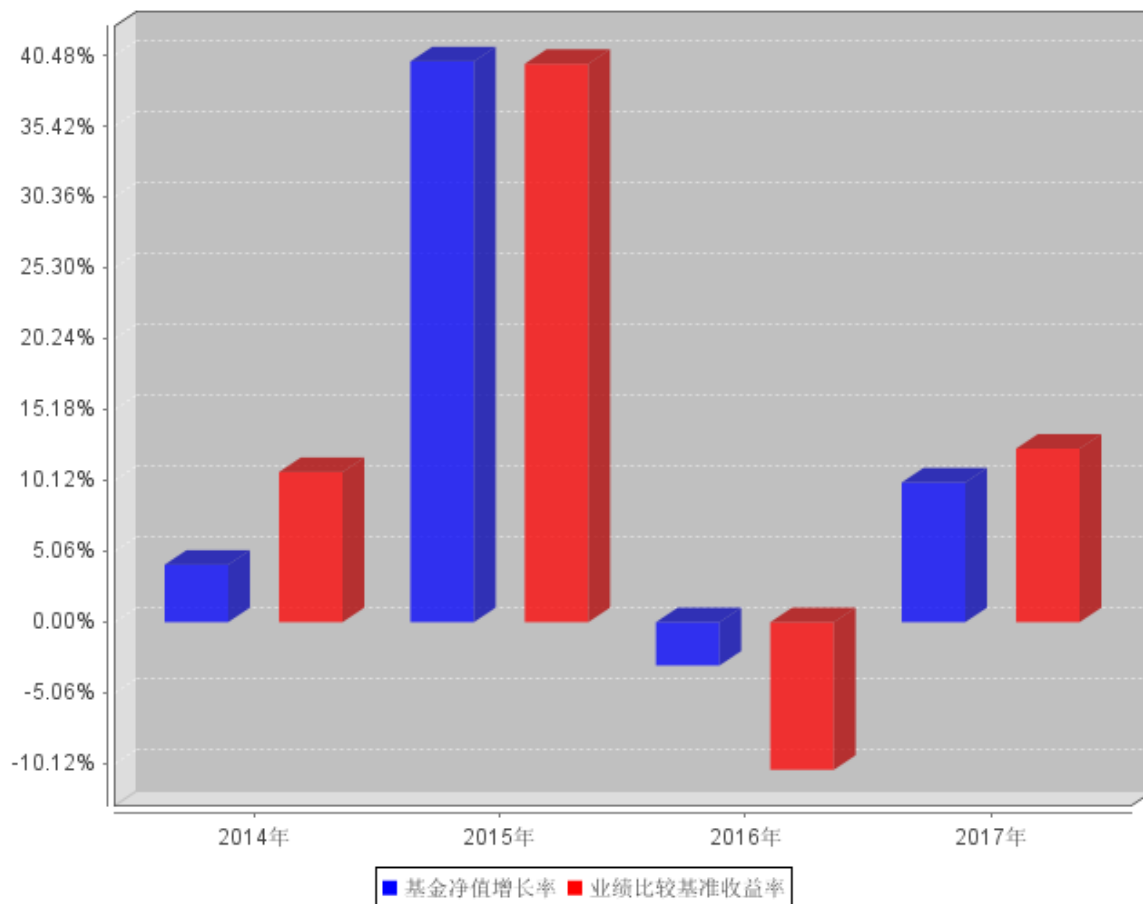


注：①本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于医疗保健行业上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 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：本基金基金合同于 2014 年 02 月 28 日生效，自基金合同生效以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有：长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金、长城

收益宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
谭小兵	长城医疗保健混合、长城中国智造混合基金的基金经理	2016年2月3日	-	9年	女，中国籍，工学学士、管理学硕士。曾就职于联邦制药(成都)有限公司、东莞证券有限责任公司、信达澳银基金管理有限公司。2014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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城医疗保健混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

17 年医药行业在全市场中表现一般，白马股表现不错，题材概念股与小市值公司跌跌不休。本基金主要资产配置在稳定增长的细分龙头个股，估值相对较高的配置较少，因此业绩表现稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 9.98%，业绩比较基准收益率为 12.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，今年会是医药政策的大年，相对以往会多几重利好，一是疾风骤雨般的控费压力将转化为细水长流，从而能让行业形势逐步好转；二是药品审批正本清源、接轨国际，研发型企业会明显受益。在这双重政策下，优势龙头企业明显会有一个市场份额提升过程，虽然这个过程会是较为缓慢，但叠加市场低迷之后医药板块的整体估值已回落不少，优质公司的长期投资价值已趋现。具体操作上，我们看好具有产品创新和商业模式创新的龙头公司，本基金将逐步调整和优化组合，争取在控制风险的前提下竭力改善基金的投资绩效。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城医疗保健混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		12,028,734.84	42,056,862.79
结算备付金		3,641,737.08	829,981.85
存出保证金		186,265.38	87,511.46
交易性金融资产		157,739,393.83	130,708,213.37
其中：股票投资		157,739,393.83	130,708,213.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		18,638,048.82	1,428,577.17
应收利息		-2,659.59	10,933.29
应收股利		-	-
应收申购款		63,307.58	29,049.30
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		192,294,827.94	175,151,129.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,735,666.05	46,901.53
应付赎回款		93,734.64	113,737.91
应付管理人报酬		232,312.17	222,210.88
应付托管费		38,718.71	37,035.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,572,380.58	445,533.34
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		344,571.06	64,542.25
负债合计		10,017,383.21	929,961.08
所有者权益：			
实收基金		117,279,070.92	123,264,907.75
未分配利润		64,998,373.81	50,956,260.40
所有者权益合计		182,277,444.73	174,221,168.15
负债和所有者权益总计		192,294,827.94	175,151,129.23

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.554 元，基金份额总额 117,279,070.92 份。

7.2 利润表

会计主体：长城医疗保健混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		27,318,764.07	-36,248,797.56
1. 利息收入		873,645.76	420,448.69
其中：存款利息收入		381,550.27	346,484.52
债券利息收入		8.22	73,964.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		492,087.27	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		25,633,884.33	46,664,415.26
其中：股票投资收益		24,193,400.25	45,831,674.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益		376.58	31,269.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,440,107.50	801,471.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		403,711.09	-83,628,951.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		407,522.89	295,289.74

减：二、费用		10,087,817.05	6,145,203.18
1. 管理人报酬		3,408,522.22	2,783,529.21
2. 托管费		568,087.10	463,921.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		5,740,773.90	2,511,451.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		370,433.83	386,301.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,230,947.02	-42,394,000.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,230,947.02	-42,394,000.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城医疗保健混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	123,264,907.75	50,956,260.40	174,221,168.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,230,947.02	17,230,947.02
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）	-5,985,836.83	-3,188,833.61	-9,174,670.44
其中：1. 基金申购款	128,071,122.85	66,475,305.20	194,546,428.05
2. 基金赎回款	-134,056,959.68	-69,664,138.81	-203,721,098.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	117,279,070.92	64,998,373.81	182,277,444.73

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	270,668,061.49	123,857,495.80	394,525,557.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,394,000.74	-42,394,000.74
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）	-147,403,153.74	-30,507,234.66	-177,910,388.40
其中：1. 基金申购款	77,476,027.65	24,362,583.48	101,838,611.13
2. 基金赎回款	-224,879,181.39	-54,869,818.14	-279,748,999.53
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）	123,264,907.75	50,956,260.40	174,221,168.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城医疗保健混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名为长城医疗保健股票型证券投资基金,系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1143号文“关于核准长城医疗保健股票型证券投资基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司向社会公开募集,首次设立募集的规模为2,567,301,822.20份基金份额。基金合同于2014年2月28日生效。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,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。根据2014年8月8日开始施行的《公开募集证券投资基金运作

管理办法》和《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》以及相关基金合同的有关规定，经与相关基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，长城基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“长城医疗保健股票型证券投资基金”更名为“长城医疗保健混合型证券投资基金”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等)、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于医疗保健行业上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；其余资产投资于债券、权证、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为： $90\% \times \text{中证医药卫生指数收益率} + 10\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计除以下说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致：

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

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

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

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

2. 营业税、增值税、企业所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持

有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

3. 个人所得税

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

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

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
长城证券	685,380,777.00	18.15%	114,457,096.62	7.12%
东方证券	-	-	5,334,968.00	0.33%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
长城证券	-	-	53,794.24	0.52%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
长城证券	116,200,000.00	5.58%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年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	638,294.99	18.15%	178,848.02	11.37%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	106,594.21	7.12%	47,109.85	10.57%
东方证券	4,968.68	0.33%	-	-

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

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,408,522.22	2,783,529.21
其中：支付销售机构的客户维护费	897,428.35	897,427.86

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	568,087.10	463,921.50

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	12,028,734.84	343,280.78	42,056,862.79	335,710.22

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002859	洁美科技	2017年3月24日	2018年4月9日	新股锁定	29.82	33.80	16,665	198,780.12	563,277.00	-
300713	英可瑞	2017年10月23日	2018年11月1日	新股锁定	40.29	74.87	7,008	282,352.32	524,688.96	-
002892	科力尔	2017年8月10日	2018年8月17日	新股锁定	17.56	32.16	11,000	193,160.00	353,760.00	-
002860	星帅尔	2017年3月31日	2018年4月12日	新股锁定	19.81	39.79	7,980	158,083.80	317,524.20	-
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-

注：根据洁美科技 2017 年半年度权益分派实施公告，洁美科技以公司现有总股本

102,280,000 股为基数，向全体股东每 10 股派送 4.00 元人民币现金，同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 15 股，除权除息日为 2017 年 9 月 15 日。本基金所持有的洁美科技获得转增股 9,999 股。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
300492	山鼎设计	2017年 6月6日	重大事 项停牌	50.78	2018年 2月 27日	41.38	280,000	13,640,974.85	14,218,400.00	-
300156	神雾环保	2017年 7月17日	重大事 项停牌	23.68	2018年 1月 17日	21.74	180,000	5,016,812.60	4,262,400.00	-
600146	商赢环球	2017年 9月5日	重大事 项停牌	22.11	2018年 1月 16日	22.88	120,000	4,179,227.00	2,653,200.00	-
300730	科创信息	2017年 12月 25日	重大事 项停牌	41.55	2018年 1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年 12月 28日	重大事 项停牌	35.26	2018年 1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**7.4.10.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 134,713,778.67 元，划分为第二层次的余额为人民币 23,025,615.16 元，无划分为第三层次的余额。于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 130,417,495.20 元，划分为第二层次的余额为人民币 290,718.17 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

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

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	157,739,393.83	82.03
	其中：股票	157,739,393.83	82.03
2	基金投资		
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,670,471.92	8.15
8	其他各项资产	18,884,962.19	9.82
9	合计	192,294,827.94	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	-	-
C	制造业	114,238,895.08	62.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	17,717,503.00	9.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.02
J	金融业	4,057,560.00	2.23
K	房地产业	3,524,950.00	1.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,218,400.00	7.80
N	水利、环境和公共设施管理业	1,782,533.20	0.98

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,165,440.00	1.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	157,739,393.83	86.54

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	142,000	14,454,180.00	7.93
2	300492	山鼎设计	280,000	14,218,400.00	7.80
3	000963	华东医药	167,000	8,997,960.00	4.94
4	600276	恒瑞医药	107,000	7,380,860.00	4.05
5	600196	复星医药	157,000	6,986,500.00	3.83
6	002422	科伦药业	258,700	6,441,630.00	3.53
7	000661	长春高新	31,730	5,806,590.00	3.19
8	300122	智飞生物	197,000	5,529,790.00	3.03
9	300558	贝达药业	86,900	5,499,901.00	3.02
10	600519	贵州茅台	7,200	5,021,928.00	2.76

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

（www.ccfund.com.cn）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	32,170,281.09	18.47
2	601336	新华保险	24,301,250.38	13.95
3	600019	宝钢股份	22,582,754.16	12.96
4	002236	大华股份	20,809,787.01	11.94
5	000423	东阿阿胶	20,752,511.22	11.91
6	002217	合力泰	19,278,033.43	11.07
7	000932	*ST 华菱	19,069,547.03	10.95

8	002273	水晶光电	18,835,103.26	10.81
9	603368	柳州医药	17,872,005.90	10.26
10	600466	蓝光发展	17,685,201.23	10.15
11	600529	山东药玻	16,676,944.83	9.57
12	000807	云铝股份	16,198,650.69	9.30
13	002019	亿帆医药	15,840,563.70	9.09
14	000858	五粮液	14,796,521.70	8.49
15	600196	复星医药	14,471,260.83	8.31
16	002422	科伦药业	13,790,543.24	7.92
17	300492	山鼎设计	13,640,974.85	7.83
18	002245	澳洋顺昌	12,092,721.31	6.94
19	601668	中国建筑	11,955,472.00	6.86
20	000063	中兴通讯	11,943,001.04	6.86
21	002456	欧菲科技	11,780,762.91	6.76
22	603005	晶方科技	11,584,556.72	6.65
23	000661	长春高新	11,421,340.10	6.56
24	000963	华东医药	11,114,516.87	6.38
25	300115	长盈精密	11,105,232.73	6.37
26	000597	东北制药	10,879,191.03	6.24
27	603589	口子窖	10,724,002.37	6.16
28	600030	中信证券	10,715,669.00	6.15
29	000568	泸州老窖	10,523,711.58	6.04
30	600056	中国医药	10,483,032.54	6.02
31	601318	中国平安	10,273,541.00	5.90
32	002007	华兰生物	10,262,576.49	5.89
33	000002	万科A	10,102,808.00	5.80
34	600703	三安光电	9,796,702.40	5.62
35	002262	恩华药业	9,782,959.48	5.62
36	600588	用友网络	9,597,817.00	5.51
37	600518	康美药业	9,566,614.00	5.49
38	002775	文科园林	9,216,746.24	5.29
39	002396	星网锐捷	9,049,076.18	5.19
40	600276	恒瑞医药	8,975,425.19	5.15
41	300036	超图软件	8,911,200.00	5.11
42	002304	洋河股份	8,907,614.20	5.11
43	002385	大北农	8,814,449.50	5.06

44	600079	人福医药	8,675,055.00	4.98
45	002384	东山精密	8,632,823.12	4.96
46	002001	新和成	8,621,018.73	4.95
47	600491	龙元建设	8,615,199.13	4.94
48	600310	桂东电力	8,430,834.78	4.84
49	000018	神州长城	8,407,582.38	4.83
50	600062	华润双鹤	8,146,615.55	4.68
51	300015	爱尔眼科	8,138,750.75	4.67
52	000999	华润三九	8,125,171.00	4.66
53	000078	海王生物	8,092,360.00	4.64
54	000333	美的集团	8,009,362.79	4.60
55	300424	航新科技	7,875,060.00	4.52
56	603626	科森科技	7,868,202.80	4.52
57	300628	亿联网络	7,790,208.00	4.47
58	002640	跨境通	7,773,562.59	4.46
59	600216	浙江医药	7,739,351.83	4.44
60	601225	陕西煤业	7,695,920.82	4.42
61	000725	京东方A	7,629,227.00	4.38
62	000786	北新建材	7,623,743.00	4.38
63	600036	招商银行	7,618,613.00	4.37
64	000915	山大华特	7,595,100.20	4.36
65	002310	东方园林	7,476,004.48	4.29
66	603337	杰克股份	7,468,050.90	4.29
67	600690	青岛海尔	7,326,481.00	4.21
68	300498	温氏股份	7,260,598.03	4.17
69	600867	通化东宝	7,239,094.52	4.16
70	603040	新坐标	7,152,072.01	4.11
71	603883	老百姓	7,099,922.00	4.08
72	300136	信维通信	7,067,820.92	4.06
73	000921	海信科龙	7,008,906.79	4.02
74	002102	冠福股份	7,004,799.00	4.02
75	300545	联得装备	6,923,015.90	3.97
76	300588	熙菱信息	6,904,454.70	3.96
77	002449	国星光电	6,860,985.00	3.94
78	002323	雅百特	6,777,395.80	3.89
79	600763	通策医疗	6,752,305.44	3.88

80	300373	扬杰科技	6,746,801.97	3.87
81	300338	开元股份	6,738,841.63	3.87
82	600525	长园集团	6,736,553.00	3.87
83	000789	万年青	6,701,774.00	3.85
84	600522	中天科技	6,620,646.00	3.80
85	002475	立讯精密	6,610,411.00	3.79
86	600549	厦门钨业	6,540,231.66	3.75
87	002081	金螳螂	6,496,189.50	3.73
88	300146	汤臣倍健	6,448,626.00	3.70
89	600502	安徽水利	6,424,788.75	3.69
90	600581	八一钢铁	6,415,117.81	3.68
91	002024	苏宁易购	6,374,130.57	3.66
92	603008	喜临门	6,371,496.41	3.66
93	600519	贵州茅台	6,310,765.00	3.62
94	600801	华新水泥	6,304,022.07	3.62
95	600809	山西汾酒	6,228,215.15	3.57
96	000823	超声电子	6,057,762.00	3.48
97	002294	信立泰	6,012,762.76	3.45
98	601166	兴业银行	5,966,280.00	3.42
99	601238	广汽集团	5,875,630.00	3.37
100	000928	中钢国际	5,857,981.76	3.36
101	603108	润达医疗	5,807,403.32	3.33
102	300122	智飞生物	5,779,709.82	3.32
103	300156	神雾环保	5,772,329.00	3.31
104	600742	一汽富维	5,702,129.50	3.27
105	300199	翰宇药业	5,674,257.82	3.26
106	300558	贝达药业	5,665,493.00	3.25
107	600498	烽火通信	5,646,194.00	3.24
108	002340	格林美	5,644,567.90	3.24
109	002061	浙江交科	5,641,616.50	3.24
110	600109	国金证券	5,606,370.58	3.22
111	300316	晶盛机电	5,584,167.40	3.21
112	600048	保利地产	5,582,994.06	3.20
113	601636	旗滨集团	5,573,760.00	3.20
114	600340	华夏幸福	5,569,707.00	3.20
115	600436	片仔癀	5,534,502.88	3.18

116	300197	铁汉生态	5,344,192.77	3.07
117	002517	恺英网络	5,277,887.90	3.03
118	601168	西部矿业	5,276,909.00	3.03
119	002555	三七互娱	5,205,526.36	2.99
120	002466	天齐锂业	5,165,110.00	2.96
121	600167	联美控股	5,158,273.87	2.96
122	600176	中国巨石	5,151,374.56	2.96
123	300433	蓝思科技	5,147,840.95	2.95
124	603799	华友钴业	5,143,610.00	2.95
125	002460	赣锋锂业	5,113,115.00	2.93
126	601398	工商银行	5,101,248.00	2.93
127	000012	南玻A	5,071,471.10	2.91
128	600309	万华化学	5,056,860.00	2.90
129	000717	韶钢松山	5,038,176.00	2.89
130	002221	东华能源	5,010,250.95	2.88
131	601666	平煤股份	4,986,303.00	2.86
132	000639	西王食品	4,978,922.20	2.86
133	300432	富临精工	4,955,053.00	2.84
134	300355	蒙草生态	4,937,004.84	2.83
135	600585	海螺水泥	4,882,050.00	2.80
136	002126	银轮股份	4,860,988.95	2.79
137	601601	中国太保	4,859,623.00	2.79
138	002123	梦网集团	4,830,304.94	2.77
139	000887	中鼎股份	4,814,877.00	2.76
140	000957	中通客车	4,812,609.00	2.76
141	601390	中国中铁	4,805,088.00	2.76
142	600438	通威股份	4,801,912.00	2.76
143	603833	欧派家居	4,779,205.19	2.74
144	300203	聚光科技	4,744,644.00	2.72
145	300102	乾照光电	4,731,054.00	2.72
146	600420	现代制药	4,712,323.00	2.70
147	002694	顾地科技	4,697,395.00	2.70
148	600282	南钢股份	4,648,232.69	2.67
149	601988	中国银行	4,549,800.00	2.61
150	600285	羚锐制药	4,482,747.00	2.57
151	300630	普利制药	4,465,379.94	2.56

152	600782	新钢股份	4,457,662.00	2.56
153	002431	棕榈股份	4,443,640.00	2.55
154	000513	丽珠集团	4,437,370.56	2.55
155	300444	双杰电气	4,407,747.50	2.53
156	600426	华鲁恒升	4,371,947.71	2.51
157	002410	广联达	4,324,097.28	2.48
158	600267	海正药业	4,319,948.00	2.48
159	603313	梦百合	4,228,523.00	2.43
160	600521	华海药业	4,188,104.70	2.40
161	600643	爱建集团	4,174,268.00	2.40
162	000566	海南海药	4,119,937.91	2.36
163	601688	华泰证券	4,118,098.34	2.36
164	600111	北方稀土	4,019,107.00	2.31
165	002425	凯撒文化	4,018,653.00	2.31
166	002680	长生生物	3,984,905.00	2.29
167	603328	依顿电子	3,957,162.90	2.27
168	300347	泰格医药	3,951,304.00	2.27
169	002110	三钢闽光	3,942,137.99	2.26
170	600497	驰宏锌锗	3,934,931.00	2.26
171	600569	安阳钢铁	3,921,829.00	2.25
172	600486	扬农化工	3,882,351.00	2.23
173	603986	兆易创新	3,873,572.00	2.22
174	002530	金财互联	3,865,124.00	2.22
175	601222	林洋能源	3,853,091.00	2.21
176	603338	浙江鼎力	3,798,482.00	2.18
177	600987	航民股份	3,795,316.80	2.18
178	603798	康普顿	3,779,391.45	2.17
179	600110	诺德股份	3,768,325.00	2.16
180	600004	白云机场	3,757,163.42	2.16
181	300017	网宿科技	3,725,773.00	2.14
182	300033	同花顺	3,723,846.00	2.14
183	000761	本钢板材	3,717,047.00	2.13
184	603801	志邦股份	3,715,889.32	2.13
185	002709	天赐材料	3,703,224.00	2.13
186	601012	隆基股份	3,702,676.00	2.13
187	300415	伊之密	3,695,548.45	2.12

188	002354	天神娱乐	3,664,477.00	2.10
189	000688	建新矿业	3,643,831.00	2.09
190	002624	完美世界	3,634,509.00	2.09
191	600997	开滦股份	3,624,575.30	2.08
192	300323	华灿光电	3,603,710.95	2.07
193	002241	歌尔股份	3,569,498.00	2.05
194	601600	中国铝业	3,564,906.58	2.05
195	002332	仙琚制药	3,523,400.00	2.02
196	002829	星网宇达	3,509,644.00	2.01
197	603993	洛阳钼业	3,505,068.90	2.01
198	600388	龙净环保	3,502,000.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600019	宝钢股份	22,869,918.27	13.13
2	002236	大华股份	22,222,126.12	12.76
3	601336	新华保险	21,246,558.34	12.20
4	000423	东阿阿胶	20,930,977.99	12.01
5	000932	*ST 华菱	20,925,275.03	12.01
6	002217	合力泰	20,103,630.76	11.54
7	000538	云南白药	19,102,780.95	10.96
8	002007	华兰生物	18,476,735.51	10.61
9	002019	亿帆医药	17,086,069.83	9.81
10	002273	水晶光电	16,572,324.52	9.51
11	000807	云铝股份	16,519,274.48	9.48
12	000858	五粮液	15,065,175.43	8.65
13	300015	爱尔眼科	14,949,813.07	8.58
14	600511	国药股份	14,670,714.25	8.42
15	603368	柳州医药	13,997,285.80	8.03
16	600466	蓝光发展	13,955,462.24	8.01
17	603005	晶方科技	12,579,911.20	7.22
18	000063	中兴通讯	12,420,146.70	7.13
19	600529	山东药玻	12,366,978.18	7.10
20	601668	中国建筑	11,785,030.66	6.76

21	002245	澳洋顺昌	11,785,021.00	6.76
22	002456	欧菲科技	11,586,589.51	6.65
23	300115	长盈精密	11,394,256.85	6.54
24	000597	东北制药	10,964,468.18	6.29
25	600030	中信证券	10,845,851.31	6.23
26	600056	中国医药	10,722,631.86	6.15
27	000963	华东医药	10,709,520.83	6.15
28	002475	立讯精密	10,645,412.05	6.11
29	603589	口子窖	10,469,907.86	6.01
30	601318	中国平安	10,246,266.00	5.88
31	002262	恩华药业	10,078,049.14	5.78
32	000002	万科A	9,945,210.88	5.71
33	600703	三安光电	9,906,467.64	5.69
34	600588	用友网络	9,874,067.51	5.67
35	002001	新和成	9,489,988.00	5.45
36	002396	星网锐捷	9,456,508.00	5.43
37	000566	海南海药	9,373,965.95	5.38
38	600518	康美药业	9,112,853.00	5.23
39	002502	骅威文化	8,792,194.30	5.05
40	002385	大北农	8,776,679.76	5.04
41	002323	雅百特	8,677,174.00	4.98
42	603337	杰克股份	8,641,347.04	4.96
43	000915	山大华特	8,635,061.64	4.96
44	600079	人福医药	8,533,486.00	4.90
45	300036	超图软件	8,511,175.00	4.89
46	600276	恒瑞医药	8,495,801.06	4.88
47	002384	东山精密	8,386,808.00	4.81
48	603626	科森科技	8,260,484.94	4.74
49	000078	海王生物	8,259,431.50	4.74
50	600062	华润双鹤	8,113,865.20	4.66
51	600196	复星医药	8,099,144.00	4.65
52	002775	文科园林	8,044,027.05	4.62
53	600690	青岛海尔	8,043,385.24	4.62
54	000018	神州长城	8,000,081.67	4.59
55	600491	龙元建设	7,958,672.56	4.57
56	000725	京东方A	7,938,600.00	4.56
57	000999	华润三九	7,856,293.32	4.51
58	300628	亿联网络	7,809,125.00	4.48

59	601225	陕西煤业	7,801,521.98	4.48
60	300136	信维通信	7,739,118.00	4.44
61	000568	泸州老窖	7,643,342.10	4.39
62	000661	长春高新	7,595,035.20	4.36
63	600216	浙江医药	7,528,283.77	4.32
64	002640	跨境通	7,484,506.34	4.30
65	002460	赣锋锂业	7,449,736.64	4.28
66	600036	招商银行	7,427,182.00	4.26
67	002422	科伦药业	7,318,190.38	4.20
68	000921	海信科龙	7,286,512.89	4.18
69	603040	新坐标	7,284,963.56	4.18
70	002310	东方园林	7,276,752.26	4.18
71	000786	北新建材	7,276,262.92	4.18
72	300498	温氏股份	7,267,519.12	4.17
73	002449	国星光电	7,078,279.68	4.06
74	002102	冠福股份	7,067,567.40	4.06
75	300197	铁汉生态	6,980,874.48	4.01
76	300373	扬杰科技	6,907,462.25	3.96
77	600310	桂东电力	6,869,210.00	3.94
78	300588	熙菱信息	6,852,168.32	3.93
79	300146	汤臣倍健	6,810,046.00	3.91
80	000333	美的集团	6,750,682.85	3.87
81	300424	航新科技	6,677,053.50	3.83
82	600525	长园集团	6,645,316.20	3.81
83	000789	万年青	6,637,383.43	3.81
84	600549	厦门钨业	6,538,754.20	3.75
85	000823	超声电子	6,471,399.74	3.71
86	600522	中天科技	6,456,223.00	3.71
87	600809	山西汾酒	6,448,574.68	3.70
88	600581	八一钢铁	6,397,336.26	3.67
89	600801	华新水泥	6,257,136.00	3.59
90	600742	一汽富维	6,243,840.51	3.58
91	603008	喜临门	6,233,800.08	3.58
92	002024	苏宁易购	6,213,214.65	3.57
93	002081	金螳螂	6,160,310.43	3.54
94	600436	片仔癀	6,133,828.81	3.52
95	002304	洋河股份	6,032,173.86	3.46
96	601166	兴业银行	6,013,674.00	3.45

97	601238	广汽集团	5,999,828.00	3.44
98	600502	安徽水利	5,939,088.23	3.41
99	000928	中钢国际	5,778,470.00	3.32
100	000957	中通客车	5,770,448.00	3.31
101	002061	浙江交科	5,767,809.00	3.31
102	002340	格林美	5,699,174.40	3.27
103	300316	晶盛机电	5,670,712.00	3.25
104	601636	旗滨集团	5,649,929.16	3.24
105	603108	润达医疗	5,589,829.68	3.21
106	600048	保利地产	5,543,284.00	3.18
107	600340	华夏幸福	5,481,460.63	3.15
108	600167	联美控股	5,466,703.36	3.14
109	300338	开元股份	5,455,924.00	3.13
110	002466	天齐锂业	5,442,755.00	3.12
111	002425	凯撒文化	5,417,292.56	3.11
112	600109	国金证券	5,394,665.73	3.10
113	002431	棕榈股份	5,374,861.09	3.09
114	600498	烽火通信	5,373,315.57	3.08
115	601168	西部矿业	5,277,611.00	3.03
116	300199	翰宇药业	5,242,166.50	3.01
117	002555	三七互娱	5,229,466.44	3.00
118	300545	联得装备	5,205,033.20	2.99
119	600821	津劝业	5,121,874.43	2.94
120	300433	蓝思科技	5,117,632.00	2.94
121	002517	恺英网络	5,109,532.00	2.93
122	601666	平煤股份	5,107,893.34	2.93
123	000012	南玻A	5,078,915.18	2.92
124	002223	鱼跃医疗	5,078,848.51	2.92
125	000958	东方能源	5,071,400.00	2.91
126	600176	中国巨石	5,062,652.40	2.91
127	002221	东华能源	5,007,418.19	2.87
128	000887	中鼎股份	5,005,360.98	2.87
129	601398	工商银行	4,954,400.00	2.84
130	603833	欧派家居	4,934,222.20	2.83
131	002126	银轮股份	4,915,203.10	2.82
132	300432	富临精工	4,899,157.00	2.81
133	300355	蒙草生态	4,879,252.02	2.80
134	002123	梦网集团	4,875,626.38	2.80

135	600585	海螺水泥	4,872,557.11	2.80
136	600309	万华化学	4,850,708.40	2.78
137	600763	通策医疗	4,835,507.80	2.78
138	000717	韶钢松山	4,815,720.00	2.76
139	600782	新钢股份	4,794,899.00	2.75
140	600713	南京医药	4,792,873.00	2.75
141	002110	三钢闽光	4,731,180.00	2.72
142	601390	中国中铁	4,689,662.04	2.69
143	002694	顾地科技	4,651,253.00	2.67
144	603883	老百姓	4,632,210.00	2.66
145	600282	南钢股份	4,631,328.00	2.66
146	601601	中国太保	4,613,001.40	2.65
147	601988	中国银行	4,596,300.00	2.64
148	600829	人民同泰	4,592,728.58	2.64
149	300102	乾照光电	4,578,496.00	2.63
150	000513	丽珠集团	4,564,694.00	2.62
151	603799	华友钴业	4,528,120.55	2.60
152	600521	华海药业	4,448,152.00	2.55
153	002586	围海股份	4,400,816.00	2.53
154	600420	现代制药	4,377,795.00	2.51
155	300444	双杰电气	4,350,675.12	2.50
156	600426	华鲁恒升	4,345,117.87	2.49
157	000639	西王食品	4,328,510.43	2.48
158	300078	思创医惠	4,312,181.37	2.48
159	600285	羚锐制药	4,283,187.00	2.46
160	603313	梦百合	4,244,545.52	2.44
161	002410	广联达	4,242,302.00	2.44
162	603338	浙江鼎力	4,204,500.60	2.41
163	601688	华泰证券	4,121,863.60	2.37
164	600110	诺德股份	4,117,887.02	2.36
165	600267	海正药业	4,116,770.00	2.36
166	600569	安阳钢铁	4,064,369.00	2.33
167	600004	白云机场	4,040,310.80	2.32
168	600497	驰宏锌锗	4,016,665.00	2.31
169	300347	泰格医药	3,905,742.00	2.24
170	601222	林洋能源	3,896,535.00	2.24
171	002680	长生生物	3,862,155.43	2.22
172	603328	依顿电子	3,852,934.50	2.21

173	300572	安车检测	3,829,326.00	2.20
174	600486	扬农化工	3,806,261.20	2.18
175	603986	兆易创新	3,786,918.58	2.17
176	600997	开滦股份	3,769,216.00	2.16
177	002530	金财互联	3,759,997.45	2.16
178	600643	爱建集团	3,730,474.59	2.14
179	601600	中国铝业	3,722,343.03	2.14
180	300033	同花顺	3,718,738.00	2.13
181	600138	中青旅	3,693,234.63	2.12
182	603801	志邦股份	3,686,330.64	2.12
183	600987	航民股份	3,673,280.00	2.11
184	600867	通化东宝	3,665,654.08	2.10
185	600487	亨通光电	3,657,631.32	2.10
186	002332	仙琚制药	3,619,529.20	2.08
187	603993	洛阳钼业	3,599,347.00	2.07
188	002624	完美世界	3,598,433.50	2.07
189	002241	歌尔股份	3,573,528.00	2.05
190	002459	天业通联	3,570,889.80	2.05
191	300017	网宿科技	3,564,676.00	2.05
192	000688	建新矿业	3,558,461.09	2.04
193	601012	隆基股份	3,535,599.42	2.03
194	300323	华灿光电	3,530,258.00	2.03
195	002709	天赐材料	3,520,700.34	2.02
196	603798	康普顿	3,507,224.25	2.01
197	000761	本钢板材	3,498,810.00	2.01
198	600111	北方稀土	3,492,753.00	2.00

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	1,891,764,746.41
卖出股票收入（成交）总额	1,889,330,677.29

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：本基金本报告期末进行股指期货投资，期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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	186,265.38
2	应收证券清算款	18,638,048.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-2,659.59
5	应收申购款	63,307.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,884,962.19

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	300492	山鼎设计	14,218,400.00	7.80	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
5,796	20,234.48	32,492,705.57	27.71%	84,786,365.35	72.29%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	5,626.56	0.0048%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年2月28日）基金份额总额	2,567,301,822.20
本报告期期初基金份额总额	123,264,907.75
本报告期基金总申购份额	128,071,122.85
减:本报告期基金总赎回份额	134,056,959.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	117,279,070.92

§ 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

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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	
长江证券	1	845,258,058.27	22.39%	787,190.34	22.39%	-
长城证券	3	685,380,777.00	18.15%	638,294.99	18.15%	-
申万宏源	1	649,941,275.55	17.21%	605,288.82	17.21%	-
华创证券	1	615,552,086.05	16.30%	573,262.51	16.30%	-
招商证券	2	329,297,154.00	8.72%	306,674.67	8.72%	-
平安证券	2	306,119,790.23	8.11%	285,090.28	8.11%	-
海通证券	2	267,963,939.49	7.10%	249,554.17	7.10%	-
安信证券	2	51,725,089.25	1.37%	48,171.22	1.37%	-
国信证券	2	24,645,387.14	0.65%	22,952.23	0.65%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	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	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共新增 3 个专用交易单元（方正证券新增 2 个交易单元，安信证券新增 1 个交易单元），截止本报告期末共计 54 个交易单元。

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	48,484.80	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	116,200,000.00	5.58%	-	-
申万宏源	-	-	361,000,000.00	17.34%	-	-
华创证券	-	-	1,604,300,000.00	77.07%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170330-20170405, 20170816-20171231	-	32,492,705.57	-	32,492,705.57	27.7055%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

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

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

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

3、基金净值波动风险

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

4、投资受限风险

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

5、基金合同终止或转型风险

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。