

长城久鼎保本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 | 长城久鼎保本 |
| 基金主代码 | 002542 |
| 交易代码 | 002542 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 21 日 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,604,768,547.83 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在固定收益类资产和风险资产之间的大类资产配置策略；另一层为固定收益类资产的投资策略和风险资产的投资策略。</p> <p>本基金采用固定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整固定收益类资产与风险资产的投资比例，以保证基金资产在 3 年保本周期末本金安全，并力争实现基金资产的保值增值。</p> |
| 业绩比较基准 | 3 年期银行定期存款税后收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|----------------------|----------------------|
| 名称 | | 长城基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 车君 | 王永民 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 95566 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 登载基金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 | 基金管理人及基金托管人住所 |

§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 7 月 21 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|---|
| 本期已实现收益 | 79,622,693.21 | 24,295,024.54 |
| 本期利润 | 118,761,102.10 | -10,460,684.26 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0360 | -0.0027 |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.61% | -0.30% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0303 | -0.0028 |
| 期末基金资产净值 | 2,690,650,545.46 | 3,732,790,983.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.033 | 0.997 |

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

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

③本基金合同于 2016 年 07 月 21 日生效，无 2015 年度数据。

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 | 0.68% | 0.14% | 0.69% | 0.01% | -0.01% | 0.13% |
| 过去六个月 | 1.77% | 0.11% | 1.39% | 0.01% | 0.38% | 0.10% |
| 过去一年 | 3.61% | 0.09% | 2.75% | 0.01% | 0.86% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.30% | 0.08% | 3.99% | 0.01% | -0.69% | 0.07% |

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

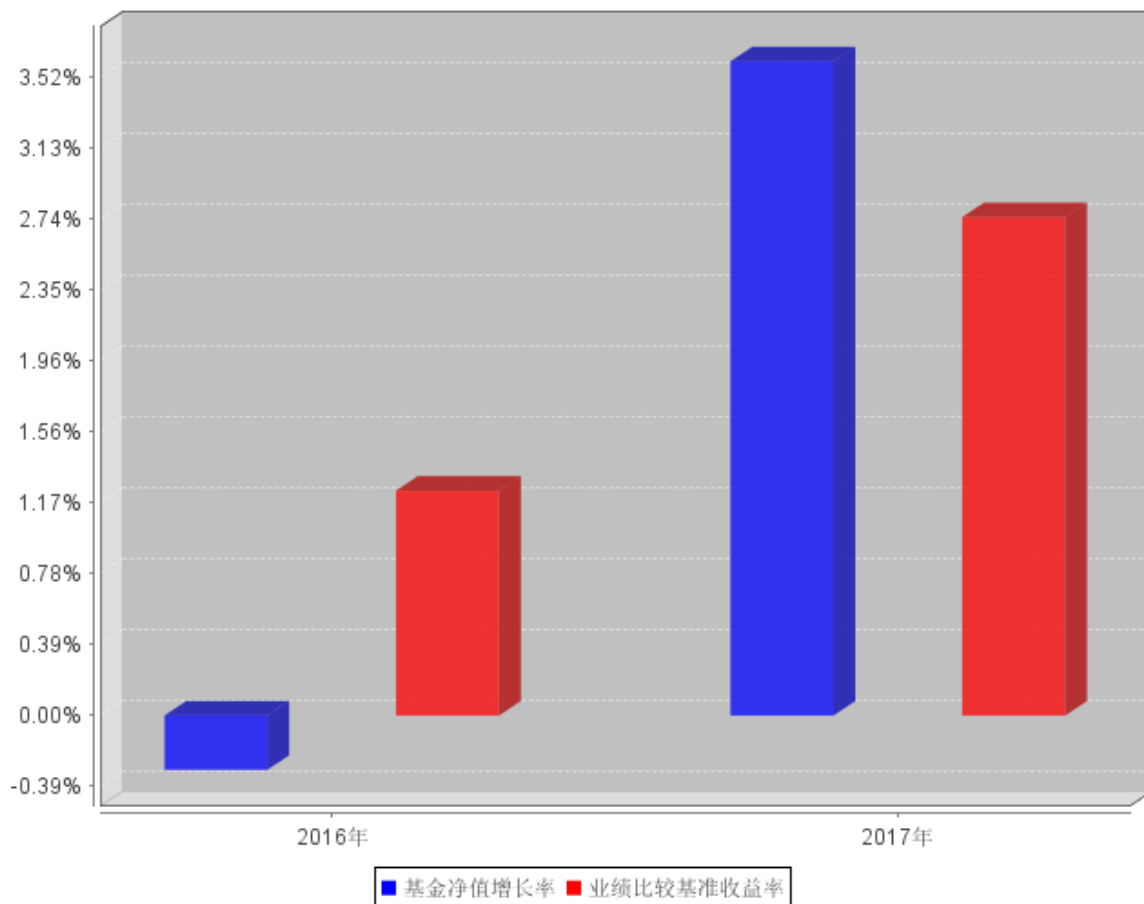


注：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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

3.2.3 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 2016 年 7 月 21 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 | | |
| 马强 | 固定收益部副总经理、长城久鑫保本、长城新策略混合、长城新优选混合、长城久安保本、长城久润保本、长城久益保本、长城久鼎保本、长城久盛安稳债券、长城积极增利债券、长城保本混合和长城新视野混合型基金的基金经理 | 2016年7月26日 | - | 5年 | 男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、自2015年1月9日至2015年6月23日担任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”和“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”基金经理助理，自2015年3月9日至2015年6月23日担任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理，自2015年6月24日至2017年3月16日担任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。 |
| 陈良栋 | 长城保本、长城久祥保本、长城久安保本、长城久益保本、长城久鼎保本、长城新兴产业混合基金的基金 | 2016年8月25日 | - | 6年 | 男，中国籍，清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城消费增值混合型证券投资基金”基金经理助理。 |

| | | | | | |
|--|----|--|--|--|--|
| | 经理 | | | | |
|--|----|--|--|--|--|

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交

易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年，我国宏观经济表现出较强的韧性，总体经济运行好于预期，GDP 增长为 6.9%，在近年以来首次企稳回升，并且企业盈利增长好于收入增长。一方面是经历多年的传统行业产能过剩，各行业自然的优胜劣汰和产能出清逐渐完成，而国家供给侧改革政策的顺利落实和推进，进一步加快了落后产能出清。另一方面是需求表现好于预期，基建投资在国家持续的财政支持下维持高速增长，房地产投资在低库存以及房地产销售好于预期情况下，保持较好的增长，而居民消费表现稳定，并且对 GDP 增长贡献变大，增加了中国经济韧性，海外经济复苏强劲，进出口数据也表现靓丽。监管政策总体偏紧，防风险和去杠杆成为监管首要任务，2017 年国家金融部门陆续推出很多政策规范金融行业，限制杠杆和防范风险，中短期对金融市场资形成严重打压，导致股票市场波动加大和风险偏好下降，以及债券利率持续上行，长期来看有利于金融市场和实体经济健康稳健发展。

2017 年股票市场总体表现为振荡向上的趋势，但二八分化行情表现极致，如果剔除新股，上涨的股票家数更少，沪深 300 指数收益率为 21.8%，中小板指数收益率为 16.8%，创业板指数收益率为-10.7%。传统大盘蓝筹股表现明显好于中小盘和创业板个股，一方面是业绩表现好而且估值相对较低，另一方面是国内偏绝对收益资金以及海外流入资金对蓝筹股的偏好，另外经历 2015 年中小创大牛市，大部分中小创股票虽然跌幅很大，但基本面和估值还缺乏支撑，最后金融监管趋严，也导致市场偏好确定性高的大盘蓝筹股。本基金年初主要以成长股为主，逐渐加大了食品饮料、家电和地产等行业大盘蓝筹股的配置。2017 年债券市场在稳健的经济增长和趋严的金融监管的影响下，收益率中枢逐渐上移，其中：十年期国债收益率由年初的 3.0% 上行至年末的 3.9%，全年上行近 90bp；十年期国开债收益率由 3.7% 上行至 4.8%，全年更是上行 110bp；信用债同样上行显著，5 年期 AA+ 企业债收益率由年初的 4.3% 上行至 5.65%，全年上行 135bp。债券部分的投资上，依然坚持期限匹配、信用高等级进行配置，同时，在市场资金面紧张的时刻增配部分同业存单，并且针对部分非安全资产类别的债券进行调整，确保组合的安全性与收益性的平衡。

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 3.61%，业绩比较基准收益率为 2.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，欧美等海外国家经济持续复苏，给中国带来相对良好的外围环境，但是随着通胀预期开始逐渐抬头，加息计划逐步展开，给全球经济和资金流动性带来一定不确定性。国内经济在基建、地产投资的巨大惯性带动下，短期内仍旧有较强的韧性，制造业的扩张仍旧在继续，出口在全球经济复苏的带动下继续保持较快增长。中长期经济能否平稳运转，需要关注中央财政支出力度，以及金融地产行业防风险去杠杆的节奏和强度对实体经济的影响程度。总体来看中国经济韧性增强，国家和企业在全球的竞争地位持续提升，并进入相对稳态的增长阶段，仍具有很多结构性投资机会。预计股市还是处于振荡和结构分化的市场状态，优质大盘蓝筹股还是具有配置价值，而大幅度下跌的中小创个股中，一些优质个股已经具备很好的投资机会。债券市场在经历了大幅度的监管收缩触发的调整后，性价比逐渐显现，但依然需要警惕处置相关金融领域风险过程中的次生冲击，信用方面，需要更加重质，继续坚持优选中高评级，资质优良标的。面对复杂的内外部环境，需专注和勤勉尽职，努力为基金份额持有人创造良好回报。

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、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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长城久鼎保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 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正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 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 | | 4,623,663.74 | 201,048,982.01 |
| 结算备付金 | | 6,804,480.80 | 713,119.32 |
| 存出保证金 | | 271,137.13 | 116,431.94 |
| 交易性金融资产 | | 2,392,779,477.13 | 2,277,609,349.06 |
| 其中：股票投资 | | 306,656,477.13 | 35,410,345.36 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,086,123,000.00 | 2,242,199,003.70 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | | - | - |
| 买入返售金融资产 | | 428,991,443.49 | 1,229,065,723.60 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | | 26,271,002.49 | 37,535,104.51 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 99.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 2,859,741,204.78 | 3,746,088,809.49 |
| 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 | | 160,000,000.00 | 2,700,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 48,388.30 | - |
| 应付赎回款 | | 4,758,713.18 | 5,796,418.36 |
| 应付管理人报酬 | | 2,797,427.17 | 3,821,948.79 |
| 应付托管费 | | 466,237.86 | 636,991.46 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 340,008.81 | 188,812.55 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|--|------------------|------------------|
| 应付利息 | | 226,532.84 | 933.78 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 453,351.16 | 152,720.67 |
| 负债合计 | | 169,090,659.32 | 13,297,825.61 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 2,604,768,547.83 | 3,743,179,616.84 |
| 未分配利润 | | 85,881,997.63 | -10,388,632.96 |
| 所有者权益合计 | | 2,690,650,545.46 | 3,732,790,983.88 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,859,741,204.78 | 3,746,088,809.49 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.033 元，基金份额总额

2,604,768,547.83 份。

7.2 利润表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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 7 月 21 日(基 金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-----|---|--|
| 一、收入 | | 169,761,736.40 | 14,081,879.02 |
| 1. 利息收入 | | 117,363,581.81 | 47,555,105.48 |
| 其中：存款利息收入 | | 28,329,910.90 | 1,961,889.35 |
| 债券利息收入 | | 68,143,566.97 | 19,137,960.08 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 20,890,103.94 | 26,455,256.05 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 8,444,679.57 | 597,885.24 |
| 其中：股票投资收益 | | 33,065,412.44 | 587,545.91 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -26,472,550.53 | 10,339.33 |
| 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 | | 1,851,817.66 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | 39,138,408.89 | -34,755,708.80 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 4,815,066.13 | 684,597.10 |

| | | | |
|----------------------------|--|----------------|----------------|
| | | | |
| 减：二、费用 | | 51,000,634.30 | 24,542,563.28 |
| 1. 管理人报酬 | | 40,248,822.57 | 20,525,628.69 |
| 2. 托管费 | | 6,708,137.10 | 3,420,938.11 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | | 2,279,998.66 | 318,128.80 |
| 5. 利息支出 | | 1,287,150.53 | 67,027.86 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,287,150.53 | 67,027.86 |
| 6. 其他费用 | | 476,525.44 | 210,839.82 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 118,761,102.10 | -10,460,684.26 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 118,761,102.10 | -10,460,684.26 |

注：本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效。上年度可比期间数据系自 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久鼎保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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） | 3,743,179,616.84 | -10,388,632.96 | 3,732,790,983.88 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 118,761,102.10 | 118,761,102.10 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -1,138,411,069.01 | -22,490,471.51 | -1,160,901,540.52 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,006,122.57 | 17,326.34 | 1,023,448.91 |
| 2. 基金赎回款 | -1,139,417,191.58 | -22,507,797.85 | -1,161,924,989.43 |
| 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） | 2,604,768,547.83 | 85,881,997.63 | 2,690,650,545.46 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016年7月21日(基金合同生效日)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） | 3,876,799,209.24 | - | 3,876,799,209.24 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -10,460,684.26 | -10,460,684.26 |
| 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） | -133,619,592.40 | 72,051.30 | -133,547,541.10 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,367,702.26 | 4,076.14 | 3,371,778.40 |
| 2. 基金赎回款 | -136,987,294.66 | 67,975.16 | -136,919,319.50 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,743,179,616.84 | -10,388,632.96 | 3,732,790,983.88 |

注：本基金合同于 2016 年 7 月 21 日生效。上年度可比期间数据系自 2016 年 7 月 21 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|------------|------------|
| <u>何伟</u> | <u>熊科金</u> | <u>赵永强</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城久鼎保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]445号文“关于准予长城久鼎保本混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自2016年7月11日至2016年7月15日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第60737541_H07号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年7月

21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 3,876,282,246.39 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 516,962.85 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 3,876,799,209.24 元，折合 3,876,799,209.24 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

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

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

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 年度期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计除以下说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致：

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

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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 |
| 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 7 月 21 日 (基金合同生效日) 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 | 293,752,588.93 | 18.82% | 27,734,439.13 | 12.82% |

7.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间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 | 273,572.22 | 18.82% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2016年7月21日(基金合同生效日)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 | 25,828.96 | 12.82% | - | - |

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7月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 40,248,822.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 19,792,911.30 | 9,921,851.27 |

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1.2%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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7月21日(基金合同生效 日)至2016年12月31日 |
|----|---------------------------------|--|
| | 当期发生的基金应支付 | 6,708,137.10 |

| | | |
|------|--|--|
| 的托管费 | | |
|------|--|--|

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 0.2% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------------------|------------|--|------------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | 2016 年 7 月 21 日(基金合同生效日)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 |
| 中国银行 | 4,623,663.74 | 362,126.65 | 1,048,982.01 | 830,317.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行同业利率计息。

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

| 7.4.9.1.1 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 |
| 300664 | 鹏鹞 | 2017 | 2018 | 新股未 | 8.88 | 8.88 | 3,640 | 32,323.20 | 32,323.20 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|----------|-------------------------|------------------------|-----------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| | 环保 | 年 12月 28日 | 年 1月 5日 | 上市 | | | | | | |
| 603161 | 科华 控股 | 2017 年 12月 28日 | 2018 年 1月 5日 | 新股未 上市 | 16.75 | 16.75 | 1,239 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 002923 | 润都 股份 | 2017 年 12月 28日 | 2018 年 1月 5日 | 新股未 上市 | 17.01 | 17.01 | 954 | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 603080 | 新疆 火炬 | 2017 年 12月 25日 | 2018 年 1月 3日 | 新股未 上市 | 13.60 | 13.60 | 1,187 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |
| 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 | - |
| 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 | - |

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 |
|--------|------|-------------------------|------|--------|-------------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 300730 | 科创信息 | 2017 年 12月 25日 | 重大事项 | 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 | 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人民币 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人民币 160,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日至 2018 年 1 月 3 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 305,627,167.73 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,087,152,309.40 元，无划分为第三层次余额。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 35,541,741.01 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,242,067,608.05 元，无划分为第三层次余额。

公允价值所属层次间重大变动

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

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生

第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | 306,656,477.13 | 10.72 |
| | 其中：股票 | 306,656,477.13 | 10.72 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,086,123,000.00 | 72.95 |
| | 其中：债券 | 2,086,123,000.00 | 72.95 |
| | 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 | 428,991,443.49 | 15.00 |
| | 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 | 11,428,144.54 | 0.40 |
| 8 | 其他各项资产 | 26,542,139.62 | 0.93 |
| 9 | 合计 | 2,859,741,204.78 | 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 | 5,951,668.83 | 0.22 |
| C | 制造业 | 187,396,127.08 | 6.96 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 16,143.20 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 4,115,771.11 | 0.15 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 17,942.76 | 0.00 |
| 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 | 0.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 109,092,388.40 | 4.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 32,323.20 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | | - |
| Q | 卫生和社会工作 | | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | - |
| S | 综合 | | - |
| | 合计 | 306,656,477.13 | 11.40 |

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 | 600466 | 蓝光发展 | 6,344,864 | 59,324,478.40 | 2.20 |
| 2 | 002217 | 合力泰 | 4,842,000 | 48,420,000.00 | 1.80 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 1,820,112 | 42,026,386.08 | 1.56 |
| 4 | 000002 | 万科A | 842,100 | 26,155,626.00 | 0.97 |
| 5 | 002536 | 西泵股份 | 1,400,548 | 20,321,951.48 | 0.76 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 25,700 | 17,925,493.00 | 0.67 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 198,700 | 15,872,156.00 | 0.59 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 1,041,800 | 14,741,470.00 | 0.55 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 216,366 | 14,280,156.00 | 0.53 |
| 10 | 600340 | 华夏幸福 | 282,600 | 8,870,814.00 | 0.33 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 66,318,220.00 | 1.78 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 65,577,258.28 | 1.76 |
| 3 | 600466 | 蓝光发展 | 53,158,317.70 | 1.42 |
| 4 | 002217 | 合力泰 | 47,238,071.65 | 1.27 |
| 5 | 002236 | 大华股份 | 40,351,545.16 | 1.08 |
| 6 | 000858 | 五粮液 | 37,680,247.93 | 1.01 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 28,857,630.86 | 0.77 |
| 8 | 002536 | 西泵股份 | 22,447,765.89 | 0.60 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 9 | 000002 | 万 科 A | 21,611,598.92 | 0.58 |
| 10 | 002078 | 太阳纸业 | 20,222,253.88 | 0.54 |
| 11 | 600068 | 葛洲坝 | 17,705,770.35 | 0.47 |
| 12 | 600066 | 宇通客车 | 17,342,966.13 | 0.46 |
| 13 | 601766 | 中国中车 | 17,013,303.90 | 0.46 |
| 14 | 601636 | 旗滨集团 | 16,528,767.96 | 0.44 |
| 15 | 000069 | 华侨城 A | 16,139,999.61 | 0.43 |
| 16 | 000018 | 神州长城 | 15,811,575.60 | 0.42 |
| 17 | 600340 | 华夏幸福 | 14,851,641.65 | 0.40 |
| 18 | 600109 | 国金证券 | 14,008,456.36 | 0.38 |
| 19 | 002027 | 分众传媒 | 13,921,733.28 | 0.37 |
| 20 | 300083 | 劲胜智能 | 13,583,262.84 | 0.36 |

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 | 002450 | 康得新 | 66,758,023.42 | 1.79 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 58,789,651.11 | 1.57 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 41,675,667.98 | 1.12 |
| 4 | 000858 | 五 粮 液 | 25,436,672.28 | 0.68 |
| 5 | 002078 | 太阳纸业 | 22,856,244.99 | 0.61 |
| 6 | 601636 | 旗滨集团 | 18,756,693.80 | 0.50 |
| 7 | 601766 | 中国中车 | 17,075,975.87 | 0.46 |
| 8 | 600066 | 宇通客车 | 16,924,022.72 | 0.45 |
| 9 | 000568 | 泸州老窖 | 16,592,267.82 | 0.44 |
| 10 | 600068 | 葛洲坝 | 16,190,884.78 | 0.43 |
| 11 | 000018 | 神州长城 | 15,036,816.82 | 0.40 |
| 12 | 000069 | 华侨城 A | 14,867,071.50 | 0.40 |
| 13 | 002027 | 分众传媒 | 14,072,872.01 | 0.38 |
| 14 | 600019 | 宝钢股份 | 13,912,192.09 | 0.37 |
| 15 | 300083 | 劲胜智能 | 13,380,998.33 | 0.36 |
| 16 | 600109 | 国金证券 | 13,306,220.00 | 0.36 |
| 17 | 000963 | 华东医药 | 13,161,187.14 | 0.35 |
| 18 | 601997 | 贵阳银行 | 11,547,697.85 | 0.31 |
| 19 | 601186 | 中国铁建 | 11,158,353.24 | 0.30 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 20 | 601668 | 中国建筑 | 10,974,637.15 | 0.29 |
|----|--------|------|---------------|------|

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 | 885,474,319.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 678,740,984.47 |

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 815,733,000.00 | 30.32 |
| | 其中：政策性金融债 | 815,733,000.00 | 30.32 |
| 4 | 企业债券 | 313,398,000.00 | 11.65 |
| 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 | 858,942,000.00 | 31.92 |
| 9 | 其他 | 98,050,000.00 | 3.64 |
| 10 | 合计 | 2,086,123,000.00 | 77.53 |

注：其他为地方政府债。

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 | 160420 | 16 农发 20 | 3,500,000 | 339,675,000.00 | 12.62 |
| 2 | 111707303 | 17 招商银行 CD303 | 1,800,000 | 177,696,000.00 | 6.60 |
| 3 | 130408 | 13 农发 08 | 1,700,000 | 169,660,000.00 | 6.31 |
| 4 | 111709493 | 17 浦发银行 CD493 | 1,600,000 | 157,952,000.00 | 5.87 |
| 5 | 136426 | 16 电投 01 | 1,400,000 | 139,034,000.00 | 5.17 |

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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

8.12.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 271,137.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 26,271,002.49 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 26,542,139.62 |

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

注：本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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 |
| 14,675 | 177,497.00 | 2,231,739.09 | 0.09% | 2,602,536,808.74 | 99.91% |

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 | 29,704.32 | 0.0011% |

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（2016年7月21日）基金份额总额 | 3,876,799,209.24 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,743,179,616.84 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,006,122.57 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,139,417,191.58 |
| 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 | 2,604,768,547.83 |

§ 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 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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玖万元。

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

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

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 | |
| 方正证券 | 2 | 582,210,205.27 | 37.31% | 542,211.95 | 37.31% | - |
| 长城证券 | 1 | 293,752,588.93 | 18.82% | 273,572.22 | 18.82% | - |
| 海通证券 | 2 | 270,238,248.20 | 17.32% | 251,672.80 | 17.32% | - |
| 安信证券 | 2 | 264,423,721.16 | 16.94% | 246,258.20 | 16.94% | - |
| 申万宏源 | 1 | 146,389,177.60 | 9.38% | 136,332.67 | 9.38% | - |
| 光大证券 | 1 | 3,469,098.63 | 0.22% | 3,230.82 | 0.22% | - |
| 华西证券 | 2 | 19,220.00 | 0.00% | 17.89 | 0.00% | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

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

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；

- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
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 |
| 方正证券 | 1,376,590.32 | 0.13% | 61,424,100,000.00 | 76.92% | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | 3,650,000,000.00 | 4.57% | - | - |
| 安信证券 | 12,419,515.20 | 1.14% | 5,836,500,000.00 | 7.31% | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | 8,787,700,000.00 | 11.00% | - | - |
| 华西证券 | - | - | 159,700,000.00 | 0.20% | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1,078,277,401.06 | 98.74% | - | - | - | - |
| 西藏东方 财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

§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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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。