

长城安心回报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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§1 重要提示

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 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	长城安心回报混合
基金主代码	200007
交易代码	200007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 8 月 22 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	1,906,586,274.09 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率 2 倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。
投资策略	分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用“注重收益、关注成长、精选个股”的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。
业绩比较基准	银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍
风险收益特征	本基金是绝对回报产品，其预期收益与风险低于股票型基金，高于债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	贺倩
	联系电话	0755-23982338	010-66060069
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95599
传真		0755-23982328	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
---------------------	-------------------

基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层
------------	------------------------------

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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	94,463,203.53	408,244,650.35	2,327,162,147.15
本期利润	327,488,594.17	-246,796,131.28	2,235,144,364.61
加权平均基金份额本期利润	0.1432	-0.0951	0.5186
本期基金份额净值增长率	15.06%	-9.31%	39.50%
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	0.6698	0.5240	0.5798
期末基金资产净值	2,123,921,429.40	2,365,413,589.19	2,730,451,116.01
期末基金份额净值	1.1140	0.9682	1.0676

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	7.04%	1.06%	0.76%	0.01%	6.28%	1.05%
过去六个月	9.23%	0.83%	1.52%	0.01%	7.71%	0.82%
过去一年	15.06%	0.75%	3.05%	0.01%	12.01%	0.74%
过去三年	45.56%	1.60%	10.78%	0.01%	34.78%	1.59%
过去五年	70.49%	1.35%	24.84%	0.02%	45.65%	1.33%
自基金合同生效起至今	225.62%	1.46%	83.02%	0.02%	142.60%	1.44%

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

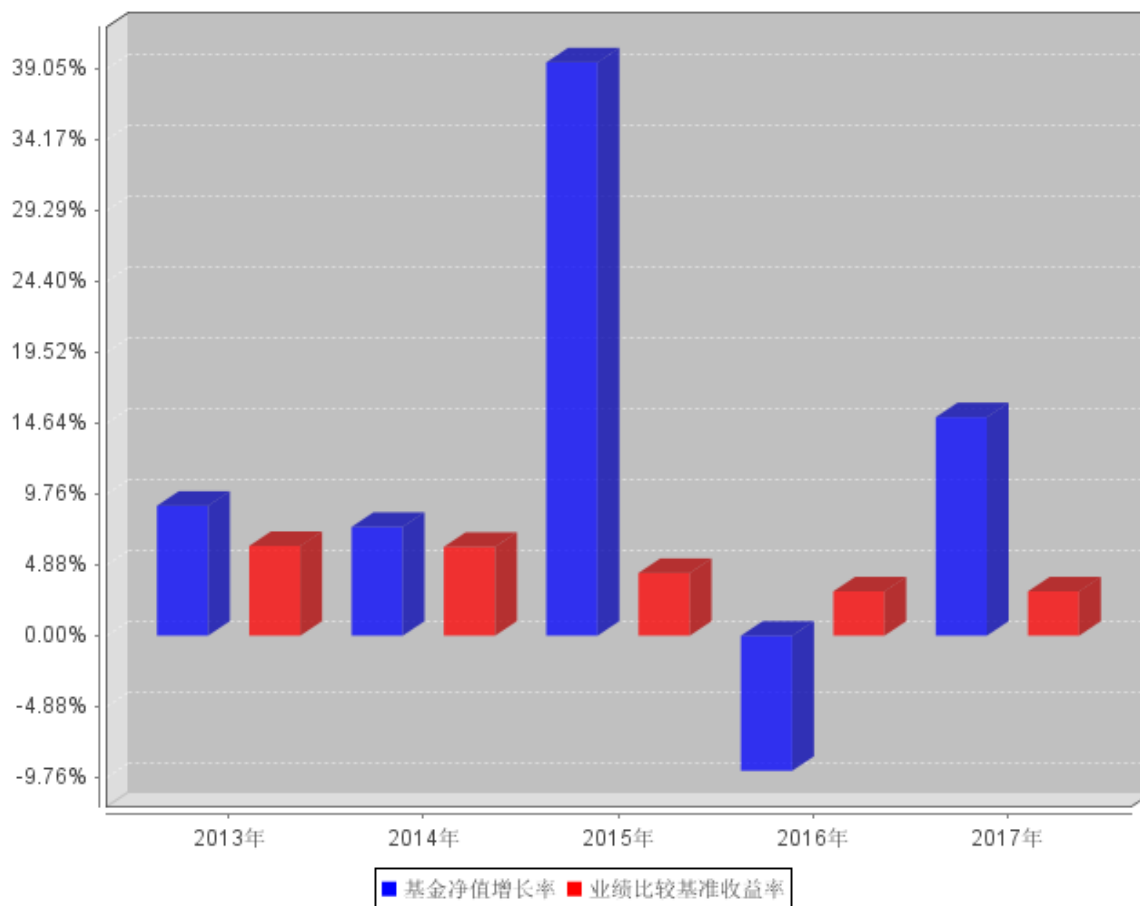
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金投资组合为：股票投资比例为基金净资产的 10%—85%；权证投资比例为基金净资产的 0%—3%；债券投资比例为基金净资产的 10%—85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的 5%以上。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 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

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

§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		
何以广	长城中小盘、长城久富、长城安心回报和长城环保基金的基金经理	2017 年 3 月 16 日	-	6 年	男，中国籍，清华大学核工程与核技术学士、清华大学核科学与技术连续博士。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、“长城优化升级混合型证券投资基金”基金经理。
吴文庆	长城久恒、长城双动力、长城安心回报、长城新兴产业、长城改革红利、长城中国智造基金的基金经理	2016 年 1 月 18 日	2017 年 3 月 16 日	8 年	男，中国籍，上海交大学生物医学工程博士。2010 年进入长城基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，研究部总经理，“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理，“长城消费增值混合型证券投资基金”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，“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，“长城双动力混合型证券投资基金”基金经理，“长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，“长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
张捷	长城安心回报基金	2017 年 5 月 8 日	-	8 年	英国中央兰开夏大学电子工程学士、英国伦敦

	经理助理			帝国理工大学管理学硕士。曾就职于平安集团、柏坊资产管理有限公司、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。
--	------	--	--	--

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。

③自 2018 年 3 月 8 日起，张捷先生不再担任该基金的基金经理助理。

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》、《长城安心回报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

站在 2017 年年初来看，市场估值相对合理，大部分行业的基本面平淡，因此我们判断市场指数难有大的行情。但是我们一直认为，在社会发展过程中，部分新的优秀公司不断涌现，或业绩反转，或新产品驱动成长，或竞争力提升等，这些因素都会驱动公司价值不断增长。从资金面来看，国际资金开始投资 A 股市场，这对市场风格有一定的影响。在这种背景下，投资市场上的优秀公司成为了本基金在 2017 年的主要方向，这是本基金对 2017 年行情和策略的基本判断。在实际运行过程中，以白酒、银行、家电为代表的蓝筹股上涨较多，符合我们的预期。

本基金将以净值稳定上涨，控制回撤为目标。在 2017 年一季度之前，本基金主要配置了成长股，二季度之后，本基金行业配置较为均衡，保持了 75%-85% 的仓位，主要配置了价值股、周期股以及部分成长股，包括食品饮料、消费电子、医药、房地产、PPP、银行、化工等。

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 15.06%，业绩比较基准收益率为 3.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年，宏观经济依然存在较大的变数。一是美联储可能继续加息，大宗商品价格大幅波动等因素将会对国际形势造成较大的影响。二是国内金融降杠杆会对各行业有较大的影响。从估值来看，由于中小市值股票股价大幅下跌，估值已接近相对合理的水平，因此 2018 年，我们在关注蓝筹股的同时，将会加大关注中小市值公司的研究。

对于 2018 年的投资策略，本基金对大盘指数保持谨慎的态度。但我们认为一批优秀的、高成长、低估值公司将会走出独立行情。因此本基金在 2018 年将主要配置消费股、低估值的个股、新兴成长股以及部分价值重估公司。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。根据本基金合同约定，在符合各项分配原则的前提下，本基金年度收益分配比例不低于基金可分配收益的 60%。对已实现尚未分配的可供分配收益部分，基金管理人将根据本基金合同分配原则择机进行分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长城安心回报混合型证券投资基金的过程中，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《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》、《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》的约定，对长城安心回报混合型证券投资基金管理人——长城基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司在长城安心回报混合型证券投资基金的投资运作、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长城安心回报混合型证券投资基金年度报告中的财务指标、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

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：长城安心回报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		74,886,117.55	266,257,000.60
结算备付金		12,440,878.14	6,060,954.56
存出保证金		2,017,162.98	1,292,069.12
交易性金融资产		1,970,224,023.18	2,067,354,102.09
其中：股票投资		1,720,750,023.18	1,794,462,102.09
基金投资		-	-
债券投资		249,474,000.00	272,892,000.00
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		114,000,177.00	-
应收证券清算款		6,388,448.82	28,691,433.27
应收利息		4,472,385.15	3,915,490.73
应收股利		-	-
应收申购款		48,731.73	295.57
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,184,477,924.55	2,373,571,345.94
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		47,072,291.47	-
应付赎回款		3,852,465.36	1,182,054.27
应付管理人报酬		2,735,243.30	3,047,847.10
应付托管费		455,873.89	507,974.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,074,924.83	2,354,182.90
应交税费		206,630.13	206,630.13
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,159,066.17	859,067.83
负债合计		60,556,495.15	8,157,756.75
所有者权益：			
实收基金		846,912,077.92	1,085,214,511.90
未分配利润		1,277,009,351.48	1,280,199,077.29
所有者权益合计		2,123,921,429.40	2,365,413,589.19
负债和所有者权益总计		2,184,477,924.55	2,373,571,345.94

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.1140 元，基金份额总额

1,906,586,274.09 份。

7.2 利润表

会计主体：长城安心回报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		394,862,336.55	-189,220,334.86
1. 利息收入		15,991,790.92	12,948,994.70
其中：存款利息收入		1,835,272.87	2,669,714.94
债券利息收入		11,376,948.87	9,387,561.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,779,569.18	891,718.32
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		145,761,118.37	452,586,384.21
其中：股票投资收益		125,062,334.15	438,610,479.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益		496,102.11	-455,288.35
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		20,202,682.11	14,431,192.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		233,025,390.64	-655,040,781.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		84,036.62	285,067.86
减：二、费用		67,373,742.38	57,575,796.42

1. 管理人报酬		34,660,708.82	36,806,413.49
2. 托管费		5,776,784.86	6,134,402.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		26,447,077.74	14,154,915.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		489,170.96	480,065.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		327,488,594.17	-246,796,131.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		327,488,594.17	-246,796,131.28

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城安心回报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）	1,085,214,511.90	1,280,199,077.29	2,365,413,589.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	327,488,594.17	327,488,594.17
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）	-238,302,433.98	-330,678,319.98	-568,980,753.96
其中：1. 基金申购款	27,262,032.80	33,860,621.77	61,122,654.57
2. 基金赎回款	-265,564,466.78	-364,538,941.75	-630,103,408.53
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）	846,912,077.92	1,277,009,351.48	2,123,921,429.40

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）	1,136,097,566.91	1,594,353,549.10	2,730,451,116.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-246,796,131.28	-246,796,131.28
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）	-50,883,055.01	-67,358,340.53	-118,241,395.54
其中：1. 基金申购款	150,327,512.51	174,078,899.37	324,406,411.88
2. 基金赎回款	-201,210,567.52	-241,437,239.90	-442,647,807.42
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）	1,085,214,511.90	1,280,199,077.29	2,365,413,589.19

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

长城安心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（中国证监会）“证监基金字[2006]123号”《关于同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的批复》核准，基金合同于2006年8月22日生效的契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集规模为1,416,548,067.74份基金份额。基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

于2007年9月5日（基金拆分基准日），本基金管理人长城基金管理有限公司对本基金进

行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 2.2512 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位为人民币 2.251230974 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:2.251230974 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为人民币 0.4442 元。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票、债券、权证以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍。

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
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
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	7,291,961,681.41	42.27%	358,342,599.64	3.84%

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	17,692,796.62	54.16%	200,294,972.61	95.24%

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

	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	27,000,000.00	2.51%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年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	6,791,009.03	42.27%	2,732,246.84	53.87%
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	333,725.86	3.84%	301,875.24	12.87%

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	34,660,708.82
其中：支付销售机构的客户维护费	7,030,611.59	7,553,383.16

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,776,784.86	6,134,402.25

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	74,886,117.55	1,703,786.80	266,257,000.60	1,724,188.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
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	-
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	-
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	-

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
300156	神雾环保	2017 年 7 月 17 日	重大事项	23.68	2018 年 1 月 17 日	21.74	739,952	24,938,388.58	17,522,063.36	-
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 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

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 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 1,701,320,201.46 元，划分为第二层次的余额为人民币 268,903,821.72 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 1,657,733,733.23 元，划分为第二层次的余额为人民币 409,620,368.86 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	1,720,750,023.18	78.77
	其中：股票	1,720,750,023.18	78.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	249,474,000.00	11.42
	其中：债券	249,474,000.00	11.42
	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	114,000,177.00	5.22
	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	87,326,995.69	4.00
8	其他各项资产	12,926,728.68	0.59
9	合计	2,184,477,924.55	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	39,984,000.00	1.88
C	制造业	1,087,723,313.79	51.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	69,798,149.88	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	57,983,846.13	2.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,014,112.55	0.94
J	金融业	166,401,491.24	7.83
K	房地产业	124,617,754.95	5.87
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	74,622,318.33	3.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,531,296.00	1.72
R	文化、体育和娱乐业	43,057,597.11	2.03
S	综合	-	-
	合计	1,720,750,023.18	81.02

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	600519	贵州茅台	152,480	106,353,275.20	5.01
2	000858	五粮液	1,149,456	91,818,545.28	4.32
3	000661	长春高新	358,875	65,674,125.00	3.09
4	002475	立讯精密	2,498,910	58,574,450.40	2.76
5	002304	洋河股份	504,910	58,064,650.00	2.73
6	600426	华鲁恒升	3,444,540	54,837,076.80	2.58
7	000039	中集集团	2,300,000	52,555,000.00	2.47
8	600466	蓝光发展	5,279,897	49,367,036.95	2.32
9	600690	青岛海尔	2,599,879	48,981,720.36	2.31
10	600036	招商银行	1,635,000	47,447,700.00	2.23

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	601318	中国平安	170,244,268.40	7.20
2	601668	中国建筑	162,317,341.24	6.86
3	600690	青岛海尔	150,235,074.87	6.35
4	300355	蒙草生态	136,357,250.08	5.76
5	000858	五粮液	127,157,792.63	5.38
6	600030	中信证券	117,793,719.70	4.98
7	601601	中国太保	117,633,879.31	4.97
8	601186	中国铁建	116,739,271.83	4.94
9	300433	蓝思科技	111,993,695.20	4.73

10	002694	顾地科技	106,743,576.02	4.51
11	601939	建设银行	101,060,514.43	4.27
12	600703	三安光电	100,467,527.66	4.25
13	600153	建发股份	98,376,056.52	4.16
14	000823	超声电子	93,323,382.54	3.95
15	601098	中南传媒	92,102,588.28	3.89
16	600887	伊利股份	91,873,673.28	3.88
17	601398	工商银行	89,300,121.13	3.78
18	000725	京东方 A	87,083,977.80	3.68
19	000651	格力电器	86,658,100.36	3.66
20	600068	葛洲坝	84,181,100.27	3.56
21	600362	江西铜业	82,741,103.85	3.50
22	600048	保利地产	80,708,000.07	3.41
23	000568	泸州老窖	79,552,198.27	3.36
24	002304	洋河股份	79,225,360.90	3.35
25	002475	立讯精密	78,002,584.00	3.30
26	600029	南方航空	77,077,689.26	3.26
27	002449	国星光电	75,130,030.13	3.18
28	002340	格林美	72,750,187.61	3.08
29	601225	陕西煤业	72,480,355.06	3.06
30	600519	贵州茅台	69,112,024.66	2.92
31	600466	蓝光发展	68,899,725.68	2.91
32	600062	华润双鹤	67,430,225.47	2.85
33	002236	大华股份	67,382,331.48	2.85
34	002310	东方园林	65,552,679.91	2.77
35	300438	鹏辉能源	65,510,954.75	2.77
36	600525	长园集团	65,295,835.65	2.76
37	002418	康盛股份	64,785,080.00	2.74
38	600585	海螺水泥	64,682,797.24	2.73
39	601328	交通银行	63,226,844.88	2.67
40	601933	永辉超市	63,223,344.57	2.67
41	300059	东方财富	57,784,521.09	2.44
42	002245	澳洋顺昌	57,225,180.54	2.42
43	002051	中工国际	56,407,841.67	2.38
44	000661	长春高新	55,562,034.14	2.35
45	300422	博世科	54,950,602.09	2.32

46	600036	招商银行	54,701,616.58	2.31
47	002271	东方雨虹	51,910,372.41	2.19
48	601336	新华保险	51,738,719.61	2.19
49	002415	海康威视	51,478,580.23	2.18
50	603626	科森科技	51,439,743.87	2.17
51	000063	中兴通讯	49,056,102.40	2.07
52	300083	劲胜智能	49,035,104.14	2.07
53	000921	海信科龙	48,764,378.44	2.06
54	300156	神雾环保	48,530,286.45	2.05
55	601166	兴业银行	48,485,775.07	2.05
56	600104	上汽集团	48,336,348.23	2.04
57	601155	新城控股	48,068,489.13	2.03
58	000776	广发证券	47,730,315.55	2.02
59	601006	大秦铁路	47,619,863.65	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	601318	中国平安	187,663,468.22	7.93
2	000963	华东医药	174,987,760.85	7.40
3	601668	中国建筑	164,185,504.08	6.94
4	600525	长园集团	120,995,070.92	5.12
5	600690	青岛海尔	118,890,279.06	5.03
6	600703	三安光电	117,471,582.95	4.97
7	300433	蓝思科技	115,051,274.11	4.86
8	601186	中国铁建	110,912,829.23	4.69
9	002509	天广中茂	107,788,859.00	4.56
10	002694	顾地科技	103,733,991.13	4.39
11	601939	建设银行	103,427,088.48	4.37
12	300355	蒙草生态	95,960,465.78	4.06
13	002323	雅百特	95,783,384.66	4.05
14	000725	京东方 A	92,724,147.40	3.92
15	600146	商赢环球	86,938,067.73	3.68
16	000651	格力电器	84,662,583.35	3.58
17	601601	中国太保	83,927,027.19	3.55

18	600068	葛洲坝	81,847,750.16	3.46
19	002303	美盈森	79,590,866.31	3.36
20	000858	五粮液	77,712,662.26	3.29
21	002340	格林美	76,877,026.87	3.25
22	601933	永辉超市	74,730,531.58	3.16
23	000568	泸州老窖	71,653,430.52	3.03
24	600030	中信证券	71,475,935.75	3.02
25	000823	超声电子	70,630,666.23	2.99
26	600585	海螺水泥	68,696,155.39	2.90
27	600270	外运发展	66,785,931.46	2.82
28	300147	香雪制药	66,318,366.02	2.80
29	600702	沱牌舍得	65,856,164.96	2.78
30	000566	海南海药	64,729,068.03	2.74
31	000063	中兴通讯	64,594,571.15	2.73
32	601328	交通银行	64,481,688.81	2.73
33	600887	伊利股份	62,856,592.52	2.66
34	600062	华润双鹤	62,664,777.08	2.65
35	300323	华灿光电	61,397,675.60	2.60
36	002310	东方园林	61,313,944.19	2.59
37	002431	棕榈股份	61,073,688.16	2.58
38	002415	海康威视	60,596,649.06	2.56
39	002362	汉王科技	60,027,209.89	2.54
40	000534	万泽股份	58,911,833.09	2.49
41	002359	北讯集团	58,539,058.54	2.47
42	002658	雪迪龙	57,625,046.80	2.44
43	002449	国星光电	57,241,919.64	2.42
44	002418	康盛股份	56,386,724.75	2.38
45	600153	建发股份	55,135,578.34	2.33
46	300059	东方财富	54,633,012.68	2.31
47	300269	联建光电	53,292,834.07	2.25
48	002507	涪陵榨菜	52,839,781.56	2.23
49	601166	兴业银行	52,648,484.44	2.23
50	002714	牧原股份	52,509,526.95	2.22
51	002051	中工国际	52,487,393.29	2.22
52	300038	梅泰诺	52,092,963.23	2.20
53	601155	新城控股	51,650,171.98	2.18
54	600829	人民同泰	50,551,476.84	2.14
55	601398	工商银行	50,243,795.66	2.12

56	000921	海信科龙	50,210,264.24	2.12
57	300234	开尔新材	49,445,191.55	2.09
58	600104	上汽集团	48,912,262.07	2.07
59	000776	广发证券	48,658,161.32	2.06
60	600111	北方稀土	48,544,339.62	2.05
61	300083	劲胜智能	48,449,795.93	2.05
62	000587	金洲慈航	48,400,454.90	2.05
63	601336	新华保险	47,730,848.65	2.02
64	002271	东方雨虹	47,534,358.20	2.01
65	300090	盛运环保	47,401,749.00	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	8,412,752,875.53
卖出股票收入（成交）总额	8,846,271,477.37

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	249,474,000.00	11.75
	其中：政策性金融债	249,474,000.00	11.75
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	249,474,000.00	11.75

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	170204	17 国开 04	1,000,000	99,800,000.00	4.70
2	170410	17 农发 10	800,000	79,576,000.00	3.75
3	130234	13 国开 34	700,000	70,098,000.00	3.30
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

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：本基金本报告期末未进行国债期货投资，本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

基金投资的前十名证券的发行主体本期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	2,017,162.98
2	应收证券清算款	6,388,448.82
3	应收股利	-
4	应收利息	4,472,385.15
5	应收申购款	48,731.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,926,728.68

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：本基金本报告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

注：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
133,470	14,284.76	57,283,371.38	3.00%	1,849,302,902.71	97.00%

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	3,673.92	0.0002%

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（2006年8月22日）基金份额总额	1,416,548,067.74
本报告期期初基金份额总额	2,443,059,070.38
本报告期基金总申购份额	61,371,960.97
减:本报告期基金总赎回份额	597,844,757.26
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	1,906,586,274.09

§ 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

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

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拾万元。

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九年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
长城证券	3	7,291,961,681.41	42.27%	6,791,009.03	42.27%	-
长江证券	1	2,039,319,263.09	11.82%	1,899,216.60	11.82%	-
东兴证券	1	1,150,252,363.88	6.67%	1,071,227.62	6.67%	-
中金公司	1	977,687,617.81	5.67%	910,512.04	5.67%	-
华西证券	1	873,070,675.90	5.06%	813,088.02	5.06%	-
国信证券	1	775,359,823.88	4.49%	722,092.01	4.49%	-
招商证券	2	740,722,578.76	4.29%	689,828.67	4.29%	-
中信证券	2	666,374,590.48	3.86%	620,598.46	3.86%	-
国泰君安	2	595,784,896.27	3.45%	554,854.55	3.45%	-
中信建投	1	582,579,758.60	3.38%	542,557.80	3.38%	-
中银国际	1	497,329,737.36	2.88%	463,163.70	2.88%	-
申银万国证 券	1	418,242,681.90	2.42%	389,509.03	2.42%	-
西南证券	1	333,152,596.51	1.93%	310,265.45	1.93%	-
银河证券	2	279,487,918.35	1.62%	260,288.05	1.62%	-
光大证券	1	29,330,871.08	0.17%	27,315.52	0.17%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内增加广发证券 2 个交易单元，减少国信证券 1 个交易单元和高华证券 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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	17,692,796.62	54.16%	27,000,000.00	2.51%	-	-

长江证券	-	-450,000,000.00	41.78%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-
中金公司	-	-100,000,000.00	9.29%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-
招商证券	-	-500,000,000.00	46.43%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-
中银国际	14,975,950.00	45.84%	-	-	-
申银万国证 券	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-

§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。