长城久源保本混合型证券投资基金

【2016】第四季度报告

基金管理人:长城基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年01月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月01日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久源保本
基金主代码	002703
交易代码	002703
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月21日
报告期末基金份额总额	1,964,664,881.51份
投资目标	本基金严格控制风险,在确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	本基金投资策略分为两个层次:一层为基金在安全资产和风险资产之间的大类资产配置策略;另一层为安全资产的投资策略和风险资产的投资策略。 本基金采用固定比例组合保险策略(Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简记为"CPPI")建立和运用严格的动态资产数量模型,动态调整安全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。
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。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日?)
1.本期已实现收益	14,830,239.63
2.本期利润	-5,000,839.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0025
4.期末基金资产净值	1,959,134,398.99
5.期末基金份额净值	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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-0.30%	0.10%	0.69%	0.01%	-0.99%	0.09%

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

注:①本基金合同规定本基金的投资组合比例为:股票、权证、股指期货等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券和银行存款等安全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本基金合同于2016年6月21日生效,截止本报告期末,基金合同生效未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钟光正	公司总经理助理,固定收益部总经理,长城新股增利债券、长城久利本基金、长城增强收益债券、长城稳固收益债券、长城大利保本、长城久利保本、长城久源保本、长城新双赢、长城久盛安稳债券、长城久信债券基金的基金经理	2016年6月21日	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,具有12年债券投资管理经历,曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司,广发银行总行资金部,招商银行总行资金交易部等。2008年11月进入长城基金管理有限公司,曾任债券研究员。自2010年2月至2011年10月任"长城货币市场证券投资基金"基金经理,自2010年2月至2011年11月任"长城稳健增利债券型证券投资基金"基金经理。
聂旻	长城稳健增利基金、长城保本、长城久利保本、长城新锐选、长城久盈分级债券、长城久惠保本、长城新双赢基金、长城久源保本、长城久稳债券基金的基金经理	2016年6月21日	-	6年	男,中国籍,厦门大学金融工程学士,硕士,2010年进入长城基金管理有限公司,曾任债券研究员,"长城货币市场证券投资基金"基金经理,自2010年2月至2011年11月任"长城稳健增利债券型证券投资基金"基金经理。"长城动金一年期限时债券型证券投资基金"和"长城沙金增利债券型证券投资基金"基金经理。
姚爱玉	长城稳固、长城久惠保本、长城久利保本、长城久盈保本、长城久稳保本、长城久源保本基金的基金经理	2016年7月21日	-	8年	女,中国籍,中央财经大学经济学学士,北京大学经济学硕士,香港大学金融学硕士,2008年进入长城基金管理有限公司,曾任行业研究员,"长城品牌优选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》、《长城久源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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年4季度,国内经济运行平稳。中采PMI指标4季度略有波动但一直高于51%。工业增加值同比增速在6.1%-6.3%区间内震荡。地产以及制造业投资同比增速继续上升,对冲了基建的下滑,因此总体固定资产投资同比增速保持平稳。同时,消费增速稳中有升,出口增速的跌幅收窄。物价方面,在食品和非食品价格共同带动下,CPI增速有所反弹;受低基数以及大宗商品价格上涨的影响,PPI同比增速快速向上突破3%。

4季度,央行继续"收短放长",用14天和28天逆回购替代原来7天逆回购,同时也拉长MLF的期限,抬高了金融机构从货币市场融资的成本。与此同时,财政政策通过减税与增支并举,特别是结合PPP的方式,继续增加刺激经济增长的力度。

4季度债券收益率调整剧烈。季度初,债券市场延续了9月份的乐观情绪,收益率在10月中旬达到年内低点,随后,央行"收短放长"的效应逐渐显现,叠加人民币贬值和资本外流压力加剧,银行间流动性逐渐变紧,同时决策层金融去杠杆的政策频繁出台,CPI逐步反弹,PPI由负转正,债券收益率从11月开始大幅上行。调整持续到12月底,随着央行加大流动性投放,债券配置盘出手,市场恐慌情绪缓解,收益率有所下行。总体看,4季度债券市场调整幅度较大。

4度初在大盘蓝筹的带动下A股表现强劲,我们逐步提高了股票仓位,参与了煤炭、环保、园林建筑、金融、地产等板块,之后随着股票市场的回落和债市的大幅调整,我们迅速降低了股票仓位,及时兑现了收益。目前保本产品股票仓位在低位运行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率为-0.30%,本基金业绩比较基准收益率为0.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,451,145.49	0.23
	其中:股票	4,451,145.49	0.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,539,181,508.00	77.84
	其中:债券	1,539,181,508.00	77.84
	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	199,920,899.89	10.11
	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	212,798,895.92	10.76
8	其他资产	20,944,758.32	1.06
9	合计	1,977,297,207.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,046,941.49	0.05
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	3,297,424.00	0.17
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	-	-
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,451,145.49	0.23

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600820	人民币[illegible]	216,100	3,297,424.00	0.17
2	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.04
3	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01
4	002326	永太科技	2,181	67,316.68	0.00
5	600416	湘潭电气	1,076	52,886.08	0.00
6	300682	朗新科技	1,269	36,107.23	0.00
7	600230	沧州大化	924	29,059.80	0.00
8	002285	闽发铝业	1,126	24,220.26	0.00
9	300586	美联新材	1,006	9,356.80	0.00
10					

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	104,060,566.00	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,045,634,942.00	53.37
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	389,486,000.00	19.88
10	合计	1,539,181,508.00	78.56

注:"其他"为地方政府债。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136544	16联通03	1,500,000	147,375,000.00	7.52
2	136558	16华电02	1,500,000	147,105,000.00	7.51
3	136539	16上港03	1,500,000	146,955,000.00	7.50
4	136554	16中金01	1,500,000	146,310,000.00	7.47
5	130541	15四川09	1,400,000	140,616,000.00	7.18

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期未进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	374,961.82
2	应收证券清算款	47,980.59
3	应收股利	-
4	应收利息	20,511,911.00
5	应收申购款	9,904.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,944,758.32

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603660	苏州科达	837,945.54	0.04	新股锁定
2	601375	中原证券	106,780.00	0.01	新股未上市
3	300586	美联新材	9,356.80	0.00	新股未上市

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,032,411,246.72
报告期期间基金总申购份额	176,392.28
减:报告期期间基金总赎回份额	67,922,757.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,964,664,881.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会许可长城久源保本混合型证券投资基金注册的文件
2. 《长城久源保本混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城久源保本混合型证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 中国证监会规定的其他文件

8.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

8.3 查阅方式

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

咨询电话:0755-23982338

客户服务电话:400-8868-666

网站:www.ccfund.com.cn

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:2017年1月20日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年01月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月01日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城久兆中小板300指数分级
基金主代码	162010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年1月30日
报告期末基金份额总额	26,844,377.77份
投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中小板300价格指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。
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
下属分级基金简称	长城久兆中小板300指数分级 长城久兆稳健指数 长城久兆积极指数
下属分级场内简称	长城久兆 中小300A 中小300B
下属分级基金交易代码	162010 150057 150058
下属分级基金报告期末基金份额总额	18,110,062.77份 3,493,730.00份 5,240,595.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。 长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。 长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月31日?)
1.本期已实现收益	-249,686.10
2.本期利润	-1,219,245.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0436
4.期末基金资产净值	28,631,394.12
5.期末基金份额净值	1.067

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。

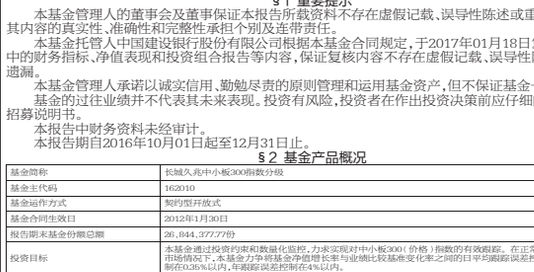
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.53%	0.79%	-3.93%	0.80%	0.40%	-0.01%

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



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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余礼冰	长城久兆中小板300指数分级基金的基金经理	2012年4月17日	-	15年	女,中国籍,华中理工大学工学硕士,曾就职于盛同基金、宝盈基金、友邦华泰基金等,2007年加入长城基金管理有限公司,曾任研究部副总经理,2012年1月至2012年4月任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"基金经理助理,自2012年4月至今任"长城久兆中小板300指数分级证券投资基金"基金经理。

注:①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

我们认为A股市场震荡格局在17年1季度将大概率继续演绎。中小板300指数做为新兴产业和大消费占比较高的市场代表性指数将受益战改革和转型,长城久兆中小板300指数分级基金做为交易型投资工具,适合于投资者做为交易品种投资。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对A股市场进行投资的良好工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-3.53%,本基金比较基准收益率为-3.93%。本报告期内,本基金日均跟踪误差控制在0.35%之内,年化跟踪误差控制在4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金自2016年10月31日起至2016年12月30日止连续45个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	27,378,900.66	95.38
	其中:股票	27,378,900.66	95.38
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	1,303,249.64	4.81
8	其他资产	2,475.52	0.01
9	合计	28,684,625.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	474,184.20	1.66
B	采矿业	140,136.49	0.49
C	制造业	18,415,107.92	64.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	128,309.31	0.45
E	建筑业	876,984.84	3.06
F	批发和零售业	1,145,466.16	4.00
G	交通运输、仓储和邮政业	57,284.24	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,593,424.42	9.06
J	金融业	1,045,020.64	3.65
K	房地产业	238,263.67	0.83
L	租赁和商务服务业	523,941.49	1.83
M	科学研究和技术服务业	46,054.24	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	118,236.96	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	514,696.84	1.80
S	综合	-	-
	合计	26,316,171.32	91.91

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	83,545.00	0.29
C	制造业	726,544.94	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	120,591.80	0.42
F	批发和零售业	46,562.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	41,800.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,804.00	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	24,882.00	0.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,062,729.34	3.71

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002450	康得新	26,079	498,369.69	1.74
2	002415	海康威视	19,474	463,675.94	1.62
3	002024	苏宁云商	39,849	456,271.05	1.59
4	002304	洋河股份	5,843	412,515.80	1.44
5	002673	西部证券	15,550	322,973.50	1.13
6	002142	宁波银行	17,632	293,396.48	1.02
7	002594	比亚迪	5,808	288,541.44	1.01
8	002736	国信证券	18,338	285,155.90	1.00
9	002202	金风科技	16,461	281,647.71	0.98
10	002739	万达院线	5,000	270,350.00	0.94

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002716	金贵银业	5,200	120,328.00	0.42
2	002486	嘉麟杰	8,300	84,743.00	0.30
3	002628	成都路桥	8,612	81,383.40	0.28
4	002297	博云新材	3,966	51,914.94	0.18
5	002618	丹邦科技	2,000	50,500.00	0.18

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,034.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	332.80
5	应收申购款	1,108.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,475.52

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002297	博云新材	51,914.94	0.18	重大事项停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
报告期期初基金份额总额	18,693,356.88	3,472,754.00	5,209,131.00
报告期期间基金总申购份额	18,619,354.71	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	19,150,218.82	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-52,440.00	20,976.00	31,464.00
报告期期末基金份额总额	18,110,062.77	3,493,730.00	5,240,595.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动,于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 本基金设立等相关批准文件
2. 《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》
3. 《长城久兆中小