

# 长城稳健增利债券型证券投资基金

## 2017年第四季度报告

4.6 报告期末本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2017年10月8日起至2017年11月24日止连续36个工作日基金资产净值低于人民币五千元。自2017年11月29日起至2017年12月29日止连续23个工作日基金资产净值低于人民币五千元。

### 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	110,169.00	0.61
2	基金投资	110,169.00	0.61
3	固定收益投资	24,226,102.60	90.22
4	资产支持证券	24,226,102.60	90.22
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	1,200,000.00	4.47
8	其他资产	684,126.13	2.56
9	其他负债	631,189.23	2.36
10	合计	26,162,586.96	100.00

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	8,369.00	0.03
B	矿业	64,872.00	0.26
C	制造业	-	-
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	12,200.00	0.05
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	5,964.00	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,700.00	0.07
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	卫生和社公工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	110,169.00	0.62

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	000217	合力泰	3,000	20,000.00	0.11
2	000499	紫光国微	2,000	18,700.00	0.07
3	000419	长江精工	800	12,200.00	0.05
4	001012	长城军工	300	10,520.00	0.04
5	000000	中国平安	200	9,800.00	0.04
6	000006	宇通客车	400	9,420.00	0.04
7	000066	银河证券	500	8,260.00	0.03
8	300198	美国在线	300	5,964.00	0.02
9	000029	山东黄金	200	4,420.00	0.02

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	000217	合力泰	3,000	20,000.00	0.11
2	000499	紫光国微	2,000	18,700.00	0.07
3	000419	长江精工	800	12,200.00	0.05
4	001012	长城军工	300	10,520.00	0.04
5	000000	中国平安	200	9,800.00	0.04
6	000006	宇通客车	400	9,420.00	0.04
7	000066	银河证券	500	8,260.00	0.03
8	300198	美国在线	300	5,964.00	0.02
9	000029	山东黄金	200	4,420.00	0.02

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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.10.3 本期国债期货投资评价

5.11 投资组合报告附注

本报告期内本基金投资的前十名证券中中兴通讯发行主体,其他证券的发

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公开谴责、处

罚。

中兴通讯股份有限公司(以下简称中兴通讯或公司)于2017年3月8日发布

“关于重大事项进展公告”,公告称:公司已就美国商务部工业与安全( BIS )、

美国司法部( DOJ )及美国财政部海外资产管理办公室( OFAC )对公司遵循美

国出口管制政策及美国制裁法律规定的调查达成协议。鉴于公司违反了美国出

口管制法律,并在调查过程中提供信息及其他行为违反了“相关美国法律,公

司已同意支付合计\$2,380,000美元罚款。此外,BIS还对公司以暂缓执行

的3亿美元罚款,在公司于七年前暂缓内履行与BIS达成的协议要求的事项后将

被豁免支付。公司与OFAC达成的协议签署生效后,公司与DOJ达成的协议在获

得德克萨斯州北区美国地方法院(以下简称“法院”)的批准并生效后,法院批准

公司DOJ达成的协议是BIS发布和解令的先决条件。同时,公司与DOJ达成的议

议要求,公司承认及BIS助理部长签发和解令后,BIS会暂停对公司从受

制裁国家进口的商品。

5.12 本报告期内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。

5.13 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.14 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.15 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。

5.16 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。

5.17 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.17.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.17.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.18 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.18.1 本期国债期货投资政策

5.18.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.18.3 本期国债期货投资评价

5.19 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。

5.20 本报告期内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公开谴责、处

罚。

5.21 本报告期内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。

5.22 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.23 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.24 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。

5.25 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。

5.26 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.26.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.26.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.27.1 本期国债期货投资政策

5.27.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.27.3 本期国债期货投资评价

5.28 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。

5.29 本报告期内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公开谴责、处

罚。

5.30 本报告期内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。

5.31 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.32 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.33 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。

5.34 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。

5.35 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.35.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.35.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.36 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.36.1 本期国债期货投资政策

5.36.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.36.3 本期国债期货投资评价

5.37 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。

5.38 本报告期内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公开谴责、处

罚。

5.39 本报告期内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。

5.40 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.41 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.42 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。

5.43 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。

5.44 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.44.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.44.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.45 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.45.1 本期国债期货投资政策

5.45.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.45.3 本期国债期货投资评价

5.46 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。

5.47 本报告期内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公开谴责、处

罚。

5.48 本报告期内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。

5.49 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.50 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.51 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。

5.52 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。

5.53 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.53.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.53.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.54 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.54.1 本期国债期货投资政策

5.54.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.54.3 本期国债期货投资评价

5.55 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。

5.56 本报告期内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公开谴责、处

罚。

5.57 本报告期内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。

5.58 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有资产。

5.59 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

证券投资组合明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.60 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。

5.61 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。

5.62 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.62.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

5.62.2 本基金投资股指期货的投资政策

5.63 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.63.1 本期国债期货投资政策

5.63.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

5.63.3 本期国债期货投资评价

5.64 投资组合报告附注

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公开谴责、处

罚。