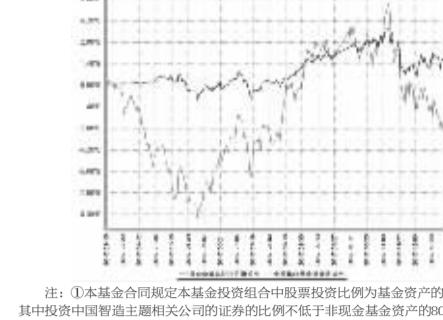


长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

益率变动的比较



基金净值增长率与业绩基准收益率比较(基准收益率业绩基准差值)

注:①本基金合同规定本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%。其中投资于中国智造主题相关公司的证券的比例不低于非现金基金资产的80%。权证投资占基金资产净值的比例0-3%;每个交易日终日在扣除股指期货合约保证金后的现金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基金合同生效之日起六个月内,建仓期间内,各项资产配置比例符合基金合同约定。

③本基金于2017年3月15日生效,截至本报告期末,基金合同尚未满一年。

④管理人报告

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 57,459,318.02 36.23

其中:股票 57,459,318.02 36.23

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

4 货币市场投资 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他金融资产 - -

7 特殊用途类资产的买入返售金融资产 - -

8 银行存款和结算备付金合计 83,422,513.47 51.15

9 其他资产 22,214,160.33 13.62

9 合计 159,093,971.80 100.00

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 矿采业 2,347,510.00 1.46

C 制造业 34,510,428.02 21.20

D 电力、热力、煤气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 5,765,160.00 3.57

G 交通运输、仓储和邮政业 679,440.00 0.42

H 餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 2,147,960.00 1.33

K 采矿业 1,896,400.00 1.17

K 畜牧业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务及地质勘查业 9,140,400.00 5.67

N 水利、环境和公共设施管理业 972,990.00 0.60

O 国防、军队、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 - -

9 合计 57,459,318.02 36.23

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 300492 山鼎设计 189,000 9,140,400.00 5.67

2 000658 舜宇光学 97,000 6,402,000.00 3.99

3 000963 华东医药 107,000 5,795,160.00 3.57

4 002304 深南电路 33,700 3,875,500.00 2.40

5 002773 水晶光电 147,000 3,467,780.00 2.16

6 300645 贝达药业 47,000 2,374,630.00 1.44

7 603008 聚光科技 156,100 2,923,260.00 1.81

8 002217 合力泰 260,006 2,009,060.00 1.25

9 601336 新华联 27,000 1,896,400.00 1.17

10 000907 云铝股份 177,000 1,810,710.00 1.12

9 合计 22,214,160.33

5.4 报告期按公允价值持有的债券投资

本基金报告期内未持有债券。

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

本基金报告期内未持有债券。

5.6 报告期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

本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.7 报告期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

本基金报告期内未持有贵金属。

5.8 报告期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

本基金报告期内未持有权证。

5.9 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

本报告期内基金管理人持有本基金的份额无变化,于本报告期期初及期末均未持有本基金的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金的基金管理人未对固有资金投资于本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有的基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期期内无单一投资者持有的基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

1. 中国证监会许可注册的文件

2. 《长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

3. 《长城中国智造灵活配置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

9.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路6009号世界商务中心41层

9.3 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,可向基金管理人

长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话:0755-23962338

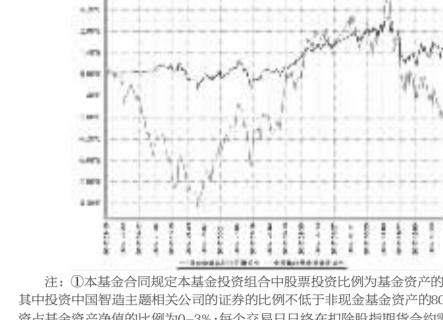
客户服务电话:400-8896-666

网站:www.ccfund.com.cn

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

益率变动的比较



基金净值增长率与业绩基准收益率比较(基准收益率业绩基准差值)

注:①本基金合同规定本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-95%。其中投资于中国智造主题相关公司的证券的比例不低于非现金基金资产的80%。权证投资占基金资产净值的比例0-3%;每个交易日终日在扣除股指期货合约保证金后的现金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基金合同生效之日起六个月内,建仓期间内,各项资产配置比例符合基金合同约定。

③本基金于2017年3月15日生效,截至本报告期末,基金合同尚未满一年。

④管理人报告

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 57,459,318.02 36.23

其中:股票 57,459,318.02 36.23

2 基金投资 - -

3 固定收益投资 - -

4 货币市场投资 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他金融资产 - -

7 银行存款和结算备付金合计 83,422,513.47 51.15

8 其他资产 22,214,160.33 13.62

9 合计 159,093,971.80 100.00

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 矿采业 2,347,510.00 1.46

C 制造业 34,510,428.02 21.20

D 电力、热力、煤气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 批发和零售业 5,765,160.00 3.57

G 交通运输、仓储和邮政业 679,440.00 0.42

H 餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 - -

J 金融业 2,147,960.00 1.33

K 采矿业 1,896,400.00 1.17

K 畜牧业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务及地质勘查业 9,140,400.00 5.67

N 水利、环境和公共设施管理业 972,990.00 0.60

O 国防、军队、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 - -

9 合计 57,459,318.02 36.23

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 300492 山鼎设计 189,000 9,140,400.00 5.67

2 000658 舜宇光学 97,000 6,402,000.00 3.99

3 000963 华东医药 107,000 5,795,160.00 3.57

4 002304 深南电路 33,700 3,875,500.00 2.40