

**湘财长顺混合型发起式证券投资基金**

**2019 年年度报告**

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:湘财基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2020 年 03 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年3月24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。

本报告期自2019年3月28日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	3
1.1 重要提示 .....	3
1.2 目录 .....	4
§2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	8
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	12
§4 管理人报告 .....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
§5 托管人报告 .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
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 .....	17
§6 审计报告 .....	17
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
§7 年度财务报表 .....	20
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	23
7.4 报表附注 .....	24

§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	64
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	64
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	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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情况	66
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	69
§12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 影响投资者决策的其他重要信息	72
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	湘财长顺混合型发起式证券投资基金	
基金简称	湘财长顺混合发起式	
基金主代码	007012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月28日	
基金管理人	湘财基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	193,315,402.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	湘财长顺混合发起式 A	湘财长顺混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	007012	007013
报告期末下属分级基金的份额总额	71,618,445.01份	121,696,957.97份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，灵活运用多种投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以经济周期研究为核心，通过定性与定量的手段综合研究经济政策、经济增长与通货膨胀、金融周期和流动性、市场估值和风险评估，动态把握不同资产类别在不同时期的投资机会和风险特征，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的合适配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于

	债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金（中高风险）。
--	-----------------------------

### 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	湘财基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孟爽
	联系电话	021-50606800
	电子邮箱	services@xc-fund.cn
客户服务电话	4009200759	021-38917599-5
传真	021-50380285	021-38677819
注册地址	上海市静安区共和路169号2层40室	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址	上海市浦东新区杨高南路428号1号楼5楼	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码	200127	200041
法定代表人	王小平	贺青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xc-fund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区杨高南路428号1号楼5楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	中国·杭州
注册登记机	湘财基金管理有限公司	上海市浦东新区杨高南路428号1号楼5楼

构		
---	--	--

### § 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	本期2019年03月28日（基金合同生效日）- 2019年12月31日	
	湘财长顺混合发起式A	湘财长顺混合发起式C
本期已实现收益	4,897,433.49	-80,192.46
本期利润	12,117,055.66	17,917,068.96
加权平均基金份额本期利润	0.0911	0.0519
本期加权平均净值利润率	9.22%	5.29%
本期基金份额净值增长率	14.10%	13.49%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	
期末可供分配利润	5,270,671.55	8,255,496.72
期末可供分配基金份额利润	0.0736	0.0678
期末基金资产净值	81,713,695.93	138,116,761.98
期末基金份额净值	1.1410	1.1349
3.1.3 累计期末指标	2019年末	
基金份额累计净值增长率	14.10%	13.49%

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）湘财长顺混合发起式A收取认（申）购费和赎回费，湘财长顺混合发起式C不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费；

（3）上述基金业绩指标不包括持有人认购或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；

（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。



### 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

湘财长顺混合发起式A

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	15.28%	0.83%	5.79%	0.55%	9.49%	0.28%
过去六个月	17.58%	0.85%	5.95%	0.64%	11.63%	0.21%
自基金合同生效起至今	14.10%	0.74%	8.06%	0.86%	6.04%	-0.12%

湘财长顺混合发起式C

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	15.05%	0.83%	5.79%	0.55%	9.26%	0.28%
过去六个月	17.10%	0.85%	5.95%	0.64%	11.15%	0.21%
自基金合同生效起至今	13.49%	0.74%	8.06%	0.86%	5.43%	-0.12%

#### 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

湘财长顺混合发起式A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年03月28日-2019年12月31日)

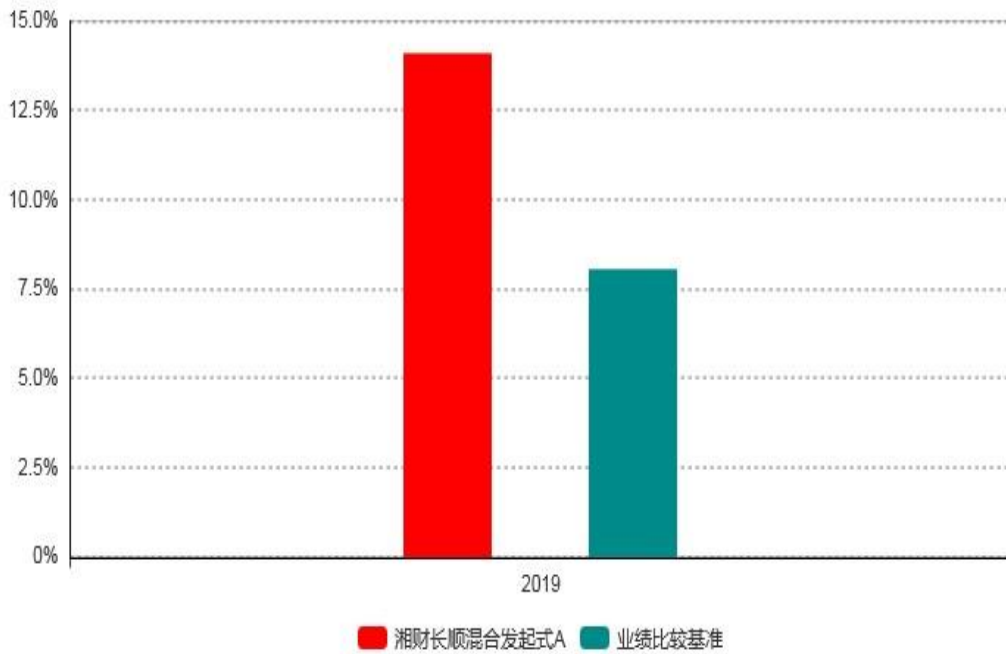


湘财长顺混合发起式C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

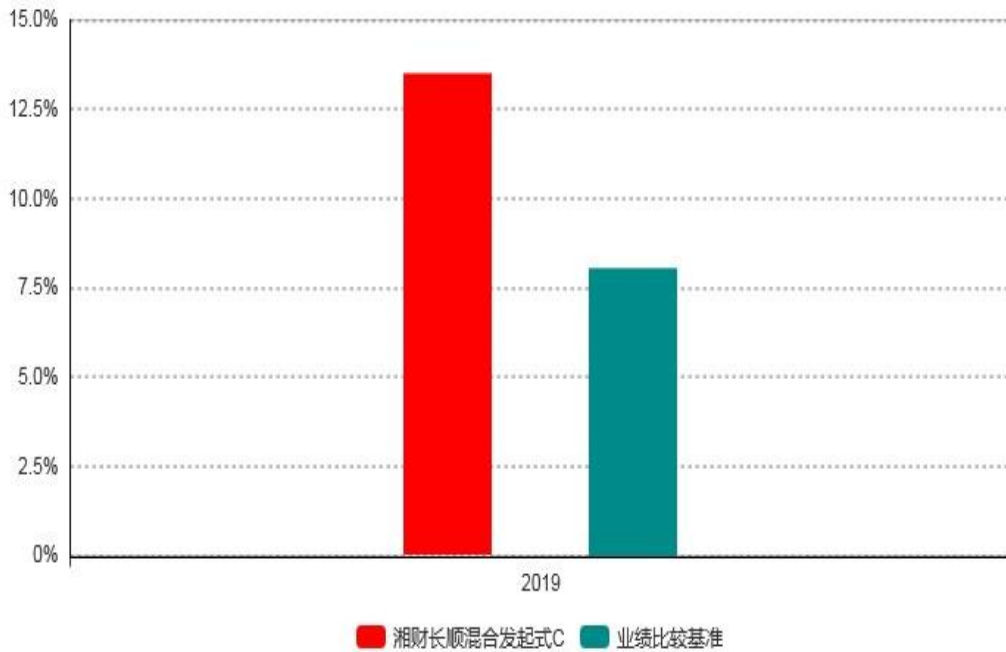
(2019年03月28日-2019年12月31日)



### 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



注：本基金合同于 2019 年 3 月 28 日生效，自基金合同生效日起至报告期末不满一年。本基金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。



注：本基金合同于 2019 年 3 月 28 日生效，自基金合同生效日起至报告期末不满一年。本基金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

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

## § 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

湘财基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2018]976号文批准于2018年7月设立，注册资本人民币1亿元。公司设立在上海，股东为湘财证券股份有限公司。公司秉承“卓识远见、睿智创新、诚信规范、财富共享”的经营理念，以投资者利益至上为核心，全力打造综合性的金融服务平台。截止至2019年12月31日，公司旗下共管理湘财长顺混合型发起式证券投资基金、湘财长源股票型证券投资基金2只开放式基金，资产管理规模8.15亿元。

#### 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		
任路	湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金经理	2019-03-28	-	7年	任路先生，美国宾夕法尼亚大学计算机与信息科学硕士，清华大学工学学士。具有开阔的投资视野与精准的投资能力，善于把握各个细分行业的龙头个股，通过逆向投资和趋势投资相结合的方式进行投资。曾任美国银行美林证券研究员（美国纽约总部），民生通惠资产管理有限公司投资经理，万家

					基金管理有限公司投资经理。现任湘财基金管理有限公司投资部，基金经理。
肖超虎	湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金经理	2019-03-28	-	12年	肖超虎先生，复旦大学经济学硕士，上海交通大学工学学士，具有12年证券投资研究经验。曾任安永华明会计师事务所审计员，光大证券研究所行业研究员，太平洋资产管理有限责任公司宏观策略研究员、投资助理、投资经理。2013年起在太平洋资产任投资经理助理，参与多个内部账户的投资管理，2016年12月至2018年1月任太平洋研究精选股票型产品投资经理。现任湘财基金管理有限公司投资部，基金经理。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，本基金管理人制定了《湘财基金管理有限公司公平交易制度》，建立了贯穿授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，涵盖股票、债券的一级市场申购与二级市场投资业务的公平交易机制。

本基金管理人建立了事前审核、事中监控和事后稽核的控制机制，依靠信息系统与人工相结合的方式，确保公司旗下不同投资组合实现研究成果共享、投资决策独立、集中交易公平执行、交易严密监控以及稽核分析客观独立。

#### 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易相关制度。

本基金管理人在报告期内仅本基金参与证券投资交易，故不存在与其他不同投资组合之间的公平交易问题。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未出现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%的情况。

报告期内，未发现任何可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

### 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

本报告期内，本基金管理人始终坚持主动量化的投资体系，在自上而下对行业进行精选和配置的基础上，充分发挥投资和研究团队两方面的优势，自下而上深入研究相关标的，精选具有估值优势的优质公司进行布局。主动量化的投资体系的效果得到了充分的体现，未来仍将一如既往，遵循投资框架和逻辑，争取为投资者创造价值。

从具体的策略和运作来看，本基金管理人对中国经济高质量发展充满信心，看好科技升级、产业升级和消费升级三大方向，在配置上也重点布局科技、消费和金融，并且根据市场和基本面的变化，对三个方向的配置进行了预调微调，其中最大的变化是四季度降低了消费的配置，相应增加了科技。在各个板块内部，本基金管理人也遵循产业和市场的发展逻辑，进行了有效的行业轮动。以科技行业为例，先后布局了通信设备、消费电子、半导体、传媒和新能源车，都取得了良好的效果。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末湘财长顺混合发起式A基金份额净值为1.1410元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.10%，同期业绩比较基准收益率为8.06%；截至报告期末湘财长顺混合发起式C基金份额净值为1.1349元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为13.49%，同期业绩比较基准收益率为8.06%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人对2020年的经济和市场仍然持谨慎乐观的态度。从宏观经济来看，2020年是全面建设小康社会的最后一年，也是十四五规划的起草年，具有承前启后的重要意义。中央经济工作会议对实现全面小康提出了明确的要求，货币政策稳健灵活、财政政策积极有效，防风险工作已经取得明显进展。预计宏观层面稳中有进，风险能得到有效控制。

从市场角度来看，中央仍然高度重视资本市场的定位，尤其重视资本市场在高科技产业发展中的中枢作用。证券法进行了新一轮的修订，这意味着资本市场的改革进入了新的阶段，注册制、长期资金入市、投资者保护、信息披露等一系列举措仍在稳步推进，资本市场的信心已经得到明显恢复。虽然2019年A股市场取得了较大幅度的上涨，但整体的估值水平并不高，沪深300的市盈率仅12.6倍，在全球市场中具有非常好的吸引力。即便考虑市场市盈率的中位数，沪深300和中证500的水平也只有21.6倍和22.4倍，可投资的标的数仍然非常多。

从市场风格来看，本基金管理人认为过去几年只有少数股票上涨的格局会得到修正，资金过度追逐所谓核心资产的现象不会一直持续下去，甚至会有一定程度的调整。随着经济和市场信心的恢复，投资者会对上市公司的价值进行重新评估，一部分被过度抛弃的行业和公司将重新获得投资者的青睐，尤其是具有长期发展潜力、质地良好的标的。

从板块和行业来看，本基金管理人仍然看好中国经济高质量发展的机会，看好科技升级、产业升级和消费升级的三大方向，继续在其中寻找和挖掘投资机会。5G仍然是2020年最重要的投资主线，本基金管理人继续沿着产业链向5G下游应用进行前瞻性布局，包括影视、营销、工业互联网、物联网等等。同时，本基金管理人也会积极关注新能源车、半导体、国防军工、自动化等产业升级领域的机会。在消费升级上，本基金管理人会积极挖掘文教体卫等新消费的机会，也会等待传统消费板块调整后的布局机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司督察长及其领导下的监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、信息披露、内部稽核、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，做到合规创造价值。推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- 1、持续进行制度建设，完善并落实公司的合规管理机制。本年度，公司持续推进制度建设，公司各项规章制度体系搭建完毕。公司的制度在领导的监督下得到有效落实实施。公司在制度建设的基础上，进一步建立并完善了合规与机制，并将各项经营活动的合规性要求嵌入业务管理制度与操作流程中，各项工作合规开展。

2、合规管理贯穿全业务流程，各部门全力支持在督察长的领导下，合规管理贯穿全业务流程。做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的审核与支持，坚持定期对投资、研究、交易、清算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

3、继续深化“人人合规、时时合规、事事合规”的理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、信息技术管理、信息披露、投研合规、科创板法律法规等方面的合规培训，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

4、按照法规的要求，配合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》进行制度和流程调整，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、准确、完整、及时、简明和易得。

5、有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，对于发现问题及时整改，持续提升对公司制度执行和风控措施的落实。

6、加强员工行为监督，落实合规考核。公司对员工日常行为进行合规检查。对于合规监测发现的问题，及时要求相关人员解释说明、督促整改。同时，按照公司合规考核的要求，对于相应员工进行合规考核扣分处理。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中与年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立估值委员会，成员由公司总经理、督察长、投资总监、运营部总经理、监察稽核部总经理、基金会计、风控专员和金融工程主管等成员组成。由于估值品种的特殊性，估值委员会可以增加临时成员。必要时可聘请外部定价机构或外部专家协助进行估值。估值委员会的投资研究相关人员，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。估值委员会定期评价现行估值政策和程序，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。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

上述参与基金估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。



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服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中证指数有限公司，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合《中华人民共和国基金法》、《湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定。

### § 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在湘财长顺混合型发起式证券投资基金（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的复核，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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天健审〔2020〕2-100号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	湘财长顺混合型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了湘财长顺混合型发起式证券投资基金（以下简称长顺基金）财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年度的利润表、持有人权益（计划净值）变动表，以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长顺基金2019年12月31日的财务状况，以及2019年度的经营成果和持有人权益（计划净值）变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长顺基金及其管理人湘财基金管理有限公司（以下简称基金管理人），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长顺基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清</p>

	<p>算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层（以下简称治理层）负责监督长顺基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长顺基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计</p>

	<p>报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长顺基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	黄源源	田冬青
会计师事务所的地址	中国·杭州	
审计报告日期	2020-03-23	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：湘财长顺混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	8,441,062.19
结算备付金		20,173,533.03
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	192,987,814.09
其中：股票投资		184,934,614.09
基金投资		-
债券投资		8,053,200.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	202,578.14
应收股利		-
应收申购款		13,134.41
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		221,818,121.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,441,793.24
应付管理人报酬		298,751.02
应付托管费		49,791.82
应付销售服务费		63,469.44
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	133,858.43
负债合计		1,987,663.95
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	193,315,402.98
未分配利润	7.4.7.10	26,515,054.93

所有者权益合计		219,830,457.91
负债和所有者权益总计		221,818,121.86

注：（1）报告截止日2019年12月31日，湘财长顺混合发起式A份额净值1.1410元，基金份额总额71,618,445.01份；湘财长顺混合发起式C份额净值1.1349元，基金份额总额121,696,957.97份。基金份额总额合计为193,315,402.98份。

（2）本基金合同生效日为2019年3月28日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

## 7.2 利润表

会计主体：湘财长顺混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		42,170,511.34
1. 利息收入		3,755,728.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	771,648.42
债券利息收入		1,189,046.27
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,795,033.38
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,019,855.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,014,682.14
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-1,041,823.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	4,252.43
股利收益	7.4.7.17	3,042,744.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.18	25,216,883.59

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7. 4. 7. 19	178, 044. 29
<b>减: 二、费用</b>		12, 136, 386. 72
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	5, 349, 484. 80
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	891, 580. 80
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	1, 284, 439. 68
4. 交易费用	7. 4. 7. 20	4, 475, 463. 20
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		18. 24
7. 其他费用	7. 4. 7. 21	135, 400. 00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		30, 034, 124. 62
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		30, 034, 124. 62

注: 本基金合同生效日为2019年3月28日, 至本报告期末, 本基金合同生效未满一年。

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 湘财长顺混合型发起式证券投资基金

本报告期: 2019年03月28日 (基金合同生效日) 至2019年12月31日

单位: 人民币元

项 目	本期 2019年03月28日 (基金合同生效日) 至2019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)	668, 305, 277. 24	-	668, 305, 277. 24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	30, 034, 124. 62	30, 034, 124. 62

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）	-474,989,874.26	-3,519,069.69	-478,508,943.95
其中：1. 基金申购款	2,772,701.77	159,546.88	2,932,248.65
2. 基金赎回款	-477,762,576.03	-3,678,616.57	-481,441,192.60
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）	193,315,402.98	26,515,054.93	219,830,457.91

注：本基金合同生效日为2019年3月28日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

报表附注为财务报表的组成部分。

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：

程涛

董志林

董志林

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

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

湘财长顺混合型发起式证券投资基金（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[2019]156号文《关于准予湘财长顺混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由湘财基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币668,175,681.79元，经天健会计师事务所(普通合伙)天健验[2019]2-8号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《湘财长顺混合型发起式证券



投资基金基金合同》于2019年3月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为668,175,681.79份基金份额，其中认购资金利息折合129,595.45份基金份额。本基金的基金管理人为湘财基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据2019年11月14日变更生效的《湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本集合基金投资范围如下：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（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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，但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的60%-95%；任何交易日日终在扣除股指期货及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保留的现金或到期在一年以内政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times$ 75%+上证国债指数收益率 $\times$ 25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为编制基础。

#### 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2019年3月28日至2019年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人也不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，基金管理人应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《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》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 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（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	76,721.34
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	8,364,340.85
合计	8,441,062.19

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	159,737,130.50	184,934,614.09	25,197,483.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,033,800.00	8,053,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	8,033,800.00	8,053,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	167,770,930.50	192,987,814.09	25,216,883.59

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有自买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	39.18
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	32,471.28
应收债券利息	168,503.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,564.67
合计	202,578.14

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日



应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,858.43
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	30,000.00
预提费用-信息披露费	100,000.00
合计	133,858.43

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 湘财长顺混合发起式A

金额单位：人民币元

项目 (湘财长顺混合发起式A)	本期2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	161,244,146.83	161,244,146.83
本期申购	497,602.12	497,602.12
本期赎回（以“-”号填列）	-90,123,303.94	-90,123,303.94
本期末	71,618,445.01	71,618,445.01

##### 7.4.7.9.2 湘财长顺混合发起式C

金额单位：人民币元

项目 (湘财长顺混合发起式C)	本期2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	507,061,130.41	507,061,130.41
本期申购	2,275,099.65	2,275,099.65
本期赎回（以“-”号填列）	-387,639,272.09	-387,639,272.09
本期末	121,696,957.97	121,696,957.97

注：

- 1、申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额；
- 2、本基金自2019年02月22日至2019年03月22日止期间公开发售，有效净认购资金共计人民币668,175,681.79元，折合为668,175,681.79份基金份额（其中A类基金份额161,206,230.29份，C类基金份额506,969,451.50份）。根据《湘财长顺混合型发起式

证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币129,595.45元，折合为129,595.45份基金份额（其中A类基金份额37,916.54份，C类基金份额91,678.91份），划入基金份额持有人账户；

3、根据《湘财长顺混合型发起式证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年06月27日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自2019年06月28日起开始办理。

4、本基金本报告期内未开放基金转换业务。

5、本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 湘财长顺混合发起式A

单位：人民币元

项目 (湘财长顺混合发起式 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,897,433.49	7,219,622.17	12,117,055.66
本期基金份额交易产生的变动数	373,238.06	-2,395,042.80	-2,021,804.74
其中：基金申购款	8,014.30	8,682.63	16,696.93
基金赎回款	365,223.76	-2,403,725.43	-2,038,501.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,270,671.55	4,824,579.37	10,095,250.92

##### 7.4.7.10.2 湘财长顺混合发起式C

单位：人民币元

项目 (湘财长顺混合发起式 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-80,192.46	17,997,261.42	17,917,068.96
本期基金份额交易产	8,335,689.18	-9,832,954.13	-1,497,264.95

生的变动数			
其中：基金申购款	83,273.79	59,576.16	142,849.95
基金赎回款	8,252,415.39	-9,892,530.29	-1,640,114.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,255,496.72	8,164,307.29	16,419,804.01

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	216,134.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	205,384.44
其他	350,129.12
合计	771,648.42

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	1,361,193,931.17
减：卖出股票成本总额	1,350,179,249.03
买卖股票差价收入	11,014,682.14

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内未持有基金。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,041,823.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,041,823.72

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	542,797,663.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	534,748,589.79
减：应收利息总额	9,090,897.91
买卖债券差价收入	-1,041,823.72

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
期货投资	4,252.43

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,042,744.54
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,042,744.54

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	25,216,883.59
——股票投资	25,197,483.59
——债券投资	19,400.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	25,216,883.59

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	178,044.29
合计	178,044.29

## 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	4,471,703.07
银行间市场交易费用	-
期货市场交易费用	3,760.13
合计	4,475,463.20

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	30,000.00
信息披露费	100,000.00

证券出借违约金	-
证券开户费	400.00
其他费用（法律咨询费）	5,000.00
合计	135,400.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至本报告期末，本基金没有需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
湘财基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	基金托管人、基金销售机构、本基金经纪服务商（2019年11月25日前）
湘财证券股份有限公司（“湘财证券”）	基金管理人股东、本基金经纪服务商（自2019年1月25日起）、基金销售机构
上海大智慧基金销售有限公司	基金管理人关联方、基金销售机构

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	2,667,366,660.92	93.19%

君安证券” )		
湘财证券股份有限 公司	194,809,640.38	6.81%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	1,024,606,455.18	99.80%
湘财证券股份有限 公司	2,008,800.00	0.20%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
国泰君安证券股份 有限公司	16,808,700,000.00	99.42%
湘财证券股份有限 公司	98,000,000.00	0.58%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019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
国泰君安证券股份有限公司	2,639,555.20	93.62%	-	-
湘财证券股份有限公司	179,970.08	6.38%	-	-

注：基金托管人国泰君安证券股份有限公司以及管理人股东湘财证券股份有限公司受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,349,484.80
其中：支付销售机构的客户维护费	1,015,930.25

1、支付基金管理人湘财基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月
----	-------------------------------------

	31日
当期发生的基金应支付的托管费	891,580.80

注：支付基金托管人国泰君安证券的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	湘财长顺混合发起式A	湘财长顺混合发起式C	合计
湘财证券股份有限公司	0.00	1,119,373.76	1,119,373.76
湘财基金管理有限公司	0.00	107,268.50	107,268.50
国泰君安证券股份有限公司	0.00	46,847.72	46,847.72
合计	0.00	1,273,489.98	1,273,489.98

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×0.50%÷当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

湘财长顺混合发起式A

份额单位：份

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年03月28日）持有的基金份额	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.17%

湘财长顺混合发起式C

份额单位：份

项目	本期 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年03月28日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出	0.00

总份额	
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

注：本基金管理人在本会计期间认购本基金的交易委托直销柜台办理，投资本基金按照公告的费率条款执行。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 2019年03月28日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	0.00	334,107.50
湘财证券股份有限公司	8,364,340.85	16,021.62

注：基金托管人国泰君安证券以及管理人股东湘财证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于国泰君安证券以及湘财证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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
688002	睿创微纳	2019-07-04	2020-01-22	新股流通受限	20.00	37.05	25,672	513,440.00	951,147.60	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-07-06	新股流通受限	43.98	43.98	2,990	131,500.20	131,500.20	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股发行未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-

上述可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

## 7.4.12.2 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
603799	华友钴业	2019-12-31	重大资产重组	39.39	2020-01-02	40.43	159,945	4,020,238.35	6,300,233.55	-

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无参与银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无参与交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金将风险可计量、可控制与可承担作为风险管理的主要政策，以承担目标风险获取最大收益为风险管理的主要目标。本基金管理人遵循“全面、独立、制衡、适时”的原则，建立了由董事会及其下设的风险管理委员会、经理层及其下设的风险控制委员会、督察长、监察稽核部以及相关部门构成的多层次、全方位的风险管理架构，将风险管理渗透至各个业务环节，覆盖所有部门和岗位。本基金管理人建立了以风险识别、风险计量、风险控制、风险评价和风险报告为一体的风险管理机制，有效识别、分析和评估公司日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指来源于借贷业务中的贷方、债券发行人及衍生产品交易对手的违约可能性。本基金的信用风险是指债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险、由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，以及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过建立内部评级体系、信用债券投资库和交易对手分类管理等制度，对发行人及债券投资进行内部评级并根据评级结果划分投资库，对交易对手的资信情况进行分析评估、设定授信额度，防范和控制可能出现的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	8,053,200.00
合计	8,053,200.00

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持有金融工具变现困难的风险。本基金流动性风险一方面来自于基金管理人无法以合理价格及时将持有的资产变现用以支付投资者赎回款项，另一方面来自于基金所持有的投资品种所处的交易市场不活跃而导致的变现困难。

本基金通过限制流动性受限资产和流通受限证券的比例、控制投资集中度等方式保证基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。同时，本基金管理人已建立多维度、全覆盖的综合性压力测试制度，由监察稽核部独立负责流动性压力测试的实施与评估。

于2019年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在日常运作中能合理安排所持有金融工具的流动性，使其与本基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，期末除7.4.12列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。本基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、持仓集中度、7个工作日可变现资产价值等反映资产流动性水平的风险指标，并由监察稽核部定期独立地开展综合性压力测试，详细评估在不同极端情景下资产变现水平的变化。

在负债端，本基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者结构和类型等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求。当市场环境和投资者结构发生变化时，及时调整基金资产结构与比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限相匹配。

如遇市场极端情况或非预期下的投资者巨额赎回情况，本基金管理人将采用基金合同约定的赎回申请处理方式及其他流动性管理工具，控制极端情形下的流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券价格、利率、汇率、商品价格等基础要素的变动导致基金所持有金融工具的公允价值或未来现金流发生波动的风险。本基金管理人通过检测基金组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由利率变动引起基金所持有的金融资产特别是债券资产的公允价值或未来现金流变动，从而影响基金投资收益的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债均不计息。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,441,062.19	-	-	-	-	-	8,441,062.19
结算备付金	20,173,533.03	-	-	-	-	-	20,173,533.03
交易性金融资产	-	-	8,053,200.00	-	-	184,934,614.09	192,987,814.09
应收利息	-	-	-	-	-	202,578.14	202,578.14
应收申购款	-	-	-	-	-	13,134.41	13,134.41
资产总计	28,614,595.22	-	8,053,200.00	-	-	185,150,326.64	221,818,121.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,441,793.24	1,441,793.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	298,751.02	298,751.02
应付托管费	-	-	-	-	-	49,791.82	49,791.82
应付销售服务费	-	-	-	-	-	63,469.44	63,469.44
其他负债	-	-	-	-	-	133,858.43	133,858.43
负债总计	-	-	-	-	-	1,987,663.95	1,987,663.95
利率敏感度缺口	28,614,595.22	-	8,053,200.00	-	-	183,162,662.69	219,830,457.91

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析



假设	假设所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年12月31日
	利率下降25个基点	8,932.30
	利率上升25个基点	-8,899.77

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指因外汇汇率变动引起金融工具的公允价值或未来现金流发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指除利率风险和外汇风险以外的市场因素的变动对基金所持有的金融工具的公允价值或未来现金流产生波动的风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格的变化或波动所引起的股票、债券和基金等各类资产损失的可能性。

本基金通过分散化投资降低投资组合市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施每日监控，并定期运用多种定量方法对本基金进行风险度量和评估，对风险进行及时有效的追踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	184,934,614.09	84.13
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,053,200.00	3.66

交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	192,987,814.09	87.79

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、测算组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额	
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2019年12月31日
	沪深300指数上升5%	11,498,533.50
	沪深300指数下降5%	-11,498,533.50

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2019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属于第一层次的余额为183,763,020.16元，属于第二层次的余额为9,224,793.93元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值与账面价值相若。

(2) 其他

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	184,934,614.09	83.37
	其中：股票	184,934,614.09	83.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,053,200.00	3.63
	其中：债券	8,053,200.00	3.63
	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	28,614,595.22	12.90

8	其他各项资产	215,712.55	0.10
9	合计	221,818,121.86	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	7,693,400.00	3.50
C	制造业	110,079,452.09	50.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,028,000.00	0.92
F	批发和零售业	-	-
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	15,828,480.00	7.20
J	金融业	21,408,900.00	9.74
K	房地产业	16,749,182.00	7.62
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	3,871,400.00	1.76
R	文化、体育和娱乐业	7,275,800.00	3.31
S	综合	-	-
	合计	184,934,614.09	84.13

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	559,900	9,059,182.00	4.12
2	000063	中兴通讯	230,000	8,139,700.00	3.70
3	300059	东方财富	420,000	6,623,400.00	3.01
4	603799	华友钴业	159,945	6,300,233.55	2.87
5	000671	阳光城	700,000	5,950,000.00	2.71
6	002487	大金重工	1,049,947	5,711,711.68	2.60
7	002918	蒙娜丽莎	280,000	5,605,600.00	2.55
8	002185	华天科技	750,000	5,602,500.00	2.55
9	300618	寒锐钴业	65,000	5,355,350.00	2.44
10	600583	海油工程	700,000	5,166,000.00	2.35
11	000977	浪潮信息	170,000	5,117,000.00	2.33
12	002777	久远银海	130,000	4,732,000.00	2.15
13	300360	炬华科技	369,977	4,680,209.05	2.13
14	601688	华泰证券	230,000	4,671,300.00	2.12
15	002739	万达电影	240,000	4,356,000.00	1.98
16	002709	天赐材料	210,000	4,347,000.00	1.98
17	002044	美年健康	260,000	3,871,400.00	1.76
18	002460	赣锋锂业	102,000	3,552,660.00	1.62
19	603659	璞泰来	35,000	2,980,250.00	1.36
20	600584	长电科技	130,000	2,857,400.00	1.30
21	300413	芒果超媒	80,000	2,796,800.00	1.27
22	002396	星网锐捷	77,000	2,738,120.00	1.25
23	002555	三七互娱	100,000	2,693,000.00	1.23
24	300207	欣旺达	135,000	2,635,200.00	1.20
25	600741	华域汽车	100,000	2,599,000.00	1.18

26	600885	宏发股份	74,000	2,549,300.00	1.16
27	002821	凯莱英	18,600	2,408,700.00	1.10
28	600837	海通证券	150,000	2,319,000.00	1.05
29	600030	中信证券	90,000	2,277,000.00	1.04
30	002624	完美世界	50,000	2,207,000.00	1.00
31	601818	光大银行	500,000	2,205,000.00	1.00
32	601166	兴业银行	110,000	2,178,000.00	0.99
33	002368	太极股份	55,000	2,140,600.00	0.97
34	300308	中际旭创	40,000	2,086,000.00	0.95
35	000807	云铝股份	400,000	2,056,000.00	0.94
36	601186	中国铁建	200,000	2,028,000.00	0.92
37	603788	宁波高发	120,000	1,984,800.00	0.90
38	002456	欧菲光	125,000	1,950,000.00	0.89
39	300035	中科电气	240,000	1,888,800.00	0.86
40	603986	兆易创新	8,919	1,827,413.91	0.83
41	600383	金地集团	120,000	1,740,000.00	0.79
42	002043	兔宝宝	230,000	1,690,500.00	0.77
43	002174	游族网络	70,000	1,628,900.00	0.74
44	002157	正邦科技	100,000	1,620,000.00	0.74
45	300502	新易盛	40,000	1,605,600.00	0.73
46	601808	中海油服	80,000	1,536,000.00	0.70
47	002466	天齐锂业	50,000	1,509,000.00	0.69
48	002371	北方华创	16,700	1,469,600.00	0.67
49	000725	京东方 A	320,000	1,452,800.00	0.66
50	300474	景嘉微	23,000	1,347,340.00	0.61
51	300113	顺网科技	52,000	1,335,880.00	0.61
52	002541	鸿路钢构	120,000	1,270,800.00	0.58
53	002685	华东重机	168,000	1,139,040.00	0.52
54	601601	中国太保	30,000	1,135,200.00	0.52
55	600567	山鹰纸业	300,000	1,131,000.00	0.51

56	000100	TCL 科技	250,000	1,117,500.00	0.51
57	002831	裕同科技	41,920	1,112,976.00	0.51
58	300033	同花顺	10,000	1,091,100.00	0.50
59	603583	捷昌驱动	24,000	1,068,720.00	0.49
60	688002	睿创微纳	25,672	951,147.60	0.43
61	600745	闻泰科技	10,000	925,000.00	0.42
62	002847	盐津铺子	25,000	902,500.00	0.41
63	002152	广电运通	87,000	836,070.00	0.38
64	688363	华熙生物	9,800	817,320.00	0.37
65	600362	江西铜业	40,000	677,200.00	0.31
66	601899	紫金矿业	140,000	642,600.00	0.29
67	603808	歌力思	40,000	594,800.00	0.27
68	601877	正泰电器	20,000	536,000.00	0.24
69	300601	康泰生物	6,000	526,740.00	0.24
70	603993	洛阳钼业	80,000	348,800.00	0.16
71	688199	久日新材	4,494	278,178.60	0.13
72	688299	长阳科技	11,341	196,085.89	0.09
73	688181	八亿时空	2,990	131,500.20	0.06
74	600136	当代明诚	10,000	123,000.00	0.06
75	688288	鸿泉物联	3,429	110,139.48	0.05
76	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.04

#### 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	37,494,193.89	17.06
2	000063	中兴通讯	36,514,994.64	16.61
3	601688	华泰证券	35,228,815.55	16.03
4	600460	士兰微	27,836,549.07	12.66

5	600837	海通证券	27,606,523.75	12.56
6	300059	东方财富	23,622,078.11	10.75
7	002371	北方华创	20,733,124.60	9.43
8	603986	兆易创新	20,357,265.75	9.26
9	002916	深南电路	19,702,876.51	8.96
10	000977	浪潮信息	19,173,458.09	8.72
11	601318	中国平安	19,165,161.00	8.72
12	002415	海康威视	18,698,406.10	8.51
13	600104	上汽集团	17,460,240.25	7.94
14	601166	兴业银行	17,107,712.00	7.78
15	601138	工业富联	16,395,758.00	7.46
16	000858	五粮液	15,473,125.51	7.04
17	002463	沪电股份	15,361,528.00	6.99
18	002049	紫光国微	15,216,564.24	6.92
19	000568	泸州老窖	14,839,852.35	6.75
20	000002	万科A	14,483,396.00	6.59
21	600519	贵州茅台	14,457,543.04	6.58
22	300033	同花顺	14,418,419.69	6.56
23	600048	保利地产	14,040,745.66	6.39
24	600660	福耀玻璃	13,430,813.81	6.11
25	002507	涪陵榨菜	13,228,496.88	6.02
26	600583	海油工程	12,426,955.51	5.65
27	600667	太极实业	11,935,276.00	5.43
28	600171	上海贝岭	11,742,741.40	5.34
29	000877	天山股份	11,453,778.97	5.21
30	002727	一心堂	11,217,814.74	5.10
31	000928	中钢国际	11,151,254.76	5.07
32	002044	美年健康	10,732,198.80	4.88
33	000333	美的集团	10,687,634.96	4.86
34	300498	温氏股份	10,529,394.00	4.79



35	300036	超图软件	10,283,944.85	4.68
36	600702	舍得酒业	9,279,956.37	4.22
37	600741	华域汽车	9,154,534.00	4.16
38	002241	歌尔股份	8,868,138.95	4.03
39	002792	通宇通讯	8,803,802.50	4.00
40	603929	亚翔集成	8,423,326.00	3.83
41	603083	剑桥科技	8,353,710.86	3.80
42	601881	中国银河	8,307,146.00	3.78
43	600486	扬农化工	8,184,627.40	3.72
44	300618	寒锐钴业	8,132,339.94	3.70
45	601100	恒立液压	8,131,937.85	3.70
46	002127	南极电商	8,012,201.00	3.64
47	002035	华帝股份	7,991,069.00	3.64
48	601633	长城汽车	7,930,569.00	3.61
49	002110	三钢闽光	7,914,555.94	3.60
50	601336	新华保险	7,834,842.00	3.56
51	603019	中科曙光	7,729,835.00	3.52
52	002697	红旗连锁	7,661,110.10	3.49
53	600867	通化东宝	7,614,996.48	3.46
54	600276	恒瑞医药	7,566,753.78	3.44
55	300360	炬华科技	7,325,606.25	3.33
56	300308	中际旭创	7,303,747.00	3.32
57	002624	完美世界	7,166,350.48	3.26
58	600383	金地集团	7,090,148.00	3.23
59	601985	中国核电	7,045,211.00	3.20
60	002739	万达电影	7,026,667.98	3.20
61	600305	恒顺醋业	7,022,209.20	3.19
62	300558	贝达药业	6,959,679.00	3.17
63	002129	中环股份	6,911,974.00	3.14
64	002918	蒙娜丽莎	6,882,509.30	3.13

65	600612	老凤祥	6,780,421.32	3.08
66	002555	三七互娱	6,560,583.93	2.98
67	000671	阳光城	6,499,443.00	2.96
68	601233	桐昆股份	6,452,898.55	2.94
69	600482	中国动力	6,432,418.40	2.93
70	002384	东山精密	6,139,183.28	2.79
71	300502	新易盛	6,106,911.00	2.78
72	600201	生物股份	6,101,429.43	2.78
73	002773	康弘药业	6,026,654.94	2.74
74	002670	国盛金控	6,006,092.00	2.73
75	002487	大金重工	5,917,237.82	2.69
76	601818	光大银行	5,854,200.00	2.66
77	600352	浙江龙盛	5,818,593.00	2.65
78	300750	宁德时代	5,656,375.00	2.57
79	601628	中国人寿	5,557,182.00	2.53
80	002281	光迅科技	5,506,934.76	2.51
81	000708	中信特钢	5,463,378.00	2.49
82	300253	卫宁健康	5,454,804.60	2.48
83	001979	招商蛇口	5,431,791.00	2.47
84	000938	紫光股份	5,319,621.00	2.42
85	000338	潍柴动力	5,313,697.00	2.42
86	002777	久远银海	5,212,383.00	2.37
87	601186	中国铁建	5,073,657.00	2.31
88	601009	南京银行	5,062,458.00	2.30
89	600009	上海机场	5,043,594.46	2.29
90	000625	长安汽车	5,025,591.60	2.29
91	600176	中国巨石	4,975,216.00	2.26
92	300284	苏交科	4,889,777.48	2.22
93	300383	光环新网	4,883,134.06	2.22
94	002466	天齐锂业	4,875,733.66	2.22

95	600436	片仔癀	4,873,886.19	2.22
96	603018	中设集团	4,850,920.28	2.21
97	002714	牧原股份	4,846,246.75	2.20
98	002508	老板电器	4,782,140.00	2.18
99	002185	华天科技	4,679,434.28	2.13
100	300760	迈瑞医疗	4,647,049.00	2.11
101	600859	王府井	4,639,122.74	2.11
102	000783	长江证券	4,617,048.00	2.10
103	000596	古井贡酒	4,551,406.00	2.07
104	600588	用友网络	4,540,095.00	2.07
105	000988	华工科技	4,534,525.02	2.06
106	000998	隆平高科	4,510,715.10	2.05
107	601933	永辉超市	4,500,364.00	2.05
108	002709	天赐材料	4,487,875.20	2.04
109	300413	芒果超媒	4,455,117.40	2.03
110	600438	通威股份	4,417,797.00	2.01
111	002142	宁波银行	4,408,806.12	2.01

注：本项“买入金额”按买入成交金额（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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	35,187,146.29	16.01
2	601688	华泰证券	31,334,376.81	14.25
3	000063	中兴通讯	27,348,882.00	12.44
4	600837	海通证券	24,544,649.78	11.17
5	600460	士兰微	23,496,919.05	10.69
6	002463	沪电股份	22,732,645.31	10.34
7	601318	中国平安	20,380,739.00	9.27

8	002415	海康威视	19,360,542.12	8.81
9	601138	工业富联	18,805,144.54	8.55
10	603986	兆易创新	18,710,410.57	8.51
11	600519	贵州茅台	17,818,404.36	8.11
12	300059	东方财富	17,775,779.06	8.09
13	002916	深南电路	17,467,147.24	7.95
14	002371	北方华创	17,364,115.96	7.90
15	000858	五粮液	17,311,680.00	7.88
16	000568	泸州老窖	16,739,662.65	7.61
17	600104	上汽集团	16,458,074.48	7.49
18	601166	兴业银行	15,137,286.90	6.89
19	000002	万科A	14,467,157.50	6.58
20	000977	浪潮信息	14,158,667.86	6.44
21	300033	同花顺	13,531,920.62	6.16
22	600660	福耀玻璃	13,257,034.71	6.03
23	002049	紫光国微	12,941,864.17	5.89
24	002507	涪陵榨菜	12,283,944.50	5.59
25	000877	天山股份	11,943,494.00	5.43
26	002241	歌尔股份	11,583,478.00	5.27
27	600171	上海贝岭	11,463,256.12	5.21
28	000928	中钢国际	11,310,601.32	5.15
29	300036	超图软件	11,305,053.00	5.14
30	002727	一心堂	10,980,152.40	4.99
31	000333	美的集团	10,827,137.00	4.93
32	300498	温氏股份	10,144,354.29	4.61
33	600667	太极实业	9,900,388.43	4.50
34	600702	舍得酒业	9,083,129.63	4.13
35	002792	通宇通讯	8,912,204.00	4.05
36	601881	中国银河	8,606,770.00	3.92
37	002697	红旗连锁	8,522,832.78	3.88

38	600276	恒瑞医药	8,510,699.86	3.87
39	603929	亚翔集成	8,426,993.00	3.83
40	600583	海油工程	8,333,656.00	3.79
41	600486	扬农化工	8,010,225.80	3.64
42	300558	贝达药业	7,992,996.00	3.64
43	002624	完美世界	7,971,818.91	3.63
44	603083	剑桥科技	7,904,407.10	3.60
45	002035	华帝股份	7,860,479.00	3.58
46	601100	恒立液压	7,458,220.55	3.39
47	600305	恒顺醋业	7,452,007.00	3.39
48	002127	南极电商	7,403,965.00	3.37
49	601633	长城汽车	7,357,936.65	3.35
50	002044	美年健康	7,246,220.52	3.30
51	601336	新华保险	7,158,167.00	3.26
52	601985	中国核电	6,833,000.00	3.11
53	002110	三钢闽光	6,828,610.92	3.11
54	603019	中科曙光	6,793,514.60	3.09
55	600867	通化东宝	6,739,700.66	3.07
56	600201	生物股份	6,661,385.60	3.03
57	600612	老凤祥	6,642,068.10	3.02
58	002129	中环股份	6,555,727.00	2.98
59	600741	华域汽车	6,454,193.00	2.94
60	002281	光迅科技	6,363,311.60	2.89
61	300253	卫宁健康	6,197,158.76	2.82
62	601233	桐昆股份	6,178,775.28	2.81
63	002384	东山精密	6,107,739.00	2.78
64	002670	国盛金控	5,995,300.18	2.73
65	002714	牧原股份	5,880,116.00	2.67
66	002508	老板电器	5,854,826.00	2.66
67	002773	康弘药业	5,823,473.07	2.65

68	600048	保利地产	5,752,322.00	2.62
69	601628	中国人寿	5,664,046.00	2.58
70	300502	新易盛	5,563,364.00	2.53
71	600482	中国动力	5,518,163.84	2.51
72	600009	上海机场	5,507,023.85	2.51
73	300750	宁德时代	5,470,998.00	2.49
74	300383	光环新网	5,382,181.00	2.45
75	000625	长安汽车	5,375,712.00	2.45
76	000708	中信特钢	5,360,000.00	2.44
77	000938	紫光股份	5,338,272.07	2.43
78	001979	招商蛇口	5,247,822.98	2.39
79	600383	金地集团	5,241,452.00	2.38
80	000338	潍柴动力	5,161,471.00	2.35
81	600352	浙江龙盛	5,072,193.98	2.31
82	300308	中际旭创	5,054,708.60	2.30
83	300760	迈瑞医疗	5,036,623.64	2.29
84	000988	华工科技	4,920,552.00	2.24
85	300394	天孚通信	4,906,017.00	2.23
86	000596	古井贡酒	4,867,724.00	2.21
87	600176	中国巨石	4,833,546.00	2.20
88	688009	中国通号	4,744,589.04	2.16
89	300284	苏文科	4,742,495.50	2.16
90	601009	南京银行	4,732,434.00	2.15
91	000049	德赛电池	4,687,257.35	2.13
92	000783	长江证券	4,497,428.00	2.05
93	603899	晨光文具	4,489,939.00	2.04
94	603018	中设集团	4,476,123.96	2.04
95	002142	宁波银行	4,436,038.53	2.02

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额（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	1,509,916,379.53
卖出股票收入（成交）总额	1,361,193,931.17

注：买入股票成本、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	8,053,200.00	3.66
	其中：政策性金融债	8,053,200.00	3.66
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	8,053,200.00	3.66

## 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	018007	国开1801	40,000	4,030,000.00	1.83
2	108602	国开1704	40,000	4,023,200.00	1.83

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

**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**

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**

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**

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**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					4,252.43
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未参与国债期货交易。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金投资前十大证券中保利地产(600048)的发行人保利发展控股集团股份有限公司因违反税收管理于2019年8月26日被国家税务总局广州市税务局第三税务分局行政处罚。本基金投资前十大证券中海油工程(600583)的发行人海洋石油工程股份有限公司因涉嫌违反法律法规于2019年7月23日被天津市住房城乡建设委纳入黑名单、通报批评。本基金投资决策说明：本基金投研团队基于对保利地产、海油工程基本面的研究，认为上述事件不会对其经营活动业绩产生重大影响，也不会改变其长期投资价值。本基金管理人对上述股票的投资决策遵循公司的投资决策制度。**

**8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。**



## 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	202,578.14
5	应收申购款	13,134.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	215,712.55

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
01	603799	华友钴业	6,300,233.55	2.87	因重大资产重组申请停牌

## § 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

份额级别	持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
湘财 长顺 混合 发起 式A	954	75,071.75	10,000,000.00	13.9 6%	61,618,445.01	86.04%
湘财 长顺 混合 发起 式C	1,98 9	61,185.00	3,050,486.00	2.51%	118,646,471.97	97.49%
合计	2,84 5	67,949.18	13,050,486.00	6.75%	180,264,916.98	93.25%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	湘财长顺混合发 起式A	682,672.96	0.95%
	湘财长顺混合发 起式C	40,070.15	0.03%
	合计	722,743.11	0.37%

## 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情况

项目	份额级别	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	湘财长顺混合发起 式A	10~50
	湘财长顺混合发起 式C	0~10
	合计	10~50

本基金基金经理持有本开放式基金	湘财长顺混合发起式A	0~10
	湘财长顺混合发起式C	0
	合计	0~10

#### 9.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	5.17%	10,000,000.00	5.17%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,000,000.00	5.17%	10,000,000.00	5.17%	3年

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	湘财长顺混合发起式A	湘财长顺混合发起式C
基金合同生效日(2019年03月28日)基金份额总额	161,244,146.83	507,061,130.41
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	497,602.12	2,275,099.65
减：基金合同生效日起至报告期	90,123,303.94	387,639,272.09

期末基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	71,618,445.01	121,696,957.97

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

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、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

1) 2019年6月27日，基金管理人发布了《湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年6月25日起，程涛先生新任本基金管理人的总经理，来君女士不再担任本基金管理人的总经理。

2) 2019年7月3日，基金管理人发布了《湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年7月1日起，来君女士新任本基金管理人的副总经理，董志林先生新任本基金管理人的首席信息官。

3) 2019年12月21日，基金管理人发布了《湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自2019年12月20日起，孟爽女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况：30,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

## 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

本报告期内无管理人、托管人及高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

## 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	
国泰君安证券	2	2,667,366,660.92	93.19%	2,639,555.20	93.62%	-
湘财证券	2	194,809,640.38	6.81%	179,970.08	6.38%	-

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券	1,024,606,455.18	99.80%	16,808,700,000.00	99.42%	-	-	-	-
湘财证券	2,008,800.00	0.20%	98,000,000.00	0.58%	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-03-29
2	关于国泰君安证券资产托管	基金托管人公司网站	2019-06-19

	部办公地址变更的公告		
3	湘财基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-06-24
4	湘财长顺混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-06-26
5	湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-06-27
6	湘财基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳前海财厚基金销售有限公司及喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资以及参与其费率优惠活动的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-06-28
7	湘财基金管理有限公司半年度最后一日基金净值公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-07-01
8	湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-07-03
9	湘财长顺混合型发起式证券投资基金2019年第二季度报告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-07-19
10	湘财基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司及上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-07-24
11	湘财基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资以及参与	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-08-25

	其费率优惠活动的公告		
12	湘财长顺混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告及摘要	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-08-29
13	湘财基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资以及参与其费率优惠活动的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-10-18
14	湘财基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	《上海证券报》	2019-10-25
15	湘财长顺混合型发起式证券投资基金2019年第三季度报告	证监会指定网站	2019-10-25
16	湘财基金管理有限公司关于旗下基金增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资以及参与其费率优惠活动的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-10-07
17	湘财基金管理有限公司关于湘财长顺混合型发起式证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-11-14
18	湘财长顺混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及摘要	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-11-14
19	湘财基金管理有限公司关于旗下基金增加中信建投证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资以及参与	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-12-20

	其费率优惠活动的公告		
20	湘财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-12-21
21	湘财基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供、更新身份信息的公告	《上海证券报》和证监会指定网站	2019-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 2、《湘财长顺混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《湘财长顺混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《湘财长顺混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 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、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所，并登载于中国证监会基金电子披露网站和基金管理人互联网站www.xc-fund.com。

### 13.3 查阅方式

投资者可登陆中国证监会基金电子披露网站和基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅。

湘财基金管理有限公司  
二〇二〇年三月二十六日



