

**长安泓源纯债债券型证券投资基金**  
**(原长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型)**

**2019 年年度报告**

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2020 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。

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2020年3月30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。

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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料已经审计。

本报告中，原长安鑫恒回报混合型证券投资基金报告期自2019年1月1日至5月9日止，长安泓源纯债债券型证券投资基金报告期自2019年5月10日至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	11
2.4 信息披露方式.....	12
2.5 其他相关资料.....	12
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后).....	12
3.1 主要会计数据和财务指标.....	12
3.2 基金净值表现.....	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	17
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）.....	17
3.1 主要会计数据和财务指标.....	17
3.2 基金净值表现.....	18
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	23
§4 管理人报告.....	23
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	23
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	24
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	24
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.....	25
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	26
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	26
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	27
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	27
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	27
4.10 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.....	27
§5 托管人报告.....	27
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	27
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.....	27
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.....	28
§6 审计报告(转型后).....	28
6.1 审计报告基本信息.....	28
6.2 审计报告的基本内容.....	28
§6 审计报告(转型前).....	31
6.1 审计报告基本信息.....	31
6.2 审计报告的基本内容.....	31
§7 年度财务报表(转型后).....	34
7.1 资产负债表.....	34
7.2 利润表.....	36
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	37
7.4 报表附注.....	38
§7 年度财务报表(转型前).....	63
7.1 资产负债表.....	63
7.2 利润表.....	65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	67
7.4 报表附注.....	69
§8 投资组合报告(转型后).....	96
8.1 期末基金资产组合情况.....	96
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	96
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.....	96
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	96
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	97
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.....	97
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.....	98
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.....	98
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.....	98
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	98
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	98
8.12 投资组合报告附注.....	98
§8 投资组合报告（转型前）.....	99
8.1 期末基金资产组合情况.....	99
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	100
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.....	100
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	100
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	102
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.....	102
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.....	102
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.....	102
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.....	102
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	102
8.12 投资组合报告附注.....	103
§9 基金份额持有人信息(转型后).....	104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	104
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.....	104
§9 基金份额持有人信息(转型前).....	105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	105
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.....	106
§10 开放式基金份额变动(转型后).....	106
§10 开放式基金份额变动(转型前).....	106
§11 重大事件揭示.....	107
11.1 基金份额持有人大会决议.....	107
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.....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	107
11.4 基金投资策略的改变.....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	109
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.....	109
转型后.....	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	109
转型前.....	110

---

11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	111
11.8	其他重大事件	112
§12	影响投资者决策的其他重要信息	117
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	117
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	118
§13	备查文件目录	118
13.1	备查文件目录	118
13.2	存放地点	119
13.3	查阅方式	119

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 转型后

基金名称	长安泓源纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长安泓源纯债债券	
基金主代码	004897	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2019年05月10日	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
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	987,983,504.27份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安泓源纯债债券A	长安泓源纯债债券C
下属分级基金的交易代码	004897	004898
报告期末下属分级基金的份额总额	134,850,604.62份	853,132,899.65份

#### 转型前

基金名称	长安鑫恒回报混合型证券投资基金	
基金简称	长安鑫恒回报	
基金主代码	004897	
交易代码	-	-
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年07月27日	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
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	2,007,105.21份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C
下属分级基金的交易代码	004897	004898
报告期末下属分级基金的份额总额	939,506.38份	1,067,598.83份

## 2.2 基金产品说明

### 转型后

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、久期策略</p> <p>久期策略主要指根据对经济、政策和市场的分析，确定债券组合的久期水平。</p> <p>本基金将全面、深入研究影响利率变化的宏观因素，如经济增长率、通货膨胀、国际收支等的变化，进而判断经济政策的基调和走向，结合债券市场资金供给结构、流动性充裕情况以及投资人避险情绪等的变化，判断和预测未来利率的可能走势，确定并调整投资组合的久期水平。当预期市场利率水平下降时，提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期市场利率水平上升时，降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>类属配置策略即决定资金在不同类属债券间的配置。</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析及对宏观经济发展的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构的资金情况，并根据不同类型债券的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好及流动性等因素，在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债券、利率债券等资产类别之间进行类属配置，确定具有最优风险收益特征的资产组合。</p> <p>3、期限结构策略</p> <p>期限结构策略指通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对不同期限的债券进行合理配置。本基金将分析同一类属债券的收益率曲线形态和期限结构变动，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。具体来看，可分为跟踪收益率</p>

	<p>曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、哑铃策略及梯形策略。</p> <p>4、信用债券策略</p> <p>信用债券收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两方面影响，一是该信用债券对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债券本身的信用变化。基于上述两方面因素，本基金采用以下投资策略：</p> <p>基于信用利差曲线变化的策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债券市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。</p> <p>基于信用债券信用变化的策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后的债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债券定价。影响信用债券信用风险的因素包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>6、回购套利策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。</p>
业绩比较基准	中国债券综合全价指数的收益率



风险收益特征	本基金为债券型基金，预期风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
--------	--

## 转型前

投资目标	在严格控制风险和保持流动性的前提下，通过主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金投资策略包括三个大的方面，即大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将综合分析宏观经济、国家政策、资本市场等影响证券市场的重要因素，评估各类资产的收益和风险，从而确定基金资产在股票、债券及货币市场工具等类别资产的配置比例范围，并动态跟踪各类证券风险收益特征的相对变化动态，调整具体配置比例，平衡投资组合的风险和收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金将结合定量和定性分析，筛选出具有行业领先地位、业绩优良、估值合理、表现稳健的公司，并重点选择所属行业符合经济发展趋势和方向、具有较大增长潜力或发展空间的公司构建股票组合。</p> <p>1、股票选择策略</p> <p>本基金将结合定量和定性分析，从业务发展、治理结构以及公司规模、估值等方面进行综合评估，筛选出具有行业领先地位、业绩优良、估值合理、表现稳健的公司。本基金股票选择标准如下：</p> <p>（1）具有较高市场占有率，主营业务收入是公司收入的主要来源，主营业务收入位于所属行业前二分之一；</p> <p>（2）具有较强的核心竞争力，在商业模式、产品开发、服务体系、技术水平、营销网络、资源优势、品牌影响等方面培育了较强的核心竞争力；</p> <p>（3）具有较好的盈利能力，公司的销售毛利率、资产回报率（ROA）等处于所属行业前列，且盈利能力较为稳定，股息率相对较高；</p> <p>（4）具有良好的治理结构，管理规范，信息透明，</p>

管理层较为稳定；

（5）具有较长时间的经营历史，能够较好适应不同的经济发展环境；

（6）估值合理，公司的PE、PB或EV/EBIT等估值指标合理或低于市场平均水平。

## 2、组合构建策略

本基金将对筛选出的股票按照行业进行分类，重点选择所属行业符合经济发展趋势和方向、具有较大增长潜力或发展空间的公司构建股票组合，并适度追求行业的分散性，控制组合内同一行业公司的数量。

本基金将根据股票筛选标准，定期更新入选股票池，并根据经济和社会发展趋势与方向、国家宏观经济政策、资本市场发展等情况，动态调整股票组合。

### （三）债券投资策略

#### 1、普通债券投资策略

本基金将通过分析宏观经济发展趋势、利率变动趋势及市场信用环境变化方向和长期利率的发展趋势，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性、税赋特点、信用风险等因素，采取久期策略、收益率曲线策略、息差策略、骑乘策略、类别选择策略、个券选择策略、回购套利策略等多种策略，精选安全边际较高的个券进行投资，同时根据宏观经济、货币政策和流动性等情况的变化，调整组合利率债和信用债的投资比例、组合的久期等，以获取债券市场的长期稳健收益。

#### 2、可转债投资策略

本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上，选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好以及基础股票基本面良好的品种进行投资。

### （四）资产支持证券投资策略

本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利

	<p>差分析和期权定价模型等方法，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资。</p> <p>（五）衍生品投资策略</p> <p>1、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为主要目的，适度参与股指期货投资。本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况，通过对现货和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估，并通过与现货资产进行匹配，选择合适的投资时机。</p> <p>2、国债期货投资策略</p> <p>本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济运行情况、政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。基金管理人通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>3、权证投资策略</p> <p>本基金将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 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	长安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波
	联系电话	021-20329700
	电子邮箱	service@changanfunds.com
		贺倩
		010-66060069
		tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-820-9688	95599
传真	021-50598018	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	201204	100031
法定代表人	万跃楠	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.changanfunds.com">http://www.changanfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)

### 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	2019年05月10日（基金合同生效日） - 2019年12月31日	
	长安泓源纯债债券A	长安泓源纯债债券C
本期已实现收益	1,176,434.46	7,069,148.71

本期利润	2,186,148.81	12,727,946.36
加权平均基金份额本期利润	0.0484	0.0449
本期加权平均净值利润率	4.33%	3.98%
本期基金份额净值增长率	10.44%	10.37%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2019年末	
期末可供分配利润	17,303,967.56	117,543,686.65
期末可供分配基金份额利润	0.1283	0.1378
期末基金资产净值	152,154,572.18	970,676,586.30
期末基金份额净值	1.1283	1.1378
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019年末	
基金份额累计净值增长率	10.44%	10.37%

- 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。
- 3、对期末可供分配利润，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。
- 4、本报告期自2019年5月10日至12月31日止。

### 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

长安泓源纯债债券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	1.51%	0.03%	0.61%	0.04%	0.90%	-0.01%
过去六个月	7.60%	0.21%	1.07%	0.04%	6.53%	0.17%
自基金合同生效起至今	10.44%	0.26%	1.50%	0.04%	8.94%	0.22%

1、本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。本基金的合同生效日为 2019 年 5 月 10 日。

2、本基金整体业绩比较基准构成为：中国债券综合全价指数的收益率。

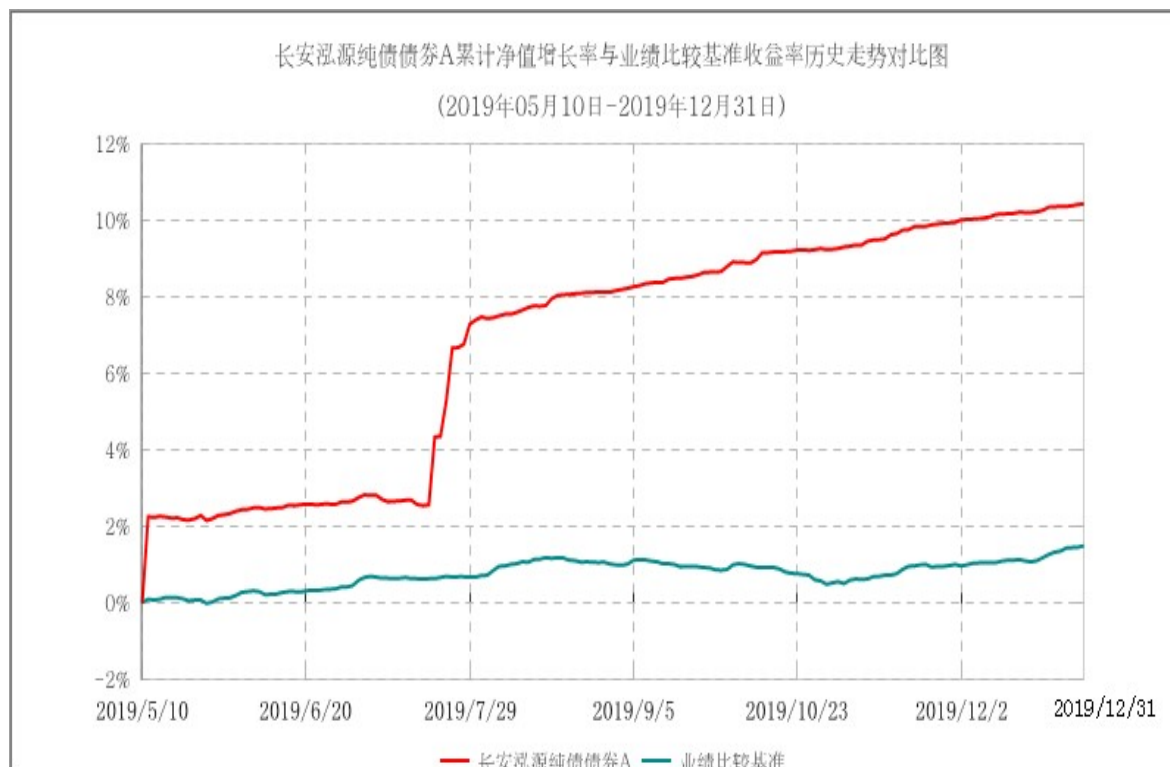
长安泓源纯债债券C

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	1.48%	0.03%	0.61%	0.04%	0.87%	-0.01%
过去六个月	7.53%	0.21%	1.07%	0.04%	6.46%	0.17%
自基金合同生效起至今	10.37%	0.26%	1.50%	0.04%	8.87%	0.22%

1、本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。本基金的合同生效日为 2019 年 5 月 10 日。

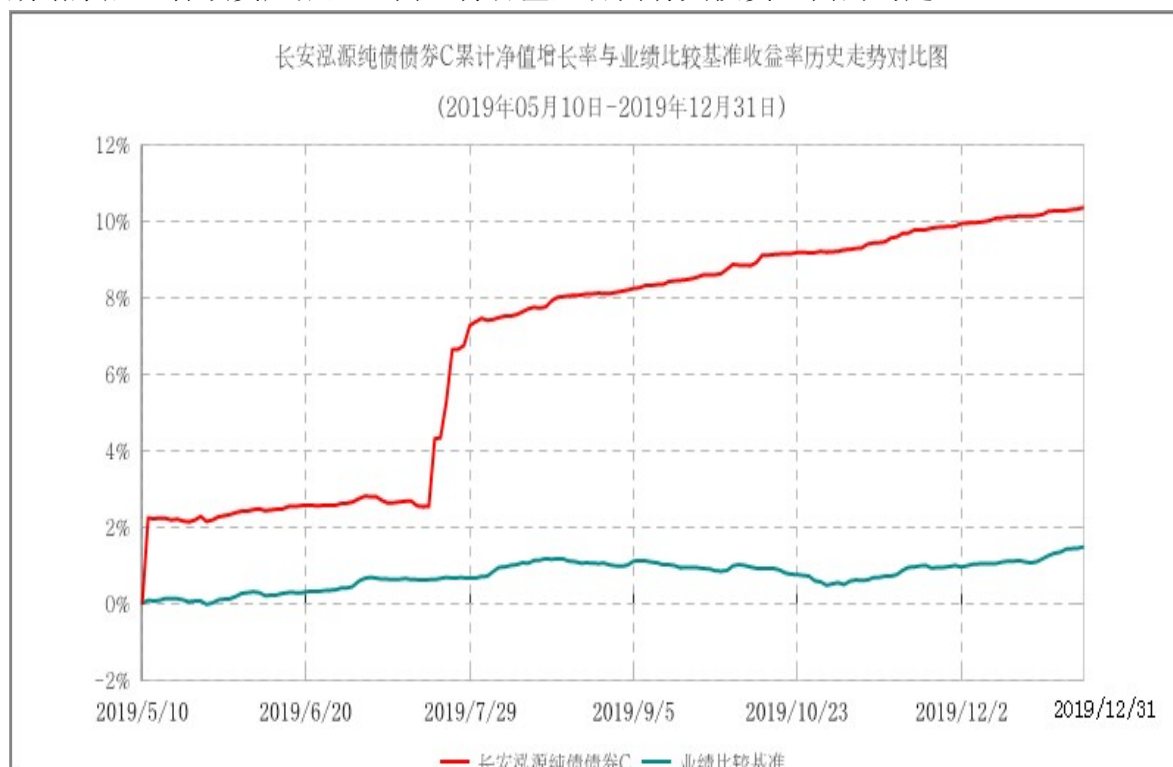
2、本基金整体业绩比较基准构成为：中国债券综合全价指数的收益率。

### 3.2.2 自基金转型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



1、本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。本报告期自 2019 年 5 月 10 日至 12 月 31 日止。截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

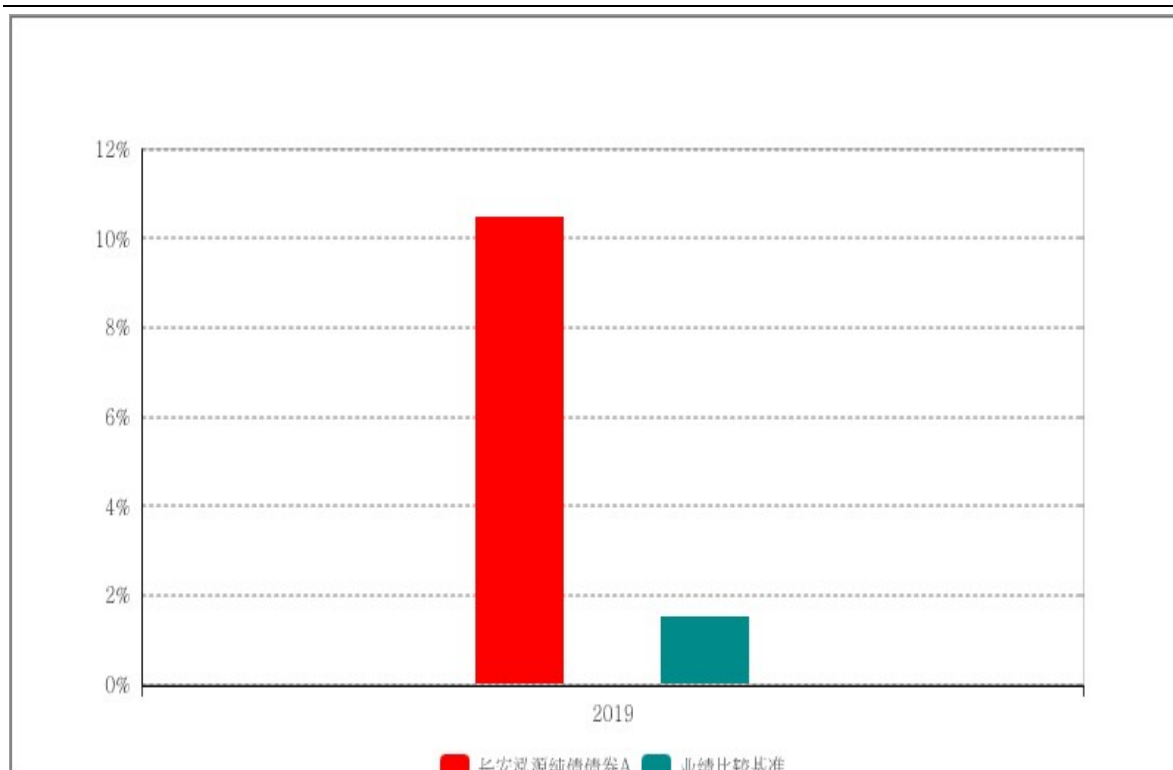
2、自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。



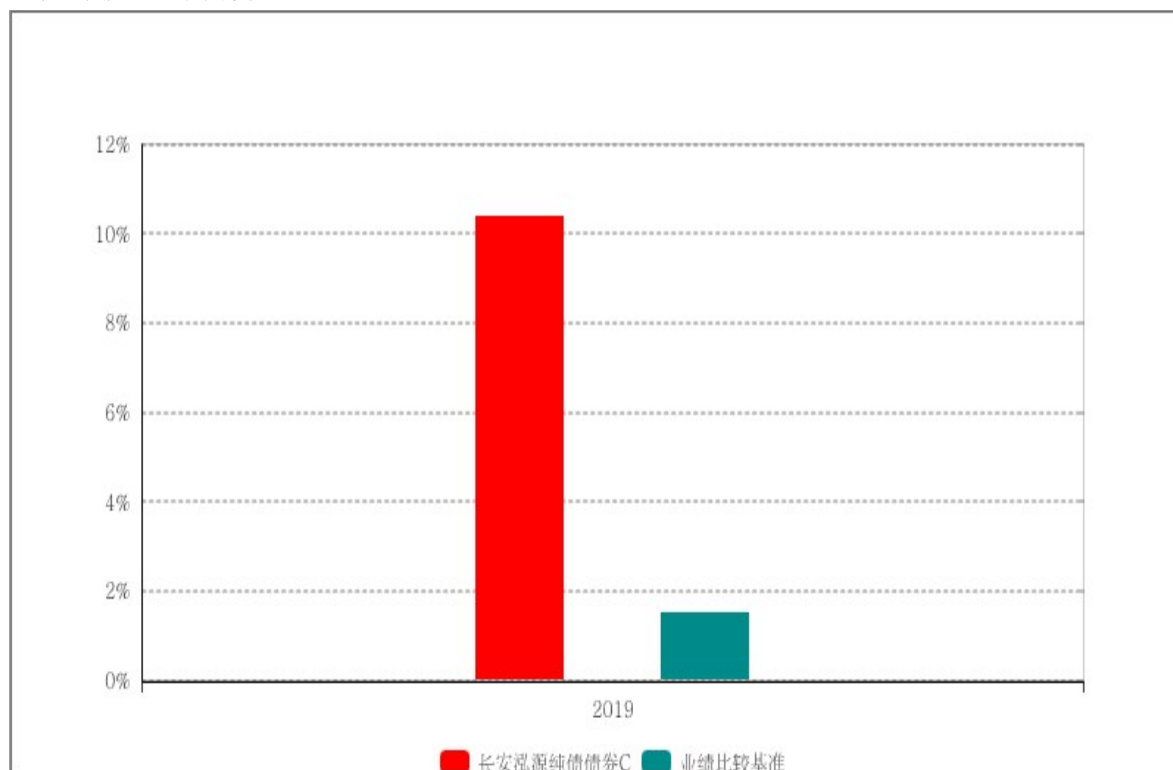
1、本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。本报告期自 2019 年 5 月 10 日至 12 月 31 日止。截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

### 3.2.3 自基金转型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



本基金合同生效日为 2019 年 5 月 10 日，合同生效日当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



本基金合同生效日为 2019 年 5 月 10 日，合同生效日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

本基金的合同生效日为2019年5月10日，本基金在本期间未进行过利润分配。

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

### 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	报告期(2019年01月01日-2019年05月09日)		2018年		2017年07月27日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C
本期已实现收益	169,905.85	686,655.78	3,177,358.11	12,657,909.23	1,074,897.03	11,946,083.13
本期利润	309,109.89	2,270,676.67	-2,039,518.09	-4,143,380.86	2,202,074.34	31,113,847.18
加权平均基金份额本期利润	0.1353	0.1666	-0.1849	-0.0849	0.1704	0.1806
本期加权平均净值利润率	13.06%	16.26%	-16.28%	-7.34%	15.69%	16.75%
本期基金份额净值增长率	6.64%	7.34%	-18.38%	-18.10%	17.38%	17.26%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2019年05月09日)		2018年末		2017年末	
期末可供分配利润	20,334.64	32,940.96	-126,073.04	-771,484.84	1,096,302.99	9,637,192.95
期末可供分配基金份额	0.0216	0.0309	-0.0420	-0.0396	0.0810	0.0799

利润						
期末基金资产净值	959,841.02	1,100,539.79	2,875,010.40	18,720,863.89	15,877,957.72	141,373,287.00
期末基金份额净值	1.0216	1.0309	0.9580	0.9604	1.1738	1.1726
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2019年05月09日)		2018年末		2017年末	
基金份额累计净值增长率	2.16%	3.09%	-4.20%	-3.96%	17.38%	17.26%

- 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。
- 3、对期末可供分配利润，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。
- 4、本报告期自2019年1月1日至5月9日止。

### 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

长安鑫恒回报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 (2019年04月01日-2019年05月09日)	-7.48%	1.37%	-4.44%	1.04%	-3.04%	0.33%
过去六个月 (2019年01月01日-2019年05月09日)	6.64%	1.11%	11.55%	0.98%	-4.91%	0.13%

过去一年(2018年07月01日-2019年05月09日)	-9.16%	1.02%	3.12%	0.93%	-12.28%	0.09%
自基金合同生效起至今(2017年07月27日-2019年05月09日)	2.16%	1.09%	0.42%	0.77%	1.74%	0.32%

本基金转型前业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%  
长安鑫恒回报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(2019年04月01日-2019年05月09日)	-7.52%	1.36%	-4.44%	1.04%	-3.08%	0.32%
过去六个月(2019年01月01日-2019年05月09日)	7.34%	1.11%	11.55%	0.98%	-4.21%	0.13%
过去一年(2018年07月01日-2019年05月09日)	-8.12%	1.02%	3.12%	0.93%	-11.24%	0.09%
自基金合同生效起至今(2017年07月27日-2019年05月09日)	3.09%	1.09%	0.42%	0.77%	2.67%	0.32%

本基金转型前业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%

### 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

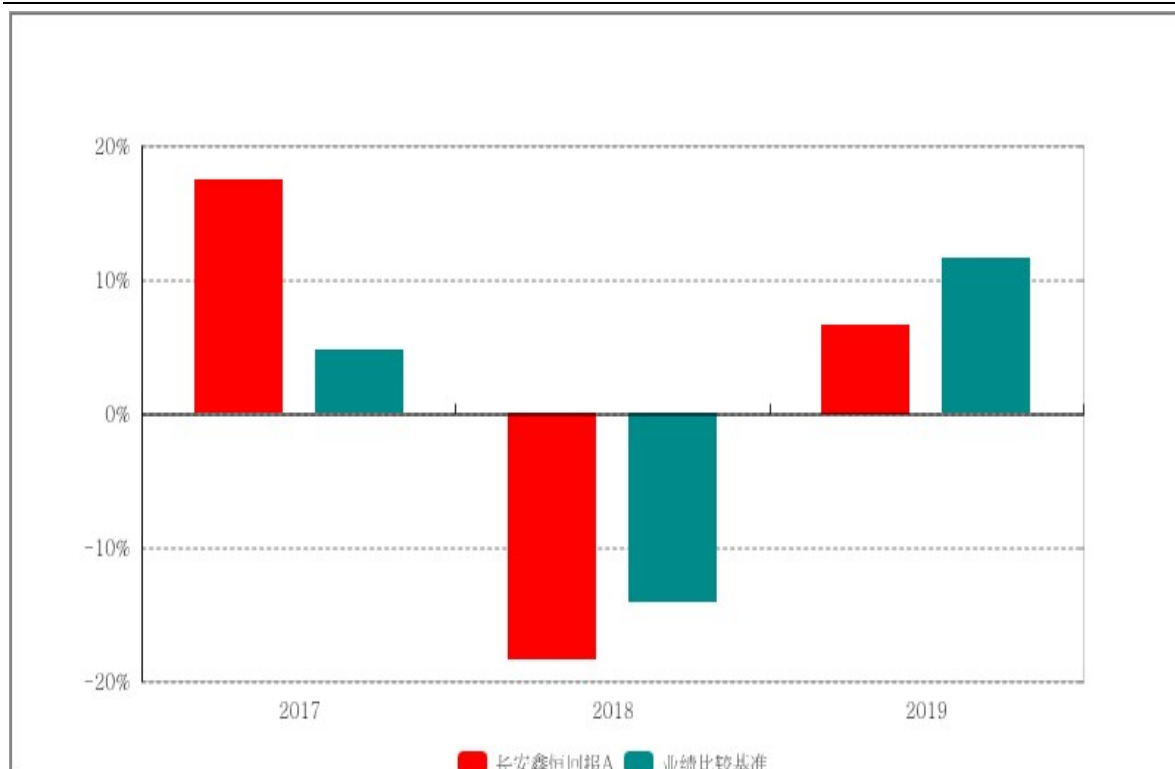


自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金，上图报告期间的结束日为 2019 年 5 月 9 日。



自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。本基金从 2019 年 5 月 10 日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金，上图报告期间的结束日为 2019 年 5 月 9 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



本基金合同生效日为 2017 年 7 月 27 日，合同生效日当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



本基金合同生效日为 2017 年 7 月 27 日，合同生效日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

本基金合同生效日为2017年7月27日，本基金本报告期自2019年1月1日至5月9日及2017年度和2018年度均未进行利润分配。

## § 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

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2019年12月31日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安泓源纯债债券型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金等19只证券投资基金。

#### 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		
徐小勇	本基金的基金经理	2019-05-10	-	25年	中国人民大学工商管理硕士。曾就职于建设银行总行信托投资公司、中国信达信托投资公司、中国银河证券有限责任公司，曾任银河基金管理有限公司

					研究员、基金经理，华泰证券（上海）资产管理有限公司权益部负责人等职，现任长安基金管理有限公司总经理助理、投资总监、基金经理。
孟楠	本基金的基金经理	2019-07-08	-	6年	曾任东证融汇证券资产管理有限公司（原东北证券股份有限公司上海分公司）投研助理、投资经理助理及投资主办等职。现任长安基金管理有限公司基金投资部基金经理。

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

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《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。



### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

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《长安基金管理有限公司公平交易制度》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。

## 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

2019年5月本基金召开了持有人大会通过基金转型有关事项的议案，将产品转型为纯债型基金。

报告期内，对债市来说，2019年既是收获的一年但也充满纠结。一季度债市窄幅震荡，但由于国内外市场对货币政策宽松预期的反复以及4月看到的一季度及经济数据好于预期，4月市场风险偏好提升，债券收益率大幅上涨。随后在5-8月，经济表现实际弱于预期，外加包商事件带来的流动性分层问题使得央行加大资金投放力度，货币政策表现宽松，而全球经济共振下行带动多国货币宽松政策进程加快，使得这段时期成为2019年债券市场表现最佳的阶段，出现了全年的收益率低点。而进入9月后一直到年末债券市场整体都呈震荡走势，主要原因有以下几点：一是外部环境的不确定性减弱，中美达成了贸易谈判第一阶段，风险偏好抬升利空债市；二是猪价推动CPI上行高位，也对债市情绪影响偏空；三是经济基本面趋于平稳，外部环境改善带动PMI复苏，四季度重回荣枯线以上，宽信用的效果渐显，地产产业链的韧性超预期带动了大宗价格反弹；四是央行在10月末未做TMLF且LPR利率维持不变，货币政策宽松的预期在逐步降温。

报告期内本基金进行了持仓的配置和优化，采取利率债+中高等级信用债+短久期高收益信用债+高收益逆回购策略，在获取稳定票息的基础上博取超额收益，全年整体收益基本达到预期效果，为投资者取得了较好的收益，后期还将根据市场情绪继续调整优化配置结构。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年5月9日，长安鑫恒回报A基金份额净值为1.0216元；自2019年1月1日至2019年5月9日本基金份额净值增长率为6.64%，同期业绩比较基准收益率为11.55%。

截至2019年5月9日，长安鑫恒回报C基金份额净值为1.0309元；自2019年1月1日至2019年5月9日本基金份额净值增长率为7.34%，同期业绩比较基准收益率为11.55%。

截至2019年12月31日，长安泓源纯债债券A基金份额净值为1.1283元；自2019年5月10日至2019年12月31日本基金份额净值增长率为10.44%，同期业绩比较基准收益率为1.50%。

截至2019年12月31日，长安泓源纯债债券C基金份额净值为1.1378元；自2019年5月10日至2019年12月31日本基金份额净值增长率为10.37%，同期业绩比较基准收益率为1.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年开年有些艰难，新冠疫情的突发状况对本年经济的增长带来了较大的冲击。短期来看，本次疫情将从供需两端都对国内的宏观经济产生较大的冲击，海外疫情蔓延势头渐显也会加重外需的回落；从中长期看，国内经济原就处于增长下行期，结构性问题突出，虽然疫情过后消费需求有望回补，但延迟复工对经济的冲击难以完全对冲，整体来看宏观经济增长的压力将加剧，挑战也更为严峻。从政策面上看，疫情发生以来财政积极应对，通过减税降费、财政补贴和财政贴息政策缓解疫情期间的资金压力，今年是立足十三五规划、全面建成小康社会的收官之年，后续的财政政策也有进一步发力的可能性，但以减税为主的财政政策对财政收入端造成的压力也会削弱财政支出空间和托底经济的能力，使得货币政策宽松就变得必不可少。而自疫情发生以来，货币政策快速响应，降息应对经济冲击，设立专项再贷款以稳定重点企业融资需求，充分显示了央行稳定市场预期、提振市场信心的决心，往后看，尽管短期的积极货币政策由疫情出发，但在降成本的长期政策目标下，货币政策宽松空间犹存，这一环境也有利于债券市场。同时在策略上我们将继续重点关注短久期高收益信用债、中高评级信用债及长久期利率债的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券（除固定收益品种外），采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期审计报告为标准无保留意见审计报告。

#### 4.10 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

本基金从2019年2月12日至2019年7月29日连续125个工作日出现基金资产净值低于五千万情形，未出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当的措施。

### § 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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-长安基金管理有限公司 2019年1月1日至2019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,长安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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，长安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本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告(转型后)

### 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	毕马威华振审字第2000963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	长安泓源纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的长安泓源纯债债券型证券投资基金（以下简称“长安泓源纯债债券”）财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表、自2019年5月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长安泓源纯债债券2019年12月31日的财务状况以及自2019年5月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告

	<p>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，我们独立于长安泓源纯债债券，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	<p>长安泓源纯债债券管理人长安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括长安泓源纯债债券2019年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，基金管理人管理层负责评估长安泓源纯债债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非长安泓源纯债债券计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	<p>基金管理人治理层负责监督长安泓源纯债债券的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价基金管理人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>(4) 对基金管理人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，就可能导致对长安产业精选混合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报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长安产业精选混合不</p>

	<p>能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	黄小熠	蔡晓晓
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼	
审计报告日期	2020-03-30	

## § 6 审计报告(转型前)

### 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	毕马威华振审字第2000952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	长安鑫恒回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的长安鑫恒回报混合型证券投资基金（以下简称“长安鑫恒混合”）财务报表，包括2019年5月9日（基金合同失效前日）的资产负债表、2019年1月1日至2019年5月9日（基金合同失效前日）的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证</p>

	<p>券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长安鑫恒混合2019年5月9日（基金合同失效前日）的财务状况以及2019年1月1日至2019年5月9日（基金合同失效前日）经营成果及基金净值变动情况。</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（以下简称“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，我们独立于长安鑫恒混合，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	<p>长安鑫恒混合管理人长安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括长安泓源纯债债券型证券投资基金（转型后基金）2019年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并</p>



	<p>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，基金管理人管理层负责评估长安鑫恒混合的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非长安鑫恒混合计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长安鑫恒混合的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>（1）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>（2）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>（3）评价基金管理人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>（4）对基金管理人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，就可能对长安鑫恒混合持续经营能力产生</p>

	<p>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报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长安鑫恒混合不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	黄小熠	蔡晓晓
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼	
审计报告日期	2020-03-30	

## § 7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表

会计主体：长安泓源纯债债券型证券投资基金

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	15,802,237.02
结算备付金		326,069.80
存出保证金		17,902.11
交易性金融资产	7.4.7.2	966,451,435.20

其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		966,451,435.20
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	128,881,473.33
应收证券清算款		25,004,239.73
应收利息	7.4.7.5	11,002,002.90
应收股利		-
应收申购款		8,083,584.24
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,155,568,944.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	本期末 2019年12月31日
<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		31,951,805.77
应付管理人报酬		465,628.74
应付托管费		93,125.77
应付销售服务费		121,312.86
应付交易费用	7.4.7.7	15,974.21
应交税费		55,927.52
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	7.4.7.8	34,010.98
负债合计		32,737,785.85
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	987,983,504.27
未分配利润	7.4.7.10	134,847,654.21
所有者权益合计		1,122,831,158.48
负债和所有者权益总计		1,155,568,944.33

报告截止日2019年12月31日，长安泓源纯债债券A净值1.1283元，基金份额总额134,850,604.62份，长安泓源纯债债券C净值1.1378元，基金份额总额853,132,899.65份，总份额合计987,983,504.27份。

## 7.2 利润表

会计主体：长安泓源纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年05月10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05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		16,729,638.36
1. 利息收入		10,217,101.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	255,178.51
债券利息收入		5,504,496.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		4,457,425.87
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-270,374.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-270,374.36
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-

股利收益	7.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	6,668,512.00
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	114,399.56
<b>减：二、费用</b>		1,815,543.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,192,638.71
2. 托管费	7.4.10.2.2	238,527.76
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	308,741.32
4. 交易费用	7.4.7.20	11,980.66
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		14,155.15
7. 其他费用	7.4.7.21	49,499.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		14,914,095.17
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		14,914,095.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安泓源纯债债券型证券投资基金

本报告期：2019年05月10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05月10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)	2,007,105.21	53,275.60	2,060,380.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,914,095.17	14,914,095.17

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）	985,976,399.06	119,880,283.44	1,105,856,682.50
其中：1. 基金申购款	1,371,348,228.15	168,446,029.16	1,539,794,257.31
2. 基金赎回款	-385,371,829.09	-48,565,745.72	-433,937,574.81
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）	987,983,504.27	134,847,654.21	1,122,831,158.48

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：

袁丹旭

吴纓

欧鹏

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

长安泓源纯债债券型证券投资基金（原“长安鑫恒回报混合型证券投资基金”）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准长安鑫恒回报混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2017]984号文）的批准，由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2017年7月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为207,205,208.43份基金份额。根据中国证监会《关于准予长安鑫恒回报混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019]560号文）的批准，经基金份额持有人大会2019年5月8日表决通过《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年5月10日起，长安鑫恒回报混合型证券投资基金正式转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金，《长安泓源纯债债

券型证券投资基金基金合同》和《长安泓源纯债债券型证券投资基金托管协议》生效，《长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同》和《长安鑫恒回报混合型证券投资基金托管协议》自同日起失效。长安泓源纯债债券型证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定，基金规模为2,007,105.21份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司，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”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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相关规定）。基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年12月31日的财务状况、自2019年5月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2019年5月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前持有的股票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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价



金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 一本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 一本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金

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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费、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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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》，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。

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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》、财税[2017]2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，该基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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	15,802,237.02

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	-
合计	15,802,237.02

#### 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	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	223,135,116.31	225,950,335.20
	银行间市场	736,647,806.89	740,501,100.00
	合计	959,782,923.20	966,451,435.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	959,782,923.20	966,451,435.20	6,668,512.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有任何衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	128,881,473.33	-

合计	128,881,473.33	-
----	----------------	---

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末无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	10,072.15
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	170.28
应收债券利息	9,902,873.19
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,086,359.54
应收申购款利息	2,527.74
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	11,002,002.90

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	15,974.21
合计	15,974.21

#### 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	10.98
预提费用-审计费	25,000.00
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	34,010.98

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 长安泓源纯债债券A

金额单位：人民币元

项目 (长安泓源纯债债券A)	本期2019年05月10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	939,506.38	939,506.38
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整 (若有)	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	939,506.38	939,506.38
本期申购	176,850,997.05	176,850,997.05
本期赎回（以“-”号填列）	-42,939,898.81	-42,939,898.81
本期末	134,850,604.62	134,850,604.62

##### 7.4.7.9.2 长安泓源纯债债券C

金额单位：人民币元

项目 (长安泓源纯债债券C)	本期2019年05月10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	1,067,598.83	1,067,598.83



-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整 (若有)	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	1,067,598.83	1,067,598.83
本期申购	1,194,497,231.10	1,194,497,231.10
本期赎回(以“-”号填列)	-342,431,930.28	-342,431,930.28
本期末	853,132,899.65	853,132,899.65

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 长安泓源纯债债券A

单位：人民币元

项目 (长安泓源纯债债券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	406,068.88	-385,734.24	20,334.64
本期利润	1,176,434.46	1,009,714.35	2,186,148.81
本期基金份额交易产生的变动数	60,080,918.09	-44,983,433.98	15,097,484.11
其中：基金申购款	79,439,806.90	-59,361,764.06	20,078,042.84
基金赎回款	-19,358,888.81	14,378,330.08	-4,980,558.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,663,421.43	-44,359,453.87	17,303,967.56

##### 7.4.7.10.2 长安泓源纯债债券C

单位：人民币元

项目 (长安泓源纯债债券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	471,509.29	-438,568.33	32,940.96
本期利润	7,069,148.71	5,658,797.65	12,727,946.36
本期基金份额交易产生的变动数	390,220,077.52	-285,437,278.19	104,782,799.33

其中：基金申购款	547,955,901.47	-399,587,915.15	148,367,986.32
基金赎回款	-157,735,823.95	114,150,636.96	-43,585,186.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	397,760,735.52	-280,217,048.87	117,543,686.65

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	251,417.59
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	3,540.53
其他	220.39
合计	255,178.51

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金在本期间无基金投资收益。

#### 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05月10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	-270,374.36
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	-270,374.36

#### 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05月10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	165,877,305.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	162,934,261.48
减：应收利息总额	3,213,418.26
买卖债券差价收入	-270,374.36

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本期间无债券投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期间无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金在本期间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

本基金在本期间无贵金属投资收益。

#### 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

本基金在本期间无衍生工具收益买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本期间无衍生工具收益其他收益投资。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金在本期间无股利收益。

#### 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05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	6,668,512.00
——股票投资	-
——债券投资	6,668,512.00
——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	6,668,512.00

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	111,694.64
转换费收入	2,704.92

合计	114,399.56
----	------------

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	1,143.91
银行间市场交易费用	10,836.75
合计	11,980.66

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年05月10日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	17,238.59
信息披露费	-
汇划手续费	17,141.00
帐户维护费	15,000.00
其他费用	120.00
合计	49,499.59

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长安国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
上海恒嘉美联发展有限公司	基金管理人的股东
五星控股集团有限公司	基金管理人的股东
兵器装备集团财务有限责任公司	基金管理人的股东
长安财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

本基金在本期间没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本期间没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本期间没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本期间没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本期间没有应支付关联方的佣金。

##### 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05月10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	1,192,638.71
其中：支付销售机构的客户维护费	501,037.05

1、支付基金管理人长安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%/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

	本期 2019年05月10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	238,527.76

1、支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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05月10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		
	长安泓源纯债债券A	长安泓源纯债债券C	合计
长安基金管理有限公司	0.00	821.62	821.62
合计	0.00	821.62	821.62

长安泓源纯债债券A不计算基金销售服务费。长安泓源纯债债券C支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：

长安泓源纯债债券C日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.15%/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

本基金在本期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本基金的管理人在本期间未持有过本基金。

##### 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在本年度与上年度均未持有过本基金。

#### 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05月10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
中国农业银行股份有限公司	15,802,237.02	251,417.59

本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2019年12月31日的相关余额为人民币326,069.80元。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金在本期间未进行过利润分配。

#### 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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2019年12月31日，本基金未有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2019年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

于2019年12月31日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间市场债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2019年12月31日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

#### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日
A-1	310,375,500.00
A-1以下	-
未评级	457,342,700.00
合计	767,718,200.00

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。

##### 7.4.13.2.2 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	53,398,468.00
AAA以下	118,087,138.60
未评级	27,247,628.60

合计	198,733,235.20
----	----------------

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006] 95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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

报告期内，本基金主要投资于在交易所和银行间市场正常交易的债券。基金组合资产中的主要投资标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流

动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估和测算，保证本基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口：

##### 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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,802,237.02	-	-	-	15,802,237.02
结算备付金	326,069.80	-	-	-	326,069.80
存出保证金	17,902.11	-	-	-	17,902.11
交易性金融资产	809,673,440.10	149,015,375.10	7,762,620.00	-	966,451,435.20
买入返售金融资产	128,881,473.33	-	-	-	128,881,473.33

应收证 券清算 款	-	-	-	25,004,239.73	25,004,239.73
应收利 息	-	-	-	11,002,002.90	11,002,002.90
应收申 购款	-	-	-	8,083,584.24	8,083,584.24
资产总 计	954,701,122.36	149,015,375.10	7,762,620.00	44,089,826.87	1,155,568,944.33
负 债					
应付赎 回款	-	-	-	31,951,805.77	31,951,805.77
应付管 理人报 酬	-	-	-	465,628.74	465,628.74
应付托 管费	-	-	-	93,125.77	93,125.77
应付销 售服务 费	-	-	-	121,312.86	121,312.86
应付交 易费用	-	-	-	15,974.21	15,974.21
应交税 费	-	-	-	55,927.52	55,927.52
其他负 债	-	-	-	34,010.98	34,010.98
负债总 计	-	-	-	32,737,785.85	32,737,785.85
利率敏 感度缺 口	954,701,122.36	149,015,375.10	7,762,620.00	11,352,041.02	1,122,831,158.48

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	1,348,521.86
	利率上升25个基点	-1,344,253.39

假定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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金本期末未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

##### 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	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	966,451,435.20	86.07
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	966,451,435.20	86.07

#### 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) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 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的金融工具中无属于第一层级的余额，第二层级的余额为966,451,435.20元，无属于第三层级的余额。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (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。

## § 7 年度财务报表(转型前)

### 7.1 资产负债表

会计主体：长安鑫恒回报混合型证券投资基金

报告截止日：2019年05月09日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年05月09日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	675,020.84	10,210,979.81
结算备付金		59,142.79	7,993.80
存出保证金		6,151.43	11,347.77
交易性金融资产	7.4.7.2	-	11,545,616.42
其中：股票投资		-	11,545,616.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.2	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	8,600,000.00
应收证券清算款		1,388,202.93	-
应收利息	7.4.7.4	5,617.88	3,296.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,834.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,134,135.87	30,381,068.99
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年05月09日</b>	<b>上年度末 2018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	7.4.7.2	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	8,600,000.00



应付赎回款		4,459.92	14,093.54
应付管理人报酬		533.98	19,330.84
应付托管费		53.39	1,933.09
应付销售服务费		42.89	2,442.02
应付交易费用	7.4.7.6	25,898.56	7,395.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	42,766.32	140,000.00
负债合计		73,755.06	8,785,194.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.8	2,007,105.21	22,493,432.17
未分配利润	7.4.7.9	53,275.60	-897,557.88
所有者权益合计		2,060,380.81	21,595,874.29
负债和所有者权益总计		2,134,135.87	30,381,068.99

报告截止日2019年5月9日（基金合同失效前日），长安鑫恒回报混合A类净值1.0216元，基金份额总额939,506.38份，长安鑫恒回报混合C类净值1.0309元，基金份额总额1,067,598.83份，总份额合计2,007,105.21份。

## 7.2 利润表

会计主体：长安鑫恒回报混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年05月09日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日
一、收入		2,751,541.91	-4,870,010.23
1. 利息收入		49,469.96	103,801.58
其中：存款利息收入	7.4.7.10	22,166.86	98,383.14
债券利息收入		-	232.60

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,303.10	5,185.84
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		835,564.47	16,902,505.09
其中：股票投资收益	7.4.7.11	829,129.47	16,160,559.15
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	118,327.45
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,435.00	623,618.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,723,224.93	-22,018,166.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	143,282.55	141,849.39
<b>减：二、费用</b>		171,755.35	1,312,888.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	62,860.40	698,427.57
2. 托管费	7.4.10.2. 2	6,286.00	69,842.76
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	8,182.63	85,897.56
4. 交易费用	7.4.7.19	40,468.75	314,217.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-

6. 税金及附加		-	0.77
7. 其他费用	7.4.7.20	53,957.57	144,502.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,579,786.56	-6,182,898.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,579,786.56	-6,182,898.95

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安鑫恒回报混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年05月09日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年05月09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）	22,493,432.17	-897,557.88	21,595,874.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,579,786.56	2,579,786.56
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）	-20,486,326.96	-1,628,953.08	-22,115,280.04
其中：1. 基金申购款	28,871,447.08	-251,051.55	28,620,395.53
2. 基金赎回款	-49,357,774.04	-1,377,901.53	-50,735,675.57
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）	2,007,105.21	53,275.60	2,060,380.81
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018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）	134,087,509.65	23,163,735.07	157,251,244.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,182,898.95	-6,182,898.95
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）	-111,594,077.48	-17,878,394.00	-129,472,471.48
其中：1. 基金申购款	49,506,860.45	3,500,766.97	53,007,627.42
2. 基金赎回款	-161,100,937.93	-21,379,160.97	-182,480,098.90
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）	22,493,432.17	-897,557.88	21,595,874.29

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：

袁丹旭

吴缨

欧鹏

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

长安鑫恒回报混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予长安鑫恒回报混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]984号文)注册,由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年7月27日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集规模为207,205,208.43份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司,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”)。

本基金于2017年7月12日至2017年7月24日募集,募集期间净认购资金人民币207,185,978.59元,认购资金在募集期间产生的利息人民币19,229.84元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计207,205,208.43份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具了毕马威华振验字第1700454号验资报告。

根据基金管理人于2019年5月9日发布的《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,基金份额持有人大会于2019年5月8日表决通过了《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自2019年5月10日起,长安鑫恒回报混合型证券投资基金正式转型并更名为长安泓源纯债债券型证券投资基金。自同日起,《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》生效。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

根据中国证监会《关于准予长安鑫恒回报混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2019]560号文)的批准,经基金份额持有人大会2019年5月8日表决通过《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,本基金于2019年5月10日实施转型,基金名称由“长安鑫恒回报混合型证券投资基金”变更为“长安泓源纯债债券型证券投资基金”基金类别由混合型基金转型为债券型证券投资基金,存续期限不定,因此本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反

映了本基金2019年5月9日（基金合同失效前日）以及上一年度的财务状况、2019年1月1日至2019年5月9日（基金合同失效前日）的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2019年1月1日至2019年5月9日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前持有的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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。



公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费、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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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》，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。

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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》、财税〔2017〕2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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05月09日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	675,020.84	10,210,979.81
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	-	-
合计	675,020.84	10,210,979.81

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年05月09日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	13,268,841.35	11,545,616.42	-1,723,224.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		13,268,841.35	11,545,616.42	-1,723,224.93

#### 7.4.7.2 衍生金融资产/负债

本基金于本期间及上年末均未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3 买入返售金融资产

##### 7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

项目	本期末2019年05月09日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	8,600,000.00	-

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期间及上年末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年05月09日	上年度末 2018年12月31日

应收活期存款利息	3,202.92	2,249.65
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	90.73	3.96
应收债券利息	-	-
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	2,307.35	1,037.00
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	16.88	5.61
合计	5,617.88	3,296.22

其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金于本期间及上年末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年05月09日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	25,898.56	7,395.21
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	25,898.56	7,395.21

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年05月09日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4.91	-
预提费用-审计费	7,761.41	60,000.00
其他应付	35,000.00	-

预提费用-信息披露费	-	80,000.00
合计	42,766.32	140,000.00

其他应付为持有人大会律师费3.5万元。

#### 7.4.7.8 实收基金

##### 7.4.7.8.1 长安鑫恒回报A

金额单位：人民币元

项目 (长安鑫恒回报A)	本期2019年01月01日至2019年05月09日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,001,083.44	3,001,083.44
本期申购	116,642.96	116,642.96
本期赎回(以“-”号填列)	-2,178,220.02	-2,178,220.02
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	939,506.38	939,506.38

##### 7.4.7.8.2 长安鑫恒回报C

金额单位：人民币元

项目 (长安鑫恒回报C)	本期2019年01月01日至2019年05月09日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,492,348.73	19,492,348.73
本期申购	28,754,804.12	28,754,804.12
本期赎回(以“-”号填列)	-47,179,554.02	-47,179,554.02
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,067,598.83	1,067,598.83

1、申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金于2018年8月2日至2018年8月29日募集，募集期间净认购资金人民币

334,668,678.51元，认购资金在募集期间产生的利息人民币79,299.93元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计334,747,978.44份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资，并出具了毕马威华振验字第1800068号验资报告。

#### 7.4.7.9 未分配利润

##### 7.4.7.9.1 长安鑫恒回报A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	924,452.60	-1,050,525.64	-126,073.04
本期利润	169,905.85	139,204.04	309,109.89
本期基金份额交易产生的变动数	-688,289.57	525,587.36	-162,702.21
其中：基金申购款	35,015.09	-28,967.96	6,047.13
基金赎回款	-723,304.66	554,555.32	-168,749.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	406,068.88	-385,734.24	20,334.64

##### 7.4.7.9.2 长安鑫恒回报C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,037,023.04	-6,808,507.88	-771,484.84
本期利润	686,655.78	1,584,020.89	2,270,676.67
本期基金份额交易产生的变动数	-6,252,169.53	4,785,918.66	-1,466,250.87
其中：基金申购款	8,882,565.46	-9,139,664.14	-257,098.68
基金赎回款	-15,134,734.99	13,925,582.80	-1,209,152.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	471,509.29	-438,568.33	32,940.96

##### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日	上年度可比期间2018年01月



	至2019年05月09日	01日至2018年12月31日
活期存款利息收入	20,461.16	95,871.58
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	381.41	1,482.66
其他	1,324.29	1,028.90
合计	22,166.86	98,383.14

其他包括保证金利息收入和应收申购款利息收入。

#### 7.4.7.11 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01月01日至2019年 05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	19,717,323.53	160,967,707.84
减：卖出股票成本总额	18,888,194.06	144,807,148.69
买卖股票差价收入	829,129.47	16,160,559.15

#### 7.4.7.12 基金投资收益

本基金在本期间及上年度均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13. \$q\_ 债券投资收益——买卖债券差价收入XH 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01月01日至2019年05月 09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	623,675.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期	-	505,000.00

兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	-	347.55
买卖债券差价收入	-	118,327.45

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本期间及上年度均无债券投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本期间及上年度均无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金在本期间及上年度均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本期间及上年度均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本期间及上年度均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本期间及上年度均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本期间及上年度均无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本期间及上年度均无衍生工具收益其他收益投资。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年
----	-------------------------	------------------------------

	05月09日	12月31日
股票投资产生的股利收益	6,435.00	623,618.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,435.00	623,618.49

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年05月09日	2018年01月01日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	1,723,224.93	-22,018,166.29
——股票投资	1,723,224.93	-21,986,957.29
——债券投资	-	-31,209.00
——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	1,723,224.93	-22,018,166.29

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年05月09日	2018年01月01日至2018年12月31日
基金赎回费收入	143,282.55	141,090.89
转换费收入	-	758.50

合计	143,282.55	141,849.39
----	------------	------------

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
交易所市场交易费用	40,468.75	314,217.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	40,468.75	314,217.81

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 12月31日
审计费用	7,761.41	60,000.00
信息披露费	-	80,000.00
汇划手续费	1,196.16	4,502.25
其他费用	45,000.00	-
合计	53,957.57	144,502.25

其他费用中3.5万为持有人大会律师费，1万为持有人大会公证费。

### 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

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据中国证监会《关于准予长安鑫恒回报混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019]560号文）的批准，经基金份额持有人大会2019年5月8日表决通过《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金于2019年5月10日实施转型，基金名称由“长安鑫恒回报混合型证券投资基金”变更为“长安泓源纯债债券型证券投资基金”基金类别由混合型基金转型为债券型证券投资基金，存续期限不定。

## 7.4.9 关联方关系

### 7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长安国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
上海恒嘉美联发展有限公司	基金管理人的股东
五星控股集团有限公司	基金管理人的股东
兵器装备集团财务有限责任	基金管理人的股东
长安财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。并以一般交易价格为定价基础。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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

本基金在本期间与上年度均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本期间及上年度均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本期间与上年度均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本期间与上年度均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本期间及上年度均没有应支付关联方的佣金。

#### 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01月01日至201 9年05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	62,860.40	698,427.57
其中：支付销售机构的客户维护费	4,049.82	19,685.05

1、支付基金管理人长安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/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01月01日至2019 年05月09日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,286.00	69,842.76

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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	本期 2019年01月01日（基金合同生效日）至2019年05月09日

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C	合计
长安基金管理有限公司	0.00	7,399.19	7,399.19
合计	0.00	7,399.19	7,399.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C	合计
长安基金管理有限公司	0.00	81,494.96	81,494.96
合计	0.00	81,494.96	81,494.96

本基金A类不计算基金销售服务费。本基金C类支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.15% /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

本基金在本期间及上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末没有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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01月01日至2019年05月09日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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 银行股份 有限公司	675,020.84	20,461.16	10,210,979.81	95,871.58
----------------------	------------	-----------	---------------	-----------

本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2019年5月9日（基金合同失效前日）的相关余额为人民币59,142.79元。（2018年12月31日：人民币7,993.80元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项说明。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金在本报告期末进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2019年05月09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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2019年5月9日（基金合同失效前日），本基金未有因认购新发或增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2019年5月9日（基金合同失效前日），本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

于2019年5月9日（基金合同失效前日），本基金未持有银行间债券正回购。



#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2019年5月9日（基金合同失效前日），本基金未持有交易所债券正回购。

#### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。本基金于本报告期末未持有短期信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006] 95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级（含）以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。本基金于本报告期末未持有长期信用评级的债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约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

报告期内，本基金主要投资于在国内依法公开发行的上市的股票。基金组合资产中的主要投资标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动

性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估和测算，保证该基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年05月09日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	675,020.84	-	-	-	675,020.84
结算备付金	59,142.79	-	-	-	59,142.79
存出保证金	6,151.43	-	-	-	6,151.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	1,388,202.93	1,388,202.93

长安泓源纯债债券型证券投资基金（原长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型）2019 年年度报告

款					
应收利息	-	-	-	5,617.88	5,617.88
资产总计	740,315.06	-	-	1,393,820.81	2,134,135.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,459.92	4,459.92
应付管理人报酬	-	-	-	533.98	533.98
应付托管费	-	-	-	53.39	53.39
应付销售服务费	-	-	-	42.89	42.89
应付交易费用	-	-	-	25,898.56	25,898.56
其他负债	-	-	-	42,766.32	42,766.32
负债总计	-	-	-	73,755.06	73,755.06
利率敏感度缺口	740,315.06	-	-	1,320,065.75	2,060,380.81
上年度末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,210,979.81	-	-	-	10,210,979.81
结算备付金	7,993.80	-	-	-	7,993.80
存出保证金	11,347.77	-	-	-	11,347.77
交易性金融资产	-	-	-	11,545,616.42	11,545,616.42

买入返售金融资产	8,600,000.00	-	-	-	8,600,000.00
应收利息	-	-	-	3,296.22	3,296.22
应收申购款	-	-	-	1,834.97	1,834.97
资产总计	18,830,321.38	-	-	11,550,747.61	30,381,068.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,600,000.00	8,600,000.00
应付赎回款	-	-	-	14,093.54	14,093.54
应付管理人报酬	-	-	-	19,330.84	19,330.84
应付托管费	-	-	-	1,933.09	1,933.09
应付销售服务费	-	-	-	2,442.02	2,442.02
应付交易费用	-	-	-	7,395.21	7,395.21
其他负债	-	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	-	8,785,194.70	8,785,194.70
利率敏感度缺口	18,830,321.38	-	-	2,765,552.91	21,595,874.29

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金未持有受重大利率风险影响的投资品种。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金本期末未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

##### 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05月09日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	11,545,616.42	53.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	-	-	11,545,616.42	53.46
----	---	---	---------------	-------

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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05月09日	上年度末 2018年12月31日
	沪深300指数上升5%	-	619,505.13
	沪深300指数下降5%	-	-619,505.13

本基金以沪深300指数作为其他价格波动风险的敏感度分析基准。

#### 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) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事件停牌、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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

本基金在转型前一日2019年5月9日，无属于第一层级，第二层级和第三层级的余额。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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(转型后)

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	966,451,435.20	83.63
	其中：债券	966,451,435.20	83.63
	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	128,881,473.33	11.15
	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	16,128,306.82	1.40
8	其他各项资产	44,107,728.98	3.82
9	合计	1,155,568,944.33	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末持有股票。

#### 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

本基金本报告期末持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末持有股票。

#### 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	20,012,000.00	1.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	284,830,328.60	25.37
	其中：政策性金融债	264,806,328.60	23.58
4	企业债券	151,379,606.60	13.48
5	企业短期融资券	490,123,500.00	43.65
6	中期票据	20,106,000.00	1.79
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	966,451,435.20	86.07

#### 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	190211	19国开11	900,000	90,126,000.00	8.03
2	011902767	19中电信SCP015	600,000	59,784,000.00	5.32

3	011902196	19电网SCP007	400,000	39,916,000.00	3.55
4	108602	国开1704	340,000	34,197,200.00	3.05
5	018007	国开1801	330,000	33,247,500.00	2.96

**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**

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

**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**

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情形。**

**8.12.2 本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	17,902.11
2	应收证券清算款	25,004,239.73
3	应收股利	-
4	应收利息	11,002,002.90
5	应收申购款	8,083,584.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,107,728.98

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.6 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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 投资组合报告（转型前）

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
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	734,163.63	34.40
8	其他各项资产	1,399,972.24	65.60
9	合计	2,134,135.87	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

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有港股股票。

## 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

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有股票。

## 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	300122	智飞生物	600,911.00	2.78
2	601997	贵阳银行	384,871.27	1.78
3	601398	工商银行	384,859.00	1.78
4	601128	常熟银行	384,755.00	1.78
5	002142	宁波银行	384,726.64	1.78
6	601166	兴业银行	384,714.00	1.78

7	601336	新华保险	384,510.00	1.78
8	601169	北京银行	384,076.00	1.78
9	601939	建设银行	383,980.00	1.78
10	000001	平安银行	383,923.80	1.78
11	601009	南京银行	383,526.00	1.78
12	002632	道明光学	366,051.00	1.70
13	000921	海信家电	240,424.00	1.11
14	600809	山西汾酒	220,165.00	1.02
15	000568	泸州老窖	218,390.00	1.01
16	603019	中科曙光	129,470.00	0.60

#### 8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603156	养元饮品	2,131,989.64	9.87
2	601939	建设银行	1,180,587.00	5.47
3	601318	中国平安	902,880.00	4.18
4	002299	圣农发展	766,695.00	3.55
5	002371	北方华创	725,403.00	3.36
6	300122	智飞生物	715,330.00	3.31
7	002281	光迅科技	616,912.00	2.86
8	600276	恒瑞医药	609,209.35	2.82
9	600498	烽火通信	589,270.00	2.73
10	601818	光大银行	551,091.00	2.55
11	600990	四创电子	550,171.00	2.55
12	600048	保利地产	545,187.00	2.52
13	600271	航天信息	544,894.00	2.52
14	601186	中国铁建	537,644.00	2.49
15	002304	洋河股份	517,848.00	2.40
16	603019	中科曙光	459,706.00	2.13

17	600760	中航沈飞	447,805.00	2.07
18	300498	温氏股份	423,158.00	1.96
19	601997	贵阳银行	393,620.00	1.82
20	601166	兴业银行	390,606.00	1.81

#### 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	5,619,352.71
卖出股票收入（成交）总额	19,717,323.53

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有债券。

#### 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

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有债券。

#### 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

本基金在转型前一日2019年5月9日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

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有贵金属。

#### 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

本基金在转型前一日2019年5月9日未持有权证。

#### 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

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

#### 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

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金本报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 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	6,151.43
2	应收证券清算款	1,388,202.93
3	应收股利	-
4	应收利息	5,617.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,399,972.24

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金在转型前一日2019年5月9日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

本基金在转型前一日2019年5月9日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

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的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(转型后)

### 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
长安泓源纯债债券A	4,983	27,062.13	72,784.21	0.05%	134,777,820.41	99.95%
长安泓源纯债债券C	24,780	34,428.28	9,944.38	0.00%	853,122,955.27	100.00%
合计	29,763	33,195.02	82,728.59	0.01%	987,900,775.68	99.99%

### 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	长安泓源纯债债券A	567,710.16	0.42%
	长安泓源纯债债券C	100,561.30	0.01%
	合计	668,271.46	0.07%

### 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	长安泓源纯债债券 A	0
	长安泓源纯债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长安泓源纯债债券 A	0
	长安泓源纯债债券 C	0
	合计	0

## § 9 基金份额持有人信息(转型前)

### 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
长安鑫恒回报A	413	2,274.83	0.00	0.00%	939,506.38	100.00%
长安鑫恒回报C	495	2,156.77	0.00	0.00%	1,067,598.83	100.00%
合计	908	2,210.47	0.00	0.00%	2,007,105.21	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长安鑫恒回报A	10,700.15	0.34%
	长安鑫恒回报C	10,700.08	0.36%
	合计	21,400.23	0.35%

### 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	长安鑫恒回报A	0~10
	长安鑫恒回报C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长安鑫恒回报A	0~10
	长安鑫恒回报C	0~10
	合计	0~10

### § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	长安泓源纯债债券A	长安泓源纯债债券C
基金合同生效日(2019年05月10日)基金份额总额	939,506.38	1,067,598.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	176,850,997.05	1,194,497,231.10
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	42,939,898.81	342,431,930.28
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	134,850,604.62	853,132,899.65

总申购份额包含红利再投资、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

### § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	长安鑫恒回报A	长安鑫恒回报C
基金合同生效日(2017年07月27日)基金份额总额	12,684,842.02	194,520,366.41
本报告期期初基金份额总额	3,001,083.44	19,492,348.73
本报告期基金总申购份额	116,642.96	28,754,804.12
减：本报告期基金总赎回份额	2,178,220.02	47,179,554.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	939,506.38	1,067,598.83

总申购份额包含红利再投资、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，同意本基金转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金，同意授权本基金管理人办理本次基金转型及《基金合同》修改的相关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定转型的具体时间和方式，根据现实有效的法律法规的规定和《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的说明》对《基金合同》进行必要的修改和补充，并相应更新托管协议、招募说明书，在转型实施日前制订有关基金转型实施前的申购赎回安排等事项的转型实施安排规则。

### 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

本报告期，基金管理人无重大人事变动。

2019年1月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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

本基金转型后，投资策略变更为以下：

#### 1、久期策略

久期策略主要指根据对经济、政策和市场的分析，确定债券组合的久期水平。

本基金将全面、深入研究影响利率变化的宏观因素，如经济增长率、通货膨胀、国际收支等的变化，进而判断经济政策的基调和走向，结合债券市场资金供给结构、流动性充裕情况以及投资人避险情绪等的变化，判断和预测未来利率的可能走势，确定并调整投资组合的久期水平。当预期市场利率水平下降时，提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期市场利率水平上升时，降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。

## 2、类属配置策略

类属配置策略即决定资金在不同类属债券间的配置。

本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析及对宏观经济发展的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构的资金情况，并根据不同类型债券的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好及流动性等因素，在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债券、利率债券等资产类别之间进行类属配置，确定具有最优风险收益特征的资产组合。

## 3、期限结构策略

期限结构策略指通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对不同期限的债券进行合理配置。本基金将分析同一类属债券的收益率曲线形态和期限结构变动，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。具体来看，可分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、哑铃策略及梯形策略。

## 4、信用债券策略

信用债券收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两方面影响，一是该信用债券对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债券本身的信用变化。基于上述两方面因素，本基金采用以下投资策略：

基于信用利差曲线变化的策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债券市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

基于信用债券信用变化的策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后的债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债券定价。影响信用债券信用风险的因素包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等。

## 5、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 6、回购套利策略

本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所”)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

### 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

报告期内无基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

## 转型后

报告期2019年05月10日（基金合同生效日） - 2019年12月31日

### 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	
广州证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 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；
- (4) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期没有新增券商的交易单元，无退租的券商交易单元。

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
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	324,406,661.62	100.00%	612,400,000.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

转型前

报告期2019年01月01日 - 2019年05月09日

## 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	
广州证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	25,336,676.24	100.00%	18,503.35	100.00%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 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；
- (4) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期没有新增券商的交易单元，无退租的券商交易单元。

### 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
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	61,300,000.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下基金在北京植信基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-01-11
2	长安鑫恒回报混合型证券投资基金2018年第四季度报告	证券时报	2019-01-19
3	关于旗下基金在东海证券股份有限公司开通定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-01-21
4	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证券时报	2019-02-26
5	关于旗下基金在广州证券股份有限公司开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-03-01



6	004897_长安鑫恒回报混合型证券投资基金2018年第四季度报告及摘要	证券时报	2019-03-02
7	关于开展长安货币市场证券投资基金网上直销基金转换费率优惠的公告	证券时报	2019-03-07
8	关于网上直销平台停止受理汇付天下天天盈渠道认购、定投业务的公告	证券时报	2019-03-20
9	004897_长安鑫恒回报混合型证券投资基金2018年年度报告及摘要	证券时报	2019-03-29
10	关于旗下基金在交通银行股份有限公司开展手机银行申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证券时报	2019-03-29
11	关于以通讯方式召开长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证券时报	2019-04-08
12	关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金暂停申购(含转换转入及定期定额投资)业务的公告	证券时报	2019-04-08
13	关于以通讯方式召开长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证券时报	2019-04-09
14	关于以通讯方式召开长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证券时报	2019-04-10
15	004897_长安鑫恒回报混合型证券投资基金2019年第一	证券时报	2019-04-20

	季度报告		
16	关于旗下基金在北京植信基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-23
17	关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	证券时报	2019-05-09
18	长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同（20190510更新）及摘要	证券时报	2019-05-10
19	长安泓源纯债债券型证券投资基金托管协议（20190510更新）	证券时报	2019-05-10
20	长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书（20190510更新）	证券时报	2019-05-10
21	关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金的公告	证券时报	2019-05-10
22	关于长安泓源纯债债券型证券投资基金恢复申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	证券时报	2019-05-13
23	关于旗下基金在西藏东方财富证券股份有限公司开通申购、赎回、基金转换业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-05-14
24	关于旗下基金在华瑞保险销售有限公司开通申购、赎回业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-05-21

25	关于旗下基金在上海大智慧基金销售有限公司开通申购、赎回、定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-05-24
26	关于旗下基金2019年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告	证券时报	2019-06-30
27	关于长安泓源纯债债券型证券投资基金增聘基金经理的公告	证券时报	2019-07-06
28	004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2019年第二季度报告	证券时报	2019-07-18
29	关于旗下基金在南京苏宁基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-08-14
30	关于旗下基金在诺亚正行基金销售有限公司开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-08-23
31	关于旗下基金在平安证券股份有限公司开通申购、赎回和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-08-28
32	004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2019年半年度报告及摘要	证券时报	2019-08-27
33	关于旗下基金在海银基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换和定期定额投资业	证券时报	2019-09-06

	务并参与费率优惠活动的公告		
34	长安基金关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告	证券时报	2019-09-12
35	关于旗下基金在中证金牛（北京）投资咨询有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-09-27
36	长安泓源纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	证券时报	2019-09-27
37	关于旗下基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-10-17
38	004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2019年第三季度报告	证券时报	2019-10-23
39	长安泓源纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告	证券时报	2019-10-23
40	关于长安泓源纯债债券型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同、托管协议的公告	证券时报	2019-11-05
41	长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同20191105	证券时报	2019-11-05
42	长安泓源纯债债券型证券投资基金托管协议20191105	证券时报	2019-11-05

43	长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书更新20191105	证券时报	2019-11-05
44	长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书更新摘要20191105	证券时报	2019-11-05
45	关于旗下基金在上海陆亨基金销售有限公司开通申购、赎回以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	证券时报	2019-11-22
46	关于旗下基金2019年12月31日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	证券时报	2019-12-31

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/01/01 - 2019/04/16	13,302,812.58	-	13,302,812.58	-	-
	2	2019/06/10 - 2019/07/22	-	1,906,406.86	1,906,406.86	-	-
	3	2019/01/29 - 2019/0	-	25,143,895.78	25,143,895.78	-	-

	2/11					
<b>产品特有风险</b>						
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在以下特有风险：</p> <p>（1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；</p> <p>（2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；</p> <p>（3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>（4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>（5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p>						

## 12.2 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、长安泓源纯债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、长安泓源纯债债券型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、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：[www.changanfunds.com](http://www.changanfunds.com)。

长安基金管理有限公司  
二〇二〇年三月三十一日