# 长城久惠灵活配置混合型证券投资基金
# 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 04 月 27 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 01 月 01 日起至 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 ..... 5**
2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 6
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6
**§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 ..... 7**
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 7
3.2 基金净值表现 ..... 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 ..... 9
**§4 管理人报告 ..... 10**
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 12
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 ..... 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 ..... 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 15
4.9 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 ..... 15
**§5 托管人报告 ..... 16**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 16
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 ..... 16
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 ..... 16
**§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 ..... 17
**§7 年度财务报表 ..... 20**
7.1 资产负债表 ..... 20
7.2 利润表 ..... 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 ..... 22
7.4 报表附注 ..... 23
**§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境内股票投资组合 ..... 51
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 ..... 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 55
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 ..... 55
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 ..... 55

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 ..... 55
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 ..... 56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 ..... 56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 56
8.12 投资组合报告附注 ..... 56
**§9 基金份额持有人信息 ..... 58**
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 58
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的情况 ..... 58
**§10 开放式基金份额变动 ..... 59**
**§11 重大事件揭示 ..... 60**
11.1 基金份额持有人大会决议 ..... 60
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 ..... 60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 60
11.4 基金投资策略的改变 ..... 60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 60
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 ..... 60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 60
11.8 其他重大事件 ..... 64
**§12 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 69**
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 ..... 69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 69
**§13 备查文件目录 ..... 70**
13.1 备查文件目录 ..... 70
13.2 存放地点 ..... 70
13.3 查阅方式 ..... 70

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 长城久惠灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长城久惠混合 |
| 基金主代码 | 001363 |
| 交易代码 | 001363 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 8 月 2 日 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 282,379,950.18 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。 |
| 投资策略 | 1、大类资产配置策略<br>在大类资产配置中，本基金将采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险及提高基金收益的目的。<br>2、行业配置策略<br>本基金在行业配置上，采用“投资时钟理论”，对于经济周期景气进行预判，并按照行业轮动的规律进行行业配置。通过对于经济增速、通货膨胀率、以及其他宏观经济指标的分析，可以将经济周期大致划分入复苏、增长、萧条、衰退四个阶段。对应不同的阶段，不同的阶段，配置不同的大类资产及不同的行业，将取得不同的收益，并能够呈现出一定的规律性。<br>3、个股投资策略<br>在个股选择上，基金管理人将优选具备核心竞争力并估值合理的优势个股。<br>4、债券投资策略<br>当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择 |

| | |
|---|---|
| | 策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。 |
| 业绩比较基准 | 55%×沪深 300 指数收益率＋45%×中债总财富指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，为中等风险、中等收益的基金产品。 |

## 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 | | 长城基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 车君 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-23982338 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-23982328 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518026 | 100033 |
| 法定代表人 | | 王军 | 田国立 |

## 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 | www.ccfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层 |
| 注册登记机构 | 长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层 |

# §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 | 2019 年 | 2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 9,597,028.55 | 542,624.74 | - |
| 本期利润 | 13,956,098.87 | 599,841.98 | - |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0901 | 0.0041 | - |
| 本期加权平均净值利润率 | 8.33% | 0.40% | - |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.59% | 0.45% | - |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配利润 | 30,126,564.79 | 4,110,839.65 | - |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1067 | 0.0360 | - |
| 期末基金资产净值 | 316,124,983.31 | 118,759,673.00 | - |
| 期末基金份额净值 | 1.1195 | 1.0405 | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 8.08% | 0.45% | - |

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

③“期末可供分配利润”的计算方法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。

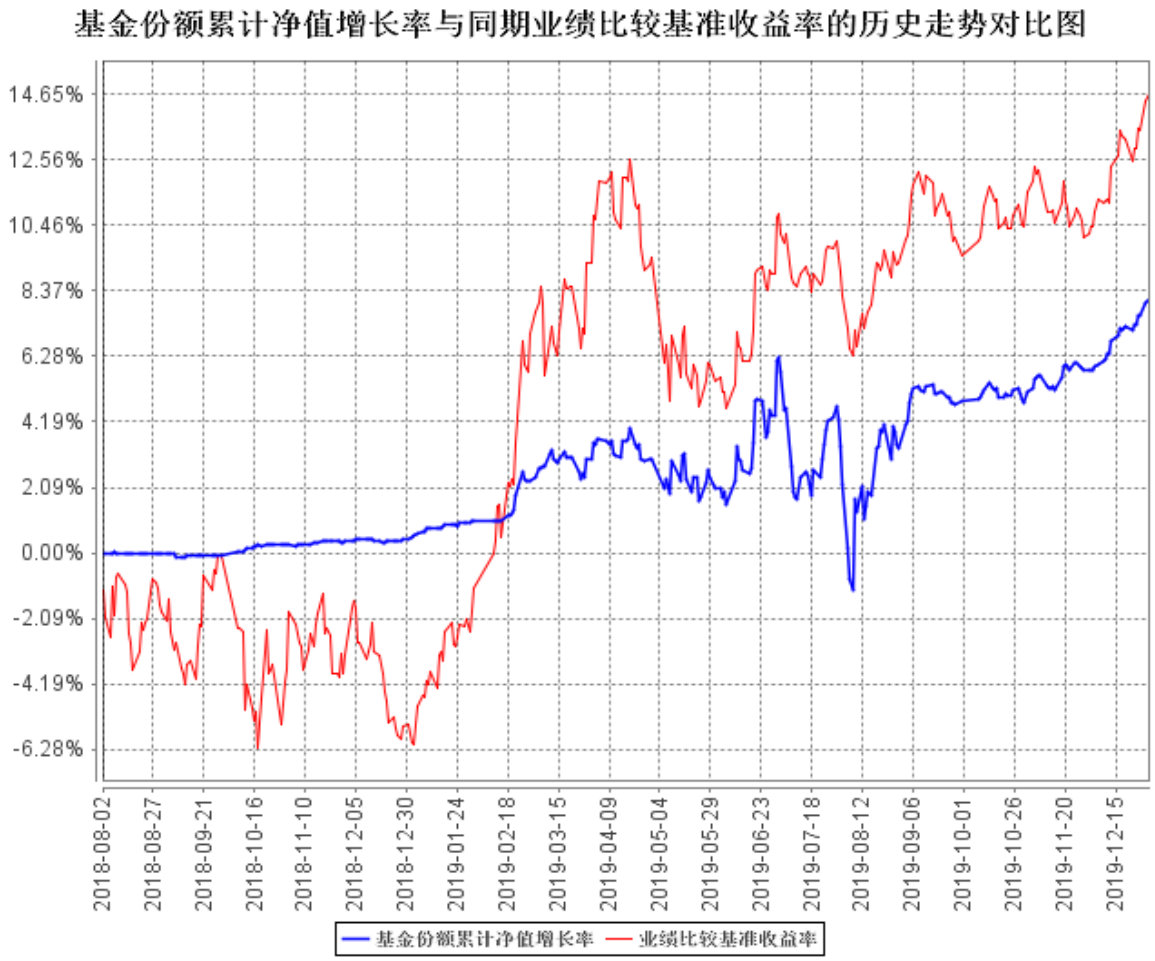
## 3.2 基金净值表现

### 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

| 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 | 3.10% | 0.15% | 4.71% | 0.40% | -1.61% | -0.25% |
| 过去六个月 | 3.52% | 0.54% | 5.27% | 0.47% | -1.75% | 0.07% |
| 过去一年 | 7.59% | 0.45% | 21.36% | 0.67% | -13.77% | -0.22% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 | 8.08% | 0.38% | 14.68% | 0.73% | -6.60% | -0.35% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 生效至今 | | | | | | |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

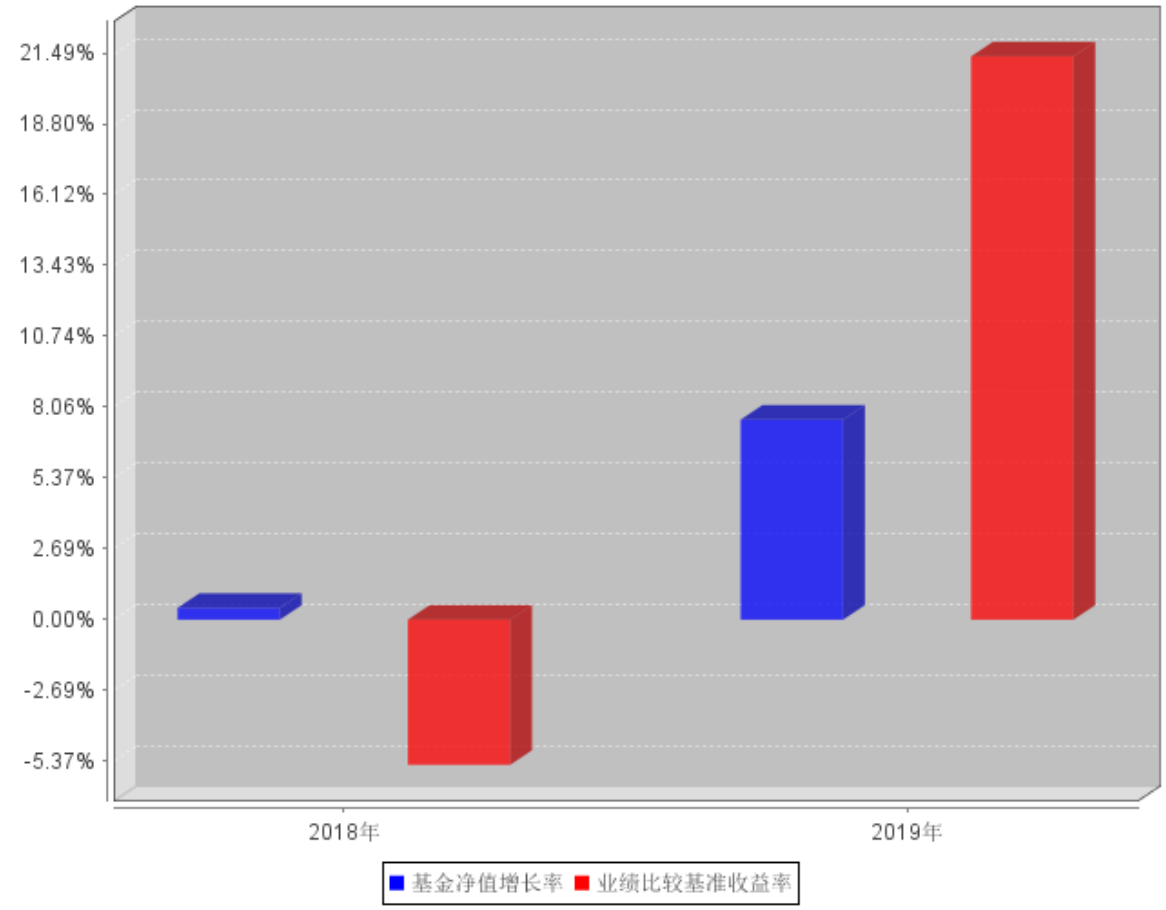



注①本基金合同规定本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

②本基金的建仓期为自基金转型之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 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

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对比图




注：基金转型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

注：本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效（转型），自基金合同生效以来未进行利润分配。

# §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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金包括：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、

长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金。

### 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 | | |
| 马强 | 固定收益部总经理、长城新优选混合、长城积极增利债券、长城久惠混合基金和长城久益混合、长城久悦债券的基金经理 | 2018 年 8 月 2 日 | - | 7 年 | 男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学工学学士、北京大学理学硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012 年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部副总经理“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”和“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理，“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”、“长城久鑫保本混合型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城久益保本混合型证券投资基金”、“长城久安保本混合型证券投资基金”、“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”、“长城新策略灵活配置混合型证券投资基金”、“长城新视野混合型证券投资基金”、“长城久润保本混合型证券投资基金”、“长城久鼎保本混合型证券投资基金”的基金 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久惠灵活配置混合型证券投资基金》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 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管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

### 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了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

### 4.3.3 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，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的现象。

## 4.4 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

总体来看，2019 年国内经济的表现超出预期。尽管内外部环境都存在一定压力，但随着政策逆周期调节力度的加大，国内经济逐渐企稳，并在四季度呈现复苏的迹象，全年 GDP 增速有望保持在 6.2%左右的水平。从拉动经济增长的“三驾马车”来看：投资方面，随着四季度地方专项债的提前下放，以及房地产“因城施策”的继续推进，基建投资和房地产投资均表现出较强的韧性，对经济起到支撑作用；出口方面，尽管受到中美贸易摩擦的负面影响，但全年的进出口额均较 2018 年有所增长，贸易顺差进一步扩大。下半年中美之间出现缓和迹象，外部环境带来的不确定性降低；消费则持续表现稳健，随着居民可支配收入的增加，消费升级的趋势也仍在继续。通胀方面，2019 年 CPI 同比上涨 2.9%，超出年初的预期，也创下自 2011 年以来最大涨幅，生猪价格的快速上涨成为主要因素。

国际经济方面，2019 年全球经济表现较为疲弱。发达经济体如美国、欧洲、日本经济增速整体处于下行通道，贸易摩擦以及英国脱欧均带来较大的不确定性。与此同时，“降息潮”再次开启：美联储 2019 年三次降低联邦基准利率，欧元区下半年重启资产购买计划，新兴经济体也纷纷降低利率，负利率在全球进一步蔓延。

国内货币政策方面，宽松成为 2019 年的主基调：从年初的降准，到年末的降低 MLF 和 LPR 利率、7 天和 14 天逆回购操作利率。银行间的流动性较为宽裕，隔夜利率更是一度降至 1%以下，处于历史最低区间。1 年期的 AAA 同业存单收益率全年下行 40bp 至 3%，长端利率债则呈现震荡走势，10Y 国开债收益率收于 3.60%，全年走平。

国内股市在 2019 年涨幅明显。一方面，2018 年市场在各种负面因素影响下跌幅较大，许多行业估值跌至历史最低区间，价值凸显，如白酒、家电、建材等行业；另一方面，随着逆周期政策力度的增加，部分行业呈现复苏的迹象，如养殖、电子、传媒、医药等行业。与此同时，市场的分化也进一步加剧，不仅体现在行业与行业之间，同一行业内的不同公司之间也是如此。

资产配置方面，本基金债券部分保持中短久期以及高等级的配置，在震荡市中操作较少；股票部分，上半年以增加仓位为主，下半年则逐渐降低仓位并兑现部分收益，持仓以蓝筹股为主。同时积极参与新股及科创板打新，增厚了组合业绩。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 7.59%，本基金业绩比较基准收益率为 21.36%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，国内经济有望呈现弱复苏状态。第一，2020 年是“十三五”规划的最后一年，

也是脱贫攻坚战的收官之年，逆周期调节政策的力度有望进一步加强；第二，外部环境从不利转为有利。随着第一阶段贸易协议的签署，中美之间的贸易摩擦出现缓和，全球经济增长的不确定性有望降低；同时，低利率环境也有利于全球经济走出疲弱的状态；第三，通胀高点过后，国内的货币政策空间也有望进一步打开。2019 年四季度，能繁母猪存栏出现环比改善，2020 年猪肉价格走势大概率呈现前高后低的状态，有望缓解对于货币政策的制约，对股票和债券投资提供较为有利的政策环境。

## 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，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监察关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。本年度公司督察长根据法律法规和公司制度的要求按时向中国证券监督管理委员会、公司董事会提交了监察稽核工作报告。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金

所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。 基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## 4.9 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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

# §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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

## 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

# §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 | 安永华明（2020）审字第 60737541_H29 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 | 长城久惠灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了长城久惠灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为，后附的长城久惠灵活配置混合型证券投资基金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，公允反映了长城久惠灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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，我们独立于长城久惠灵活配置混合型证券投资基金，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。 |
| 强调事项 | 不适用 |
| 其他事项 | 不适用 |
| 其他信息 | 长城久惠灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。<br>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。<br>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。<br>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。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 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。<br>在编制财务报表时，管理层负责评估长城久惠灵活配置混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。<br>治理层负责监督长城久惠灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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。<br>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：<br>(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。<br>(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。<br>(3)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。<br>(4)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，就可能导致对长城久惠灵活配置混合型证券投资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报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城久惠灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。<br>(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。<br><br>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。 | |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | |
| 注册会计师的姓名 | 吴翠蓉 | 乌爱莉 |
| 会计师事务所的地址 | 中国　北京 | |
| 审计报告日期 | 2020 年 4 月 27 日 | |

# §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长城久惠灵活配置混合型证券投资基金

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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 1,172,186.25 | 1,231,831.61 |
| 结算备付金 | | 619,047.62 | 3,011,833.87 |
| 存出保证金 | | 26,998.08 | 13,814.26 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 315,113,622.32 | 87,699,444.10 |
| 其中：股票投资 | | 73,744,924.02 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 241,368,698.30 | 87,699,444.10 |
| 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 | - | 26,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | 3,000,000.00 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 5,151,355.92 | 1,534,747.76 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 6,421.72 | 59.92 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 325,089,631.91 | 119,491,731.52 |
| **负债和所有者权益** | **附注号** | **本期末<br>2019 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>2018 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 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 | | 3,700,000.00 | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 4,707,397.45 | 186,417.05 |
| 应付管理人报酬 | | 302,300.07 | 155,221.87 |
| 应付托管费 | | 58,163.22 | 25,870.31 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 16,774.52 | - |
| 应交税费 | | 1,401.99 | 5,549.29 |
| 应付利息 | | 59.26 | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 178,552.09 | 359,000.00 |
| 负债合计 | | 8,964,648.60 | 732,058.52 |
| **所有者权益：** | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 282,379,950.18 | 114,135,700.95 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 33,745,033.13 | 4,623,972.05 |
| 所有者权益合计 | | 316,124,983.31 | 118,759,673.00 |
| 负债和所有者权益总计 | | 325,089,631.91 | 119,491,731.52 |

注：1.报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1195 元，基金份额总额 282,379,950.18 份。

2.本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效，上年度可比期间数据系自 2018 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **一、收入** | | 17,341,127.44 | 1,872,401.41 |
| 1.利息收入 | | 3,865,338.04 | 1,842,780.85 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 56,780.06 | 107,083.29 |
| 债券利息收入 | | 3,356,554.33 | 1,299,535.69 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 452,003.65 | 436,161.87 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 9,002,182.17 | -30,402.67 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 7,105,261.38 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 400,557.28 | -30,402.67 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.13.2 | - | - |
| 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 | 1,496,363.51 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 4,359,070.32 | 57,217.24 |
| 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 | 114,536.91 | 2,805.99 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **减：二、费用** | | 3,385,028.57 | 1,272,559.43 |
| 1．管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 2,428,138.86 | 944,979.79 |
| 2．托管费 | 7.4.10.2.2 | 412,469.69 | 157,496.59 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．交易费用 | 7.4.7.19 | 319,841.59 | 151.83 |
| 5．利息支出 | | 20,324.68 | 3,452.05 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 20,324.68 | 3,452.05 |
| 6．税金及附加 | | 1,078.48 | 2,571.72 |
| 7．其他费用 | 7.4.7.20 | 203,175.27 | 163,907.45 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 13,956,098.87 | 599,841.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 13,956,098.87 | 599,841.98 |

注：本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效，上年度可比期间数据系自 2018 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久惠灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 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） | 114,135,700.95 | 4,623,972.05 | 118,759,673.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13,956,098.87 | 13,956,098.87 |
| 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） | 168,244,249.23 | 15,164,962.21 | 183,409,211.44 |
| 其中：1.基金申购款 | 255,873,543.08 | 22,213,616.68 | 278,087,159.76 |
| 2.基金赎回款 | -87,629,293.85 | -7,048,654.47 | -94,677,948.32 |
| 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） | 282,379,950.18 | 33,745,033.13 | 316,124,983.31 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)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） | 290,465,234.36 | 10,397,035.25 | 300,862,269.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 599,841.98 | 599,841.98 |
| 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） | -176,329,533.41 | -6,372,905.18 | -182,702,438.59 |
| 其中：1.基金申购款 | 224,392.56 | 8,060.49 | 232,453.05 |
| 2.基金赎回款 | -176,553,925.97 | -6,380,965.67 | -182,934,891.64 |
| 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） | 114,135,700.95 | 4,623,972.05 | 118,759,673.00 |

注：本基金合同于 2018 年 8 月 2 日生效，上年度可比期间数据系自 2018 年 8 月 2 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。

附注为本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：

| 王军 | 熊科金 | 赵永强 |
|---|---|---|
| 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

长城久惠灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长城久惠保本混合型证券投资基金于 2018 年 8 月 2 日转型而来。长城久惠保本混合型证券投资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[2015]805 号文“关于准予长城久惠保本混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司向社会公开募集，首次设立募集规模为 2,975,442,218.70 份基金份额，基金合同于 2015 年 7 月 27 日生效。长城久惠保本混合型证券投资基金为契约型开放式，存续期限不定；基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《长城久惠保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，长城久惠保本混合型证券投资基金保本周期为 3 年，2018 年 7 月 27 日为长城久惠保本混合型证券投资基金的第一个保本周期到期日。长城久惠保本混合型证券投资基金保本周期到期时，由于未能符合避险策略基金存续条件，根据《长城久惠保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为长城久惠灵活配置混合型证券投资基金。在长城久惠保本混合型证券投资基金的到期期间内，即 2018 年 7 月 27 日(含)至 2018 年 8 月 1 日(含)，基金接受赎回、转换转出申请，不接受申购和转换转入申请。自 2018 年 8 月 2 日，长城久惠保本混合型证券投资基金正式转型为长城久惠灵活配置混合型证券投资基金，转型后的《长城久惠保本混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等)、权证、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)。本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：55%×沪深 300 指数收益率＋45%×中债总财富指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值

作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值。

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：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；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的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利

得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并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入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金于 2019 年 12 月 6 日降低了管理费率，变动前基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提，变动后自 2019 年 12 月 6 日起，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提 ；

(2) 基金于 2019 年 12 月 6 日降低了托管费率，变动前基金托管费按前一日基金资产净值的

0.25%的年费率逐日计提，变动后自 2019 年 12 月 6 日起，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

3、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基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2.增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款 | 1,172,186.25 | 1,231,831.61 |
| 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： | 1,172,186.25 | 1,231,831.61 |

### 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 | | 70,140,586.27 | 73,744,924.02 | 3,604,337.75 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 39,919,610.71 | 39,996,698.30 | 77,087.59 |
| | 银行间市场 | 200,637,137.78 | 201,372,000.00 | 734,862.22 |
| | 合计 | 240,556,748.49 | 241,368,698.30 | 811,949.81 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 310,697,334.76 | 315,113,622.32 | 4,416,287.56 |
| 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 | | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 87,642,226.86 | 87,699,444.10 | 57,217.24 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 87,642,226.86 | 87,699,444.10 | 57,217.24 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 87,642,226.86 | 87,699,444.10 | 57,217.24 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

### 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<br>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 | - | - |
| 合计 | - | - |
| 项目 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 26,000,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 26,000,000.00 | - |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均未持有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<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应收活期存款利息 | 937.49 | 1,921.18 |
| 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 | 306.46 | 1,490.83 |
| 应收债券利息 | 5,150,098.55 | 1,506,397.43 |
| 应收资产支持证券利息 | - | - |
| 应收买入返售证券利息 | - | 24,931.50 |
| 应收申购款利息 | - | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - | - |
| 其他 | 13.42 | 6.82 |
| 合计 | 5,151,355.92 | 1,534,747.76 |

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场应付交易费用 | 16,399.52 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 375.00 | - |
| 合计 | 16,774.52 | - |

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2019 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 9,552.09 | - |
| 预提审计费 | 40,000.00 | 50,000.00 |
| 预提信息披露费 | 120,000.00 | 300,000.00 |
| 预提中债登债券帐户服务费 | 4,500.00 | 4,500.00 |
| 预提上清所债券帐户服务费 | 4,500.00 | 4,500.00 |
| 合计 | 178,552.09 | 359,000.00 |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 114,135,700.95 | 114,135,700.95 |
| 本期申购 | 255,873,543.08 | 255,873,543.08 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -87,629,293.85 | -87,629,293.85 |
| 本期末 | 282,379,950.18 | 282,379,950.18 |

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

### 7.4.7.10 未分配利润

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 | 4,110,839.65 | 513,132.40 | 4,623,972.05 |
| 本期利润 | 9,597,028.55 | 4,359,070.32 | 13,956,098.87 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 16,418,696.59 | -1,253,734.38 | 15,164,962.21 |
| 其中：基金申购款 | 23,216,213.24 | -1,002,596.56 | 22,213,616.68 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金赎回款 | -6,797,516.65 | -251,137.82 | -7,048,654.47 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 30,126,564.79 | 3,618,468.34 | 33,745,033.13 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 活期存款利息收入 | 26,453.99 | 81,475.41 |
| 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 | 29,902.38 | 25,534.52 |
| 其他 | 423.69 | 73.36 |
| 合计 | 56,780.06 | 107,083.29 |

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

### 7.4.7.12 股票投资收益

### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 74,132,010.20 | - |
| 减：卖出股票成本总额 | 67,026,748.82 | - |
| 买卖股票差价收入 | 7,105,261.38 | - |

### 7.4.7.13 债券投资收益

### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间<br>2018年8月2日(基金合同生效日)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 | 160,635,497.11 | 31,738,746.04 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 156,799,990.28 | 31,141,540.47 |
| 减：应收利息总额 | 3,434,949.55 | 627,608.24 |
| 买卖债券差价收入 | 400,557.28 | -30,402.67 |

### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未进行贵金属投资，未发生贵金属投资收益/损失。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金于本期无衍生工具收益/损失。

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,496,363.51 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 1,496,363.51 | - |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 4,359,070.32 | 57,217.24 |
| ——股票投资 | 3,604,337.75 | - |
| ——债券投资 | 754,732.57 | 57,217.24 |
| ——资产支持证券投资 | - | - |
| ——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 | 4,359,070.32 | 57,217.24 |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 基金赎回费收入 | 112,013.67 | 2,805.99 |
| 转出基金补偿收入 | 2,523.24 | - |
| 合计 | 114,536.91 | 2,805.99 |

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 交易所市场交易费用 | 318,291.59 | 151.83 |
| 银行间市场交易费用 | 1,550.00 | - |
| 交易基金产生的费用 | - | - |
| 其中：申购费 | - | - |
| 赎回费 | - | - |
| 合计 | 319,841.59 | 151.83 |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 审计费用 | 40,000.00 | 20,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 124,933.17 |
| 银行间债券账户服务费 | 36,000.00 | 14,869.76 |
| 其他 | 1,200.00 | 300.00 |
| 银行划款手续费 | 5,975.27 | 3,804.52 |
| 合计 | 203,175.27 | 163,907.45 |

注：其他为上清所银行间查询服务费。

### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露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 |
| --- | --- |
| 长城基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人股东、基金销售机构 |
| 东方证券股份有限公司（“东方证券”） | 基金管理人股东 |
| 中原信托有限公司 | 基金管理人股东 |
| 北方国际信托股份有限公司 | 基金管理人股东 |
| 长城嘉信资产管理有限公司 | 基金管理人控股子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2018年8月2日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 长城证券 | 146,353,570.14 | 72.00% | - | - |

### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018年8月2日(基金合同生效日)至2018年12月31日 |
| --- | --- | --- |

| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 东方证券 | 80,914,773.70 | 46.15% | 60,307,223.83 | 40.23% |
| 长城证券 | 75,066,407.50 | 42.81% | 89,587,681.30 | 59.77% |

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2018年8月2日(基金合同生效日)至2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 长城证券 | 2,634,500,000.00 | 69.54% | 3,162,500,000.00 | 100.00% |

### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 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<br>2019年1月1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 |
| 东方证券 | - | - | - | - |
| 长城证券 | 136,299.26 | 72.00% | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年8月2日(基金合同生效日)至2018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 |
| 东方证券 | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - |

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,428,138.86 | 944,979.79 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,370,527.09 | 570,309.74 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金于 2019 年 12 月 6 日降低了管理费率，变动前基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提，变动后自 2019 年 12 月 6 日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

变动前：

H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

变动后(自 2019 年 12 月 6 日起)：

H=E×1.00%/当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 412,469.69 | 157,496.59 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金于 2019 年 12 月 6 日降低了托管费率，变动前基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提，变动后自 2019 年 12 月 6 日起，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

变动前：

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

变动后(自 2019 年 12 月 6 日起)：

H=E×0.20%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 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

注：本基金于本期及上年度可比期间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

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

### 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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

### 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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间<br>2018 年 8 月 2 日(基金合同生效日)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 |
| 中国建设银行 | 1,172,186.25 | 26,453.99 | 1,231,831.61 | 81,475.41 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

### 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 | 证券 | 成功 | 可流 | 流通 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值总额 | 备注 |

| 代码 | 名称 | 认购日 | 通日 | 受限类型 | 价格 | 值单价 | （单位：股） | 成本总额 | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 688036 | 传音控股 | 2019 年 9 月 23 日 | 2020 年 3 月 30 日 | 新股锁定 | 35.15 | 42.95 | 21,784 | 765,707.60 | 935,622.80 | - |
| 688058 | 宝兰德 | 2019 年 10 月 25 日 | 2020 年 5 月 6 日 | 新股锁定 | 79.30 | 90.65 | 1,450 | 114,985.00 | 131,442.50 | - |
| 688078 | 龙软科技 | 2019 年 12 月 20 日 | 2020 年 6 月 30 日 | 新股锁定 | 21.59 | 41.95 | 2,811 | 60,689.49 | 117,921.45 | - |
| 688101 | 三达膜 | 2019 年 11 月 8 日 | 2020 年 5 月 15 日 | 新股锁定 | 18.26 | 17.89 | 13,483 | 246,199.58 | 241,210.87 | - |
| 688111 | 金山办公 | 2019 年 11 月 11 日 | 2020 年 5 月 18 日 | 新股锁定 | 45.86 | 128.63 | 14,659 | 672,261.74 | 1,885,587.17 | - |
| 688118 | 普元信息 | 2019 年 11 月 26 日 | 2020 年 6 月 4 日 | 新股锁定 | 26.90 | 35.30 | 4,028 | 108,353.20 | 142,188.40 | - |
| 688123 | 聚辰股份 | 2019 年 12 月 16 日 | 2020 年 6 月 23 日 | 新股锁定 | 33.25 | 58.12 | 6,660 | 221,445.00 | 387,079.20 | - |
| 688196 | 卓越新能 | 2019 年 11 月 13 日 | 2020 年 5 月 21 日 | 新股锁定 | 42.93 | 38.37 | 11,131 | 477,853.83 | 427,096.47 | - |

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 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：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 110065 | 淮矿转债 | 2019 年 12 月 25 日 | 2020 年 1 月 13 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 540 | 54,000.00 | 54,000.00 | - |
| 113029 | 明阳 | 2019 年 | 2020 | 新债未 | 100.00 | 100.00 | 1,560 | 156,000.00 | 156,000.00 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 转债 | 12 月 18 日 | 年 1 月 7 日 | 上市 | | | | | | |
| 113030 | 东风转债 | 2019 年 12 月 26 日 | 2020 年 1 月 20 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 280 | 28,000.00 | 28,000.00 | - |
| 128084 | 木森转债 | 2019 年 12 月 18 日 | 2020 年 1 月 10 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 780 | 78,000.00 | 78,000.00 | - |
| 128085 | 鸿达转债 | 2019 年 12 月 18 日 | 2020 年 1 月 8 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 1,000 | 100,000.00 | 100,000.00 | - |
| 128086 | 国轩转债 | 2019 年 12 月 19 日 | 2020 年 1 月 10 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 610 | 61,000.00 | 61,000.00 | - |

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

### 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

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元,无质押债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 3,700,000.00 元，将于 2020 年 1 月 6 日至 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

### 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。本基金均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发行的证券，不得超过该证券市值的 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；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，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人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。本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，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。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期

内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因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。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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 | 1,172,186.25 | - | - | - | - | - | 1,172,186.25 |
| 结算备付金 | 619,047.62 | - | - | - | - | - | 619,047.62 |
| 存出保证金 | 26,998.08 | - | - | - | - | - | 26,998.08 |
| 交易性金融资产 | - | - | 17,835,171.30 | 221,378,000.00 | 2,155,527.00 | 73,744,924.02 | 315,113,622.32 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 3,000,000.00 | 3,000,000.00 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 5,151,355.92 | 5,151,355.92 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 6,421.72 | 6,421.72 |
| 资产总计 | 1,818,231.95 | - | 17,835,171.30 | 221,378,000.00 | 2,155,527.00 | 81,902,701.66 | 325,089,631.91 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 3,700,000.00 | - | - | - | - | - | 3,700,000.00 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 4,707,397.45 | 4,707,397.45 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 302,300.07 | 302,300.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 58,163.22 | 58,163.22 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 16,774.52 | 16,774.52 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 59.26 | 59.26 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 1,401.99 | 1,401.99 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 178,552.09 | 178,552.09 |
| 负债总计 | 3,700,000.00 | - | - | - | - | 5,264,648.60 | 8,964,648.60 |
| 利率敏感度缺口 | -1,881,768.05 | - | 17,835,171.30 | 221,378,000.00 | 2,155,527.00 | | |
| 上年度末 2018 年 12 月 | 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 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 31 日 | | | | | | | |
| 资产 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,231,831.61 | - | - | - | - | - | 1,231,831.61 |
| 结算备付金 | 3,011,833.87 | - | - | - | - | - | 3,011,833.87 |
| 存出保证金 | 13,814.26 | - | - | - | - | - | 13,814.26 |
| 交易性金融资产 | - | - | 42,358,444.10 | 45,341,000.00 | - | - | 87,699,444.10 |
| 买入返售金融资产 | 26,000,000.00 | - | - | - | - | - | 26,000,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 1,534,747.76 | 1,534,747.76 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 59.92 | 59.92 |
| 资产总计 | 30,257,479.74 | - | 42,358,444.10 | 45,341,000.00 | - | 1,534,807.68 | 119,491,731.52 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 186,417.05 | 186,417.05 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 155,221.87 | 155,221.87 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 25,870.31 | 25,870.31 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 5,549.29 | 5,549.29 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 359,000.00 | 359,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 732,058.52 | 732,058.52 |
| 利率 | 30,257,479.74 | - | 42,358,444.10 | 45,341,000.00 | - | | |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 敏感度缺口 | | | | | | | |

### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时 | | |
|---|---|---|---|
| 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 ） | 上年度末（ 2018 年 12 月 31 日 ） |
| | 利率上升 25 个基点 | -1,156,825.71 | -271,850.40 |
| | 利率下降 25 个基点 | 1,165,865.27 | 273,552.97 |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险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。

本基金的投资组合的资产配置为：股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

于本报告期及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

### 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<br>2019 年 12 月 31 日 | | 上年度末<br>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 | 73,744,924.02 | 23.33 | - | - |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | 241,368,698.30 | 76.35 | 87,699,444.10 | 73.85 |
| 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 | 315,113,622.32 | 99.68 | 87,699,444.10 | 73.85 |

### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时 | | |
|---|---|---|---|
| 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 ） | 上年度末（ 2018 年 12 月 31 日 ） |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 3,078,850.58 | - |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -3,078,850.58 | - |

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。于上年度末，本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有股票投资、权证投资等其他交易性金融资产，因此无重大的其他价格风险。

### 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

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

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划分为第一层次的余额为人民币 71,155,302.16 元，划分为第二层次的余额为人民币 243,958,320.16 元，无划分为第三层次的余额。于 2018 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划分为第二层次的余额为人民币 87,699,444.10 元，无划分为第一层次和第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

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等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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

## 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 | 73,744,924.02 | 22.68 |
| | 其中：股票 | 73,744,924.02 | 22.68 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 241,368,698.30 | 74.25 |
| | 其中：债券 | 241,368,698.30 | 74.25 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,791,233.87 | 0.55 |
| 8 | 其他各项资产 | 8,184,775.72 | 2.52 |
| 9 | 合计 | 325,089,631.91 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 12,181,830.00 | 3.85 |
| C | 制造业 | 23,905,575.50 | 7.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,369,054.00 | 1.07 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,257,337.00 | 1.35 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,166,718.52 | 1.63 |
| J | 金融业 | 21,851,320.00 | 6.91 |
| K | 房地产业 | 2,043,534.00 | 0.65 |
| L | 租赁和商务服务业 | 969,555.00 | 0.31 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 73,744,924.02 | 23.33 |

## 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 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600690 | 海尔智家 | 190,700 | 3,718,650.00 | 1.18 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 629,800 | 3,703,224.00 | 1.17 |
| 3 | 600176 | 中国巨石 | 337,600 | 3,679,840.00 | 1.16 |
| 4 | 600900 | 长江电力 | 183,300 | 3,369,054.00 | 1.07 |
| 5 | 601006 | 大秦铁路 | 408,200 | 3,351,322.00 | 1.06 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 903,400 | 3,333,546.00 | 1.05 |
| 7 | 601225 | 陕西煤业 | 358,700 | 3,224,713.00 | 1.02 |
| 8 | 601988 | 中国银行 | 870,100 | 3,210,669.00 | 1.02 |
| 9 | 600028 | 中国石化 | 610,600 | 3,120,166.00 | 0.99 |
| 10 | 601857 | 中国石油 | 529,800 | 3,088,734.00 | 0.98 |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 522,700 | 2,942,801.00 | 0.93 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 33,300 | 2,845,818.00 | 0.90 |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 494,900 | 2,840,726.00 | 0.90 |
| 14 | 600660 | 福耀玻璃 | 108,300 | 2,598,117.00 | 0.82 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 33,600 | 2,203,488.00 | 0.70 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 82,000 | 2,074,600.00 | 0.66 |
| 17 | 600048 | 保利地产 | 126,300 | 2,043,534.00 | 0.65 |
| 18 | 600309 | 万华化学 | 34,700 | 1,949,099.00 | 0.62 |
| 19 | 688111 | 金山办公 | 14,659 | 1,885,587.17 | 0.60 |
| 20 | 002271 | 东方雨虹 | 62,340 | 1,640,165.40 | 0.52 |
| 21 | 601088 | 中国神华 | 80,700 | 1,472,775.00 | 0.47 |
| 22 | 601818 | 光大银行 | 303,800 | 1,339,758.00 | 0.42 |
| 23 | 600547 | 山东黄金 | 39,100 | 1,275,442.00 | 0.40 |
| 24 | 600015 | 华夏银行 | 158,500 | 1,215,695.00 | 0.38 |
| 25 | 601211 | 国泰君安 | 64,100 | 1,185,209.00 | 0.37 |
| 26 | 600519 | 贵州茅台 | 1,000 | 1,183,000.00 | 0.37 |
| 27 | 600845 | 宝信软件 | 35,230 | 1,159,067.00 | 0.37 |
| 28 | 601012 | 隆基股份 | 42,716 | 1,060,638.28 | 0.34 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 29 | 600588 | 用友网络 | 35,900 | 1,019,560.00 | 0.32 |
| 30 | 601888 | 中国国旅 | 10,900 | 969,555.00 | 0.31 |
| 31 | 688036 | 传音控股 | 21,784 | 935,622.80 | 0.30 |
| 32 | 601111 | 中国国航 | 93,500 | 906,015.00 | 0.29 |
| 33 | 002555 | 三七互娱 | 26,400 | 710,952.00 | 0.22 |
| 34 | 600438 | 通威股份 | 44,100 | 579,033.00 | 0.18 |
| 35 | 688196 | 卓越新能 | 11,131 | 427,096.47 | 0.14 |
| 36 | 688123 | 聚辰股份 | 6,660 | 387,079.20 | 0.12 |
| 37 | 000596 | 古井贡酒 | 2,700 | 366,984.00 | 0.12 |
| 38 | 688101 | 三达膜 | 13,483 | 241,210.87 | 0.08 |
| 39 | 688118 | 普元信息 | 4,028 | 142,188.40 | 0.04 |
| 40 | 688058 | 宝兰德 | 1,450 | 131,442.50 | 0.04 |
| 41 | 688078 | 龙软科技 | 2,811 | 117,921.45 | 0.04 |
| 42 | 600585 | 海螺水泥 | 1,400 | 76,720.00 | 0.02 |
| 43 | 603109 | 神驰机电 | 684 | 18,105.48 | 0.01 |

## 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 | 601318 | 中国平安 | 6,899,605.00 | 5.81 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 5,857,968.00 | 4.93 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 4,384,997.00 | 3.69 |
| 4 | 601857 | 中国石油 | 4,293,480.00 | 3.62 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 4,179,454.00 | 3.52 |
| 6 | 601012 | 隆基股份 | 3,863,137.53 | 3.25 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 3,836,006.00 | 3.23 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 3,696,926.00 | 3.11 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 3,630,347.00 | 3.06 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 3,399,865.00 | 2.86 |
| 11 | 601155 | 新城控股 | 3,304,059.00 | 2.78 |
| 12 | 601668 | 中国建筑 | 3,297,504.00 | 2.78 |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 3,297,410.00 | 2.78 |
| 14 | 600028 | 中国石化 | 3,297,240.00 | 2.78 |
| 15 | 601225 | 陕西煤业 | 3,296,453.00 | 2.78 |
| 16 | 600690 | 海尔智家 | 3,295,927.43 | 2.78 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 17 | 600176 | 中国巨石 | 3,294,976.00 | 2.77 |
| 18 | 600019 | 宝钢股份 | 3,293,938.87 | 2.77 |
| 19 | 601006 | 大秦铁路 | 3,291,157.00 | 2.77 |
| 20 | 600050 | 中国联通 | 3,291,149.00 | 2.77 |
| 21 | 601328 | 交通银行 | 3,287,783.00 | 2.77 |
| 22 | 601988 | 中国银行 | 3,280,277.00 | 2.76 |
| 23 | 600900 | 长江电力 | 3,066,116.00 | 2.58 |
| 24 | 002271 | 东方雨虹 | 2,596,391.68 | 2.19 |
| 25 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,520,495.00 | 2.12 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 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 | 600030 | 中信证券 | 4,747,140.09 | 4.00 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 4,635,582.00 | 3.90 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 4,340,982.11 | 3.66 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 4,145,829.60 | 3.49 |
| 5 | 601012 | 隆基股份 | 3,282,319.00 | 2.76 |
| 6 | 600050 | 中国联通 | 3,141,152.00 | 2.64 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 3,073,184.00 | 2.59 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 3,041,162.00 | 2.56 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 3,009,720.80 | 2.53 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 2,400,108.00 | 2.02 |
| 11 | 601155 | 新城控股 | 2,333,205.96 | 1.96 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 2,184,889.00 | 1.84 |
| 13 | 000858 | 五粮液 | 2,061,571.95 | 1.74 |
| 14 | 601688 | 华泰证券 | 1,835,964.00 | 1.55 |
| 15 | 600048 | 保利地产 | 1,691,577.00 | 1.42 |
| 16 | 601166 | 兴业银行 | 1,587,707.00 | 1.34 |
| 17 | 300383 | 光环新网 | 1,357,177.00 | 1.14 |
| 18 | 603019 | 中科曙光 | 1,249,087.00 | 1.05 |
| 19 | 688099 | 晶晨股份 | 1,148,232.71 | 0.97 |
| 20 | 002271 | 东方雨虹 | 999,840.00 | 0.84 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 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 | 137,167,335.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 74,132,010.20 |

注：买入股票成本和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 | 219,207,171.30 | 69.34 |
| | 其中：政策性金融债 | 219,207,171.30 | 69.34 |
| 4 | 企业债券 | 20,006,000.00 | 6.33 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,155,527.00 | 0.68 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 241,368,698.30 | 76.35 |

## 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 | 190207 | 19 国开 07 | 1,600,000 | 161,184,000.00 | 50.99 |
| 2 | 190202 | 19 国开 02 | 400,000 | 40,188,000.00 | 12.71 |
| 3 | 136253 | 16 中油 03 | 200,000 | 20,006,000.00 | 6.33 |
| 4 | 108602 | 国开 1704 | 102,210 | 10,275,171.30 | 3.25 |
| 5 | 018007 | 国开 1801 | 75,000 | 7,560,000.00 | 2.39 |

## 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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期未投资股指期货，本期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 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

注：本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 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受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 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 | 26,998.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,000,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,151,355.92 |
| 5 | 应收申购款 | 6,421.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 9 | 合计 | 8,184,775.72 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末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，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

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 1,763 | 160,170.14 | - | - | 282,379,950.18 | 100.00% |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

## 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的情况

| 项目 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

# §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（ 2018 年 8 月 2 日 ）基金份额总额 | 290,465,234.36 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 114,135,700.95 |
| 本报告期基金总申购份额 | 255,873,543.08 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 87,629,293.85 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 282,379,950.18 |

# §11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金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、基金管理人重大人事变动

自 2019 年 4 月 2 日起卢盛春先生不再担任公司副总经理。

自 2019 年 4 月 2 日起沈阳女士担任公司副总经理。

自 2019 年 5 月 16 日起赵建兴先生担任公司副总经理。

自 2019 年 12 月 18 日起何伟先生不再担任公司董事，由许明波先生担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

## 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

本基金本报告期投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币肆万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

## 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

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|---|---|---|---|---|

| | 数量 | 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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 长城证券 | 5 | 146,353,570.14 | 71.95% | 136,299.26 | 72.00% | - |
| 中泰证券 | 2 | 48,996,822.96 | 24.09% | 45,494.78 | 24.03% | - |
| 国金证券 | 2 | 8,073,319.43 | 3.97% | 7,518.56 | 3.97% | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 3 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内新增 5 个专用交易单元（财通证券和中信建投各新增 2 个交易单元、华西证券新增 1 个交易单元），减少 5 个专用交易单元（西部证券减少 2 个交易单元、九州证券和瑞银证券各减少 1 个交易单元、中投证券更名为中金财富证券减少 1 个交易单元），截止本报告期末共计 58 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

(1)实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

(2)财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3)经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；

(4)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；

(5)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

## 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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 |
| 长城证券 | 75,066,407.50 | 42.81% | 2,634,500,000.00 | 69.54% | - | - |
| 中泰证券 | 12,851,126.55 | 7.33% | 1,134,547,000.00 | 29.95% | - | - |
| 国金证券 | 6,504,938.66 | 3.71% | 19,289,000.00 | 0.51% | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 80,914,773.70 | 46.15% | - | - | - | - |

## 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 | 关于增加江苏银行为长城基金旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 1 月 7 日 |
| 2 | 长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 1 月 16 日 |
| 3 | 长城基金管理有限公司关于参加奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 2 月 22 日 |
| 4 | 长城基金管理有限公司关于旗下 | 中国证券报、上海证 | 2019 年 2 月 22 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 基金持有的“信威集团”股票估值方法调整的公告 | 券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | |
| 5 | 长城基金管理有限公司关于参加泉州银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 3 月 1 日 |
| 6 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(长春高新) | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 3 月 5 日 |
| 7 | 关于参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 3 月 30 日 |
| 8 | 长城基金管理有限公司关于参加方正证券费率优惠活动的公告（含认购、定投-放开折扣限制） | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 2 日 |
| 9 | 长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(格力电器) | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 2 日 |
| 10 | 长城基金关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 4 日 |
| 11 | 长城基金管理有限公司关于变更公司副总经理的公告 | 证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 4 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 12 | 长城基金关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 12 日 |
| 13 | 长城基金管理有限公司关于参加深圳农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告（含认购、定投-放开折扣限制） | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 18 日 |
| 14 | 长城基金管理有限公司关于参加北京植信基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 19 日 |
| 15 | 长城基金关于增加万联证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及参与其费率优惠活动的公告. | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 4 月 23 日 |
| 16 | 长城基金管理有限公司关于变更公司副总经理的公告（赵建兴） | 证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 5 月 17 日 |
| 17 | 长城基金关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下开放式基金代销机构及参与其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 5 月 24 日 |
| 18 | 长城基金关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务及参与其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 5 月 31 日 |
| 19 | 长城基金管理有限公司关于提醒客户更新、完善身份信息的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管 | 2019 年 6 月 18 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 理人网站 | |
| 20 | 长城基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于科创板股票的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 6 月 26 日 |
| 21 | 长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中科曙光”股票估值方法调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 6 月 26 日 |
| 22 | 长城基金关于旗下部分开放式基金参与中国银行开展的定期定额投资基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 6 月 27 日 |
| 23 | 长城基金管理有限公司关于网上交易平台与长城基金管家（手机 APP）开展基金认申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 7 月 1 日 |
| 24 | 长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新城控股”股票估值方法调整的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 7 月 5 日 |
| 25 | 长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 8 月 23 日 |
| 26 | 长城久惠灵活配置混合型基金暂停大额申购、转换转入和定投业务的公告 | 证券时报及本基金管理人网站 | 2019 年 8 月 30 日 |
| 27 | 长城久惠灵活配置混合型基金调 | 证券时报及本基金 | 2019 年 9 月 9 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 整大额申购、转换转入和定投业务限额的公告 | 管理人网站 | |
| 28 | 长城基金管理有限公司关于提醒客户更新、完善身份信息的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 10 月 28 日 |
| 29 | 长城基金管理有限公司关于参加微众银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 11 月 11 日 |
| 30 | 关于长城久惠灵活配置混合型证券投资基金调整基金费用并相应修改基金合同部分条款的公告 | 证券时报及本基金管理人网站 | 2019 年 12 月 4 日 |
| 31 | 关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改长城久惠基金合同及托管协议的公告 | 证券时报及本基金管理人网站 | 2019 年 12 月 4 日 |
| 32 | 长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 12 月 31 日 |
| 33 | 长城基金管理有限公司关于参加昆仑银行费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站 | 2019 年 12 月 31 日 |

# §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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。 |

# §13 备查文件目录

## 13.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准长城久惠灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

（二）《长城久惠灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

（三）《长城久惠灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

（七）中国证监会规定的其他文件

## 13.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 13.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn