

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金  
证券投资基金（原长城创新动力灵活配  
置混合型证券投资基金基金转型）  
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金报告期自 2019 年 01 月 29 日起至 06 月 30 日止，原长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 01 月 28 日止。

根据 2019 年 1 月 17 日生效的基金份额持有人大会决议，自 2019 年 1 月 29 日起，本基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。详见 2019 年 1 月 29 日登载于本基金管理人网站的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》，变更后的基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	12
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b>	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.8 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	19
<b>§5 托管人报告</b>	20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	20
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	20
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	20
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）</b>	21
6.1 资产负债表	21
6.2 利润表	22
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
6.4 报表附注	24
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）</b>	49
6.1 资产负债表	49
6.2 利润表	50
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	51
6.4 报表附注	52
<b>§7 投资组合报告（转型后）</b>	71
7.1 期末基金资产组合情况	71
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	71
7.3 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	73

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
7.6 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.....	77
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	77
7.8 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.....	78
7.9 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.....	78
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
7.12 投资组合报告附注.....	79
<b>§7 投资组合报告（转型前）.....</b>	<b>81</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	81
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	81
7.3 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.....	82
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	82
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	84
7.6 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.....	84
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	84
7.8 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.....	84
7.9 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.....	84
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	84
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	85
7.12 投资组合报告附注.....	85
<b>§8 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>	<b>87</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	87
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	87
8.3 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.....	88
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	88
<b>§8 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>	<b>89</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	89
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	89
8.3 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.....	89
<b>§9 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>90</b>
<b>§9 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>91</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>92</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	92
10.2 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.....	92
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	92
10.4 基金投资策略的改变.....	92
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	93
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	93
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	93
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....	94
10.9 其他重大事件（转型后）.....	95
10.9 其他重大事件（转型前）.....	98
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>100</b>

---

11.1 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.....	100
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	100
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>101</b>
12.1 备查文件目录.....	101
12.2 存放地点.....	101
12.3 查阅方式.....	101

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长城创业板指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	长城创业板指数增强发起式	
基金主代码	001879	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	77,777,120.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	001879	006928
报告期末下属分级基金的份额总额	58,073,720.49 份	19,703,399.57 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长城创新动力混合	
基金主代码	001879	
交易代码	001879	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 6 月 1 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	33,882,943.85 份	
基金合同存续期	20 个月	

注：本基金于 2019 年 01 月 29 日转型，该日起长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以创业板指数作为目标

	指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。
业绩比较基准	创业板指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金重点投资于经济发展过程中具备持续增长潜力，能够代表经济发展方向的行业龙头企业，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。</p> <p>本基金创新动力主题包括新兴产业的创新和传统产业的升级两个方面。其中，新兴产业的创新主要包括新产业、新科技和新的商业模式；传统产业的升级主要包括三个层面：一是通过对传统行业进行技术改造、组织架构和治理结构调整、资产梳理与整合而实现更高效、更环保、更集约、更有竞争力的生产与经营；二是通过创新，尤其是信息技术的应用，使得在传统行业中产生新的业态；三是传统行业主动寻求变革，向新兴行业转型。</p>
业绩比较基准	50% $\times$ 中证 800 指数收益率 + 50% $\times$ 中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。

注：本基金于 2019 年 01 月 29 日转型，该日起长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。

## 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		长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	郭明
	联系电话	0755-23982338	010-66105798
	电子邮箱	che.jun@ccfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95588
传真		0755-23982328	010-66105799
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518026	100140
法定代表人		王军	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.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
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 40、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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标		2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C	
本期已实现收益	4,290,705.89	948,517.82	
本期利润	7,099,081.67	-195,789.18	
加权平均基金份额本期利润	0.1403	-0.0125	
本期加权平均净值利润率	13.14%	-1.16%	
本期基金份额净值增长率	23.08%	22.65%	
3.1.2 期末数据和指标		2019 年 6 月 30 日	
期末可供分配利润	3,698,254.06	-1,006,983.11	
期末可供分配基金份额利润	0.0637	-0.0511	
期末基金资产净值	62,113,333.46	21,000,249.26	
期末基金份额净值	1.0696	1.0658	
3.1.3 累计期末指标		2019 年 6 月 30 日	
基金份额累计净值增长率	23.08%	22.65%	

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。

④本基金转型日期为 2019 年 01 月 29 日，截止本报告期末，基金转型未满半年。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日	
本期已实现收益		7,510.32	
本期利润		36,418.83	
加权平均基金份额本期利润		0.0011	
本期加权平均净值利润率		0.12%	
本期基金份额净值增长率		0.12%	
3.1.2 期末数据和指标		2019 年 1 月 28 日	
期末可供分配利润		10,566.52	
期末可供分配基金份额利润		0.0003	
期末基金资产净值		29,445,240.89	

期末基金份额净值	0.8690
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2019 年 1 月 28 日
基金份额累计净值增长率	-13.10%

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（转型后）

#### 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

长城创业板指数增强发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.85%	1.44%	1.79%	1.40%	1.06%	0.04%
过去三个月	-5.75%	1.80%	-10.19%	1.85%	4.44%	-0.05%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	23.08%	1.93%	19.03%	2.00%	4.05%	-0.07%

长城创业板指数增强发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.81%	1.44%	1.79%	1.40%	1.02%	0.04%
过去三个月	-6.01%	1.80%	-10.19%	1.85%	4.18%	-0.05%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	22.65%	1.94%	19.03%	2.00%	3.62%	-0.06%

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：①本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。
- ②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。
- ③基金转型日期为 2019 年 1 月 29 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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
过去一个月	—	—	—	—	—	—
过去三个月	—	—	—	—	—	—
过去六个月	0.12%	0.11%	2.91%	0.49%	-2.79%	-0.38%
过去一年	-10.73%	1.01%	-3.22%	0.71%	-7.51%	0.30%
过去三年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起 2019 年 1 月 28 日	-13.10%	1.05%	-1.53%	0.56%	-11.57%	0.49%

### 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

长城创新动力混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势  
对比图



注：①本基金合同规定本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%–95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

③自 2019 年 1 月 29 日起，由《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

## § 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、资产管理与中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有：长城品牌优选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)、长城安心回报混合型证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、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、长城久嘉创新成长灵活配置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、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、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、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、长城久惠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、长城久鼎保本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、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
雷俊	量化与指数投资部总经理，长城中证500指数增强型、长城久泰沪深300指数、长城创业板指数、长城核心优选混合、长城量化精选股票的基金经理	2019年1月29日	-	11年	北京大学理学学士、工学硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017年11月进入长城基金管理有限公司，现任量化与指数投资部总经理。

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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
赵波	长城景气行业龙头混合、长城改革红利混合、长城转型成长混合、长城创新动力混合和长城久鑫混合的基金	2017年6月1日	2019年1月29日	11年	男，伦敦大学皇家霍洛威学院理学学士、英国城市大学卡斯商学院理学硕士、中国社会科学院经济学博士。曾就职于中银国际证券有限责任公司。2011年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城品牌优选股票型证券投资基金”基金经理助理和“长城双动力混合型证券投资基金”的基金经理。

	经理				
张捷	长城创新 动力混 合、长 城优化升 级混合、长 城稳健成 长混合的 基金经理	2018年3月8 日	2019年1月29日	10年	英国中央兰开夏大学工学学士、英国伦敦帝国理工大学理学硕士。曾就职于平安集团、柏坊资产管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司。2014年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城安心回报混合型证券投资基金”的基金经理助理。

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》、《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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。

### 4.3.2 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

上半年 A 股波动较去年明显放大，在一季度单边上涨后二季度开始调整，A 股市场窄幅震荡；但市场关注点聚焦上市公司基本面，好公司涨幅较大。

报告期内本基金转型为创业板指数增强基金，转型后基金采取了快速高效的建仓策略，产品运作坚持指数价值增强的投资风格，获取价值回归与业绩驱动下的长期超额回报，报告期内相对基准超额收益明显。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子模型，基于上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；在组合层面上，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，转型前长城创新动力混合净值增长率为 0.12%，业绩比较基准收益率为 2.91%；转型后长城创业板指数增强发起式 A 级净值增长率为 23.08%，长城创业板指数增强发起式 C 级净值增长率为 22.65%，同期业绩比较基准收益率为 19.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一方面由于中美贸易摩擦的长期性，下半年的经济走势也有很大的不确定性，未来短期一段时间继续震荡的可能性更大，上涨和下跌的空间都比较有限，基本面优质的个股有结构性的机会；另一方面，随着逐渐与国际市场接轨，增量的海外资金配置需求增大，从更长的周期看，A 股的长期投资价值凸现，中长期有很大的投资机会。

本基金在投资运作时将继续坚持定量化指数增强投资风格，力争在保持较低跟踪误差的同时获取更大的超额回报。

#### 4.6 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评估委员会，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评估委员会。受托资产评估委员会负责制定、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。受托资产评估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，向受托资产评估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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金自 2019 年 01 月 29 日起至 2019 年 03 月 04 日止连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国工商银行股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的管理人——长城基金管理有限公司在长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，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

本托管人依法对长城基金管理有限公司编制和披露的长城创业板指数增强型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,357,314.50
结算备付金		530,084.95
存出保证金		44,905.08
交易性金融资产	6.4.7.2	81,716,071.74
其中：股票投资		78,718,471.74
基金投资		—
债券投资		2,997,600.00
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		1,553,072.68
应收利息	6.4.7.5	31,941.51
应收股利		—
应收申购款		278,738.44
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		85,512,128.90
<b>负债和所有者权益</b>	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>负债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		1,023,870.52
应付赎回款		1,195,122.55
应付管理人报酬		67,407.20
应付托管费		10,111.06
应付销售服务费		5,317.44

应付交易费用	6.4.7.7	63,272.47
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	33,444.94
负债合计		2,398,546.18
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	77,777,120.06
未分配利润	6.4.7.10	5,336,462.66
所有者权益合计		83,113,582.72
负债和所有者权益总计		85,512,128.90

注：①报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长城创业板指数增强发起式 A 基金份额净值 1.0696 元，基金份额总额 58,073,720.49 份，长城创业板指数增强发起式 C 基金份额净值 1.0658 元，基金份额总额 19,703,399.57 份。

②本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

## 6.2 利润表

会计主体：长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
<b>一、收入</b>		7,591,081.93
1. 利息收入		28,745.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,069.91
债券利息收入		13,675.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,633,627.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,217,495.40
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-55.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-

股利收益	6.4.7.16	416,188.02
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,664,068.78
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	264,640.10
<b>减: 二、费用</b>		687,789.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	291,018.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,652.59
3. 销售服务费		20,613.21
4. 交易费用	6.4.7.19	304,463.22
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	28,042.18
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		6,903,292.49
<b>减: 所得税费用</b>		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		6,903,292.49

注: 本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效, 本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止。因此, 无上年度可比期间财务数据。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 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)	33,882,943.85	-4,437,702.96	29,445,240.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,903,292.49	6,903,292.49
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)	43,894,176.21	2,870,873.13	46,765,049.34
其中: 1. 基金申购款	134,464,132.91	12,846,901.03	147,311,033.94
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-90,569,956.70	-9,976,027.90	-100,545,984.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值	-	-	-

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	77,777,120.06	5,336,462.66	83,113,582.72

注：本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)，是根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2018年11月16日证监许可[2018]1896号文“关于准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复”及长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2019年1月17日决议通过的《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，由长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2048号文“关于准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”以及中国证监会机构部函[2017]878号文“关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函”的核准，由长城基金管理有限公司自2017年4月27日至2017年5月25日向社会公开募集，并向中国证监会报送基金备案材料。首次设立募集的规模为398,108,405.90份基金份额。长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于2019年1月17日表决通过了《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《长城创新动力灵活配置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公告》及《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的公告》，自2019年1月29日起，“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金”正式转型为“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”，转型后的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金

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，基金托管人为中国工商银行。

本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，其中，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。转型后，原长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额转为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金 A 类基金份额。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货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：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。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：创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 6.4.2 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管理业务的指导意见》、《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 3 号《半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〈年度报告和半年度报告〉》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。

#### 6.4.3 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 06 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 01 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本会计期间为 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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。

#### **6.4.4.4 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。

#### **6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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)”。

#### **6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

- (1)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)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

- (1)在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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两种：现金分红与红利再投资，投资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；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (3)基金收益分配后各类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；
- (4)本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的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。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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

目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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	1,357,314.50
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：	1,357,314.50

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	77,029,686.99	78,718,471.74	1,688,784.75
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,994,600.00	3,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,994,600.00	3,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	80,024,286.99	81,716,071.74	1,691,784.75

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	355.31
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	238.60
应收债券利息	31,327.40
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	20.20
合计	31,941.51

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	63,272.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	63,272.47

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	517.93
预提费用	19,415.90
应付指数使用费	13,511.11
合计	33,444.94

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 A

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	33,882,943.85	33,882,943.85
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
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	-	-
本期申购	76,603,341.11	76,603,341.11
本期赎回(以"-"号填列)	-52,412,564.47	-52,412,564.47
本期末	58,073,720.49	58,073,720.49

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
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	-	-
本期申购	57,860,791.80	57,860,791.80
本期赎回(以"-"号填列)	-38,157,392.23	-38,157,392.23
本期末	19,703,399.57	19,703,399.57

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-1,001,671.71	-3,436,031.25	-4,437,702.96
本期利润	4,290,705.89	2,808,375.78	7,099,081.67
本期基金份额交易产生的变动数	409,219.88	969,014.38	1,378,234.26
其中：基金申购款	2,249,106.51	5,088,802.92	7,337,909.43
基金赎回款	-1,839,886.63	-4,119,788.54	-5,959,675.17
本期已分配利润	-	-	-

本期末	3,698,254.06	341,358.91	4,039,612.97
-----	--------------	------------	--------------

金额单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	948,517.82	-1,144,307.00	-195,789.18
本期基金份额交易产生的变动数	-1,955,500.93	3,448,139.80	1,492,638.87
其中：基金申购款	-4,623,357.32	10,132,348.92	5,508,991.60
基金赎回款	2,667,856.39	-6,684,209.12	-4,016,352.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,006,983.11	2,303,832.80	1,296,849.69

#### 6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
活期存款利息收入	12,022.38
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	2,790.68
其他	256.85
合计	15,069.91

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
卖出股票成交总额	130,730,195.55
减：卖出股票成本总额	125,512,700.15
买卖股票差价收入	5,217,495.40

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日至2019年6月30日
----	-----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,949.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,000.00
减：应收利息总额	5.57
买卖债券差价收入	-55.97

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	416,188.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	416,188.02

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,664,068.78
——股票投资	1,661,068.78
——债券投资	3,000.00
——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	1,664,068.78

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
基金赎回费收入	263,258.70
转出基金补偿收入	1,381.40
合计	264,640.10

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
交易所市场交易费用	304,463.22
银行间市场交易费用	—
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	304,463.22

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	17,114.58
信息披露费	-3,835.72
银行费用	1,252.21
指数使用费	13,511.11
合计	28,042.18

注：信息披露费为负数为冲销已计提的减免信息披露费。

#### 6.4.7.21 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。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金本报告期无与对本基金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。

##### 6.4.9.2 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
中国工商银行	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、基金销售机构

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。

#### 6.4.10 本报告期的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	20,566,357.26	13.27%
东方证券	310,278,058.07	86.73%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长城证券	3,053,206.86	100.00%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期未通过关联交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30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
长城证券	19,153.53	13.27%	15,445.02	24.41%
东方证券	125,226.84	86.73%	47,827.45	75.59%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	291,018.24
其中：支付销售机构的客 户维护费	104,215.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	43,652.59

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.2.3 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1月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
长城基金	-	3.00	3.00
合计	-	3.00	3.00

注：1) 销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务等。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期

	2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
基金合同生效日持有的基金份额	11,534,202.33	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	11,534,202.33	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.8298%	-

#### 6.4.10.4.2 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。本基金基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.5 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 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	当期利息收入
中国工商银行	1,357,314.50	12,022.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流通	流通受限	认购	期末估值	数量	期末	期末	说明

代码	名称	认购日	日	类型	价格	单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.12.17 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

#### 6.4.12.18 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.18.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2019 年 06 月 30 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，无质押证券。

##### 6.4.12.18.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2019 年 06 月 30 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为 0.00 元，无质押证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 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
<b>资产</b>							
银行存款	1,357,314.50	-	-	-	-	-	1,357,314.50
结算备付金	530,084.95	-	-	-	-	-	530,084.95
存出保证金	44,905.08	-	-	-	-	-	44,905.08
交易性金融资产	-	-2,997,600.00		-	-78,718,471.74	81,716,071.74	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,553,072.68	1,553,072.68
应收利息	-	-	-	-	-	31,941.51	31,941.51
应收申购款	-	-	-	-	-	278,738.44	278,738.44
<b>资产总计</b>	<b>1,932,304.53</b>	<b>-2,997,600.00</b>		<b>-</b>	<b>-80,582,224.37</b>	<b>85,512,128.90</b>	
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,023,870.52	1,023,870.52
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,195,122.55	1,195,122.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,407.20	67,407.20
应付托管费	-	-	-	-	-	10,111.06	10,111.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,317.44	5,317.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	63,272.47	63,272.47
其他负债	-	-	-	-	-	33,444.94	33,444.94
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>		<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,398,546.18</b>	<b>2,398,546.18</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,932,304.53</b>	<b>-2,997,600.00</b>		<b>-</b>	<b>-</b>		

##### 6.4.13.4.1.2 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 6 月 30 日）

	利率上升 25 个基点	-4,106.32
	利率下降 25 个基点	4,117.60

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。本基金转型日为 2019 年 1 月 29 日，无上年度末比较数据。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 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	78,718,471.74	94.71
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,997,600.00	3.61
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	81,716,071.74	98.32
----	---------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 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6月30日）
	沪深300指数上升5%	3,918,605.52
	沪深300指数下降5%	-3,918,605.52

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。本基金转型日为2019年1月29日，无上年度末比较数据。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、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06月30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78,695,365.14元，划分为第二层次的余额为人民币3,020,706.60元，无划分为第三层次余额。

###### 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归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期末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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 1 月 28 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年1月28日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	26, 569, 972. 12	17, 344, 979. 95
结算备付金		298, 279. 84	180, 491. 34
存出保证金		27, 377. 38	28, 163. 39
交易性金融资产	6.4.7.2	2, 160, 700. 00	1, 570, 490. 00
其中：股票投资		2, 160, 700. 00	1, 570, 490. 00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	11, 000, 000. 00
应收证券清算款		534, 839. 29	10, 854. 49
应收利息	6.4.7.5	19, 615. 01	3, 462. 66
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29, 610, 783. 64	30, 138, 441. 83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年1月28日	上年度末 2018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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	373, 523. 11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33, 944. 45	35, 987. 52
应付托管费		5, 657. 40	5, 997. 93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9, 803. 86	91, 852. 87
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,137.04	130,000.00
负债合计		165,542.75	637,361.43
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	33,882,943.85	33,989,174.66
未分配利润	6.4.7.10	-4,437,702.96	-4,488,094.26
所有者权益合计		29,445,240.89	29,501,080.40
负债和所有者权益总计		29,610,783.64	30,138,441.83

注：①报告截止日 2019 年 1 月 28 日（基金合同失效前日），基金份额净值人民币 0.8690 元，基金份额总额 29,445,240.89 份。

②自 2019 年 1 月 29 日起，由《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效。

## 6.2 利润表

会计主体：长城创新动力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 1 月 28 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		138,010.02	-2,283,248.07
1. 利息收入		24,126.60	37,278.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,409.90	37,278.45
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,716.70	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		84,963.98	-1,495,607.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	84,963.98	-1,611,881.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	116,274.53
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.17	28,908.51	-1,423,115.98
4. 汇兑收益(损失以“-”号填		-	-

列)			
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	10.93	598,196.51
<b>减: 二、费用</b>		101,591.19	771,031.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,944.45	222,345.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,657.40	37,057.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,763.30	455,269.68
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	46,226.04	56,358.72
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		36,418.83	-3,054,279.07
<b>减: 所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		36,418.83	-3,054,279.07

注: 2019年1月28日为基金合同失效前日,本期是指2019年1月1日至2019年1月28日,上年度可比期间是指2018年1月1日至2018年6月30日。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长城创新动力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1月28日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月28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)	33,989,174.66	-4,488,094.26	29,501,080.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,418.83	36,418.83
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)	-106,230.81	13,972.47	-92,258.34
其中: 1. 基金申购款	5,920.93	-779.55	5,141.38
2. 基金赎回款	-112,151.74	14,752.02	-97,399.72
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)	33,882,943.85	-4,437,702.96	29,445,240.89
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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)	28,792,124.37	2,321,621.03	31,113,745.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,054,279.07	-3,054,279.07
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)	-4,888,041.09	97,878.62	-4,790,162.47
其中：1. 基金申购款	83,099,944.09	-131,187.16	82,968,756.93
2. 基金赎回款	-87,987,985.18	229,065.78	-87,758,919.40
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)	23,904,083.28	-634,779.42	23,269,303.86

注：2019年1月28日为基金合同失效前日，本期是指2019年1月1日至2019年1月28日，上年度可比期间是指2018年1月1日至2018年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2048号文“关于准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”以及中国证监会机构部函[2017]878号文“关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函”的核准，由长城基金管理有限公司自2017年4月27日至2017年5月25日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字第60737541\_H03号验资报告后，向中国证监会报送基金

备案材料。基金合同于 2017 年 6 月 1 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币 398,025,038.37 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 83,367.53 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 398,108,405.90 元，折合 398,108,405.90 份基金份额。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

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)。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%–95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。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： $50\% \times \text{中证}800 \text{ 指数收益率} + 50\% \times \text{中债综合财富指数收益率}$ 。

#### 6.4.2 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》、《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 3 号《半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<年度报告和半年度报告>》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。

#### 6.4.3 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 1 月 28 日(基金

合同失效前日)的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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、地方政府债券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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 28 日
活期存款	26,569,972.12
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：	26,569,972.12

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 28 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	2,132,984.03	2,160,700.00	27,715.97
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	2,132,984.03	2,160,700.00	27,715.97

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末各项买入返售金融资产余额均为零。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月28日
应收活期存款利息	19,111.78
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	454.48
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	48.75
合计	19,615.01

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月28日
交易所市场应付交易费用	9,803.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,803.86

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年1月28日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	116,137.04
合计	116,137.04

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月28日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	33,989,174.66	33,989,174.66
本期申购	5,920.93	5,920.93
本期赎回(以“-”号填列)	-112,151.74	-112,151.74
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	33,882,943.85	33,882,943.85

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 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	-1,012,238.23	-3,475,856.03	-4,488,094.26
本期利润	7,510.32	28,908.51	36,418.83
本期基金份额交易产生的变动数	3,056.20	10,916.27	13,972.47
其中：基金申购款	-172.97	-606.58	-779.55
基金赎回款	3,229.17	11,522.85	14,752.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,001,671.71	-3,436,031.25	-4,437,702.96

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日
活期存款利息收入	13,009.96
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	365.16
其他	34.78
合计	13,409.90

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日
卖出股票成交总额	5,025,353.90
减：卖出股票成本总额	4,940,389.92
买卖股票差价收入	84,963.98

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期未发生债券投资收益/损失。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 1 月 28 日
1. 交易性金融资产	28,908.51

——股票投资	28,908.51
——债券投资	-
——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	28,908.51

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月28日
基金赎回费收入	10.93
合计	10.93

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月28日
交易所市场交易费用	15,763.30
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	15,763.30

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年1月28日
审计费用	2,301.32
信息披露费	3,835.72
银行费用	89.00
律师费	33,333.36
公证费	6,666.64

合计	46,226.04
----	-----------

#### 6.4.7.21 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。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金本报告期无与对本基金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。

##### 6.4.9.2 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
中国工商银行	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年1月28日	2018年1月1日至2018年6月30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
东方证券	6,308,758.00	59.93%	167,492,307.20	56.26%
长城证券	4,218,287.31	40.07%	130,244,350.19	43.74%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年1月28日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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
长城证券	-	-	6,999,993.00	100.00%

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年1月28日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	55,000,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年1月28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	5,875.43	59.93%	5,875.43	59.93%
长城证券	3,928.43	40.07%	3,928.43	40.07%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	155,985.64	56.26%	107,603.06	60.24%
长城证券	121,296.63	43.74%	71,013.62	39.76%

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1 月28日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	33,944.45	222,345.10
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	10,190.24	93,051.71

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年1 月28日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,657.40	37,057.50

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

项目	本期 2019年1月1日至2019年1月28日	份额单位：份	
		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—
期初持有的基金份额	11,534,202.33	—	—
期间申购/买入总份额	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—
期末持有的基金份额	11,534,202.33	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.0413%	—	—

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方 名称	本期 2019年1月1日至2019年1月28日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	26,569,972.12	13,009.96	31,497,695.18	35,465.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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的证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 1 月 28 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 1 月 28 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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 1 月 28 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为 0.00 元，无质押证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

##### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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、债券投资及买入返售金融资产等。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年1月28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
<b>资产</b>							
银行存款	26,569,972.12	-	-	-	-	-	26,569,972.12
结算备付金	298,279.84	-	-	-	-	-	298,279.84
存出保证金	27,377.38	-	-	-	-	-	27,377.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,160,700.00	2,160,700.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	534,839.29	534,839.29
应收利息	-	-	-	-	-	19,615.01	19,615.01
<b>资产总计</b>	<b>26,895,629.34</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,715,154.30</b>	<b>29,610,783.64</b>
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,944.45	33,944.45
应付托管费	-	-	-	-	-	5,657.40	5,657.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,803.86	9,803.86
其他负债	-	-	-	-	-	116,137.04	116,137.04
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>165,542.75</b>	<b>165,542.75</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>26,895,629.34</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
上年度末 2018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
<b>资产</b>							
银行存款	17,344,979.95	-	-	-	-	-	17,344,979.95
结算备付金	180,491.34	-	-	-	-	-	180,491.34
存出保证金	28,163.39	-	-	-	-	-	28,163.39
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,570,490.00	1,570,490.00
买入返售金融资产	11,000,000.00	-	-	-	-	-	11,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,854.49	10,854.49
应收利息	-	-	-	-	-	3,462.66	3,462.66
<b>资产总计</b>	<b>28,553,634.68</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,584,807.15</b>	<b>30,138,441.83</b>
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	373,523.11	373,523.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,987.52	35,987.52

应付托管费	-	-	-	-	-	5,997.93	5,997.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	91,852.87	91,852.87
其他负债	-	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	637,361.43	637,361.43
利率敏感度缺口	28,553,634.68	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

于本报告期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 1 月 28 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	2,160,700.00	7.34	1,570,490.00	5.32

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	2,160,700.00	7.34	1,570,490.00	5.32

#### 6.4.13.4.3.2 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1月28日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深300指数上升5%	123,462.40	91,221.91
	沪深300指数下降5%	-123,462.40	-91,221.91

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 2. 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、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01月28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2,160,700.00元，无划分为第二、第三层次余额。

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归属于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。

## § 7 投资组合报告（转型后）

### 7.1 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	78,718,471.74	92.06
	其中：股票	78,718,471.74	92.06
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,997,600.00	3.51
	其中：债券	2,997,600.00	3.51
	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	1,887,399.45	2.21
8	其他各项资产	1,908,657.71	2.23
9	合计	85,512,128.90	100.00

### 7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,455,788.00	10.17
B	采矿业	—	—
C	制造业	29,752,028.46	35.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,736,415.86	17.73
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—

L	租赁和商务服务业	2, 192, 645. 00	2. 64
M	科学、研究和技术服务业	2, 265, 840. 00	2. 73
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	6, 354, 679. 96	7. 65
R	文化、体育和娱乐业	4, 946, 433. 62	5. 95
S	综合	-	-
	合计	68, 703, 830. 90	82. 66

### 7.2.2 期末积极投资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	3, 672. 00	0. 00
C	制造业	4, 593, 577. 89	5. 53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4, 075, 503. 81	4. 90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学、研究和技术服务业	1, 297, 251. 85	1. 56
N	水利、环境和公共设施管理业	21, 528. 69	0. 03
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	23, 106. 60	0. 03
S	综合	-	-
	合计	10, 014, 640. 84	12. 05

## 7.2 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

### 7.2.1 期末指数投资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	300498	温氏股份	235,800	8,455,788.00	10.17
2	300015	爱尔眼科	186,268	5,768,719.96	6.94
3	300450	先导智能	152,700	5,130,720.00	6.17
4	300003	乐普医疗	216,984	4,994,971.68	6.01
5	300383	光环新网	279,700	4,690,569.00	5.64
6	300207	欣旺达	362,500	4,176,000.00	5.02
7	300413	芒果超媒	73,464	3,015,697.20	3.63
8	300059	东方财富	216,092	2,928,046.60	3.52
9	300296	利亚德	330,700	2,589,381.00	3.12
10	300212	易华录	94,080	2,304,960.00	2.77
11	300012	华测检测	209,800	2,265,840.00	2.73
12	300168	万达信息	173,100	2,245,107.00	2.70
13	300058	蓝色光标	513,500	2,192,645.00	2.64
14	300078	思创医惠	211,000	2,154,310.00	2.59
15	300294	博雅生物	79,000	2,144,850.00	2.58
16	300699	光威复材	57,600	1,883,520.00	2.27
17	300750	宁德时代	23,500	1,618,680.00	1.95
18	300271	华宇软件	80,270	1,525,130.00	1.83
19	300122	智飞生物	34,300	1,478,330.00	1.78
20	300014	亿纬锂能	39,500	1,203,170.00	1.45
21	300027	华谊兄弟	198,100	972,671.00	1.17
22	300144	宋城演艺	41,403	958,065.42	1.15
23	300226	上海钢联	9,100	682,136.00	0.82
24	300347	泰格医药	7,600	585,960.00	0.71
25	300024	机器人	33,528	510,631.44	0.61
26	300285	国瓷材料	28,950	492,439.50	0.59
27	300408	三环集团	22,121	430,253.45	0.52
28	300253	卫宁健康	25,400	360,172.00	0.43
29	300146	汤臣倍健	17,300	335,620.00	0.40
30	300316	晶盛机电	25,817	327,617.73	0.39
31	300073	当升科技	9,900	227,403.00	0.27
32	300628	亿联网络	500	53,535.00	0.06
33	300124	汇川技术	26	595.66	0.00

34	300098	高新兴	37	295.26	0.00
----	--------	-----	----	--------	------

### 7.2.2 期末积极投资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	600570	恒生电子	36,390	2,479,978.50	2.98
2	300149	量子生物	85,615	1,297,067.25	1.56
3	300118	东方日升	122,600	1,248,068.00	1.50
4	603660	苏州科达	78,258	1,220,042.22	1.47
5	300458	全志科技	50,200	1,049,180.00	1.26
6	300451	创业慧康	56,400	843,180.00	1.01
7	300300	汉鼎宇佑	57,000	591,660.00	0.71
8	300175	朗源股份	60,400	352,736.00	0.42
9	300130	新国都	20,000	318,000.00	0.38
10	300129	泰胜风能	60,300	252,657.00	0.30
11	300559	佳发教育	3,600	85,356.00	0.10
12	300349	金卡智能	4,200	74,676.00	0.09
13	300782	卓胜微	520	56,638.40	0.07
14	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.04
15	300205	天喻信息	1,900	28,424.00	0.03
16	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.03
17	002157	正邦科技	1,300	21,658.00	0.03
18	300388	国祯环保	2,283	21,528.69	0.03
19	300567	精测电子	98	5,146.96	0.01
20	300502	新易盛	200	4,904.00	0.01
21	300341	麦克奥迪	800	4,320.00	0.01
22	300483	沃施股份	100	3,672.00	0.00
23	300369	绿盟科技	51	653.31	0.00
24	300284	苏交科	20	184.60	0.00

### 7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300498	温氏股份	10,323,355.70	12.42
2	300413	芒果超媒	7,498,367.88	9.02
3	300059	东方财富	7,450,345.64	8.96
4	300383	光环新网	6,797,827.46	8.18
5	300003	乐普医疗	6,471,201.60	7.79
6	300024	机器人	6,423,597.06	7.73
7	300408	三环集团	6,345,104.00	7.63
8	300124	汇川技术	5,843,514.24	7.03
9	300015	爱尔眼科	5,822,336.48	7.01
10	300450	先导智能	5,464,011.94	6.57
11	300271	华宇软件	5,408,267.60	6.51
12	300207	欣旺达	5,321,317.00	6.40
13	300226	上海钢联	4,717,111.00	5.68
14	300014	亿纬锂能	4,085,811.30	4.92
15	300294	博雅生物	4,041,426.00	4.86
16	600570	恒生电子	4,041,355.20	4.86
17	300347	泰格医药	3,824,836.00	4.60
18	300699	光威复材	3,740,266.19	4.50
19	603660	苏州科达	3,738,031.66	4.50
20	300133	华策影视	3,629,159.00	4.37
21	300122	智飞生物	3,613,679.00	4.35
22	300012	华测检测	3,596,554.75	4.33
23	300058	蓝色光标	3,436,148.00	4.13
24	300098	高新兴	3,023,364.66	3.64
25	300316	晶盛机电	2,868,369.00	3.45
26	300144	宋城演艺	2,730,887.00	3.29
27	300251	光线传媒	2,625,764.00	3.16
28	300296	利亚德	2,600,033.00	3.13
29	300168	万达信息	2,534,628.00	3.05
30	300212	易华录	2,469,044.81	2.97
31	300078	思创医惠	2,422,752.00	2.91
32	300253	卫宁健康	2,238,812.00	2.69
33	300511	雪榕生物	2,185,765.00	2.63
34	300027	华谊兄弟	2,095,186.06	2.52

35	300149	量子生物	1, 848, 228. 00	2. 22
36	603363	傲农生物	1, 798, 261. 00	2. 16
37	300458	全志科技	1, 777, 215. 00	2. 14

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。

### 7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300024	机器人	6, 474, 101. 30	7. 79
2	300408	三环集团	5, 995, 764. 47	7. 21
3	300124	汇川技术	5, 413, 508. 00	6. 51
4	300413	芒果超媒	4, 703, 139. 60	5. 66
5	300271	华宇软件	4, 462, 168. 00	5. 37
6	300059	东方财富	4, 193, 115. 06	5. 05
7	300226	上海钢联	4, 141, 011. 00	4. 98
8	300347	泰格医药	3, 941, 972. 00	4. 74
9	300133	华策影视	3, 527, 292. 34	4. 24
10	300014	亿纬锂能	3, 439, 526. 00	4. 14
11	300098	高新兴	3, 091, 009. 01	3. 72
12	603660	苏州科达	2, 564, 433. 40	3. 09
13	300498	温氏股份	2, 535, 747. 00	3. 05
14	300251	光线传媒	2, 475, 395. 00	2. 98
15	300122	智飞生物	2, 455, 363. 00	2. 95
16	300316	晶盛机电	2, 197, 499. 19	2. 64
17	300383	光环新网	2, 046, 522. 00	2. 46
18	300511	雪榕生物	2, 044, 421. 00	2. 46
19	300144	宋城演艺	2, 000, 369. 29	2. 41
20	300012	华测检测	1, 859, 867. 00	2. 24
21	300294	博雅生物	1, 843, 720. 90	2. 22
22	300253	卫宁健康	1, 836, 817. 00	2. 21
23	300203	聚光科技	1, 803, 779. 00	2. 17
24	603363	傲农生物	1, 794, 260. 00	2. 16
25	300699	光威复材	1, 737, 121. 00	2. 09
26	002124	天邦股份	1, 681, 450. 22	2. 02

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。

### 7.3.3 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	200,409,403.11
卖出股票收入（成交）总额	130,730,195.55

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。

### 7.4 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	2,997,600.00	3.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,997,600.00	3.61

### 7.5 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	019611	19 国债 01	30,000	2,997,600.00	3.61
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

## 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.8 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。

## 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### 多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

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。

### 7.10.2 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。

### 7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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除芒果超媒发行主体外，其他证券的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。

根据湖南银保监局公布的行政处罚决定书：芒果超媒股份有限公司（简称芒果超媒）未按照规定设立专门账簿记载业务收支情况，欺骗保险人、投保人、被保险人或者受益人等违法违规行为，于 2018 年 12 月 26 日被湖南银保监局处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对芒果超媒进行了投资。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	44,905.08
2	应收证券清算款	1,553,072.68
3	应收股利	-
4	应收利息	31,941.51
5	应收申购款	278,738.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,908,657.71

#### **7.11.4 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。

#### **7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

##### **7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### **7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：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。

## § 7 投资组合报告（转型前）

### 7.1 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	2, 160, 700. 00	7. 30
	其中：股票	2, 160, 700. 00	7. 30
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	26, 868, 251. 96	90. 74
8	其他资产	581, 831. 68	1. 96
9	合计	29, 610, 783. 64	100. 00

### 7.2 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	-	-
C	制造业	1, 001, 050. 00	3. 40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	804, 050. 00	2. 73
K	房地产业	183, 600. 00	0. 62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	172,000.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	2,160,700.00	7.34

### 7.3 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	600519	贵州茅台	400	270,800.00	0.92
1	601939	建设银行	40,000	270,800.00	0.92
2	600104	上汽集团	10,000	260,900.00	0.89
3	601818	光大银行	60,000	236,400.00	0.80
4	601128	常熟银行	33,000	210,870.00	0.72
5	600048	保利地产	15,000	183,600.00	0.62
6	300251	光线传媒	20,000	172,000.00	0.58
7	300078	思创医惠	20,000	169,400.00	0.58
8	000100	TCL 集团	60,000	164,400.00	0.56
9	300596	利安隆	5,000	135,550.00	0.46
10	600036	招商银行	3,000	85,980.00	0.29

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	600519	贵州茅台	468,794.00	1.59
2	300596	利安隆	381,283.00	1.29
3	000591	太阳能	328,500.00	1.11
4	603788	宁波高发	289,020.00	0.98
5	000539	粤电力A	287,154.00	0.97
6	601939	建设银行	270,800.00	0.92

7	002035	华帝股份	268,500.00	0.91
8	600104	上汽集团	244,618.01	0.83
9	601818	光大银行	233,400.00	0.79
10	000681	视觉中国	231,000.00	0.78
11	300078	思创医惠	186,352.00	0.63
12	000651	格力电器	186,000.00	0.63
13	600048	保利地产	179,850.00	0.61
14	300251	光线传媒	173,742.00	0.59
15	002531	天顺风能	172,000.00	0.58
16	601318	中国平安	170,130.00	0.58
17	000100	TCL 集团	161,400.00	0.55
18	603520	司太立	155,065.00	0.53
19	300253	卫宁健康	152,850.00	0.52
20	000625	长安汽车	148,600.00	0.50

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600588	用友网络	419,490.00	1.42
2	300271	华宇软件	317,989.00	1.08
3	000591	太阳能	311,000.00	1.05
4	603788	宁波高发	280,277.00	0.95
5	000539	粤电力 A	263,722.00	0.89
6	002035	华帝股份	260,100.00	0.88
7	000681	视觉中国	249,042.00	0.84
8	300596	利安隆	246,383.00	0.84
9	600036	招商银行	243,994.00	0.83
10	600519	贵州茅台	207,720.00	0.70
11	000651	格力电器	187,442.00	0.64
12	002531	天顺风能	182,244.00	0.62
13	000543	皖能电力	175,350.00	0.59
14	601318	中国平安	171,030.00	0.58
15	000063	中兴通讯	162,616.00	0.55
16	603520	司太立	157,765.90	0.53
17	300122	智飞生物	154,200.00	0.52
18	000625	长安汽车	154,000.00	0.52

19	300253	卫宁健康	153,750.00	0.52
20	300702	天宇股份	149,012.00	0.51

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	5,501,691.41
卖出股票收入（成交）总额	5,025,353.90

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货，本期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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除光大银行发行主体外，其他证券的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。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）于 2018 年 12 月 7 日公布的行政处罚信息公开表：中国光大银行股份有限公司（简称光大银行）因内控管理不严、违规经营等案由，于 2018 年 11 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。该行政处罚措施不影响公司的长期信用基本面，主体信用和债项信用资质均良好。基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对光大银行进行了投资。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	27,377.38
2	应收证券清算款	534,839.29

3	应收股利	-
4	应收利息	19,615.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	581,831.68

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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。

## § 8 基金份额持有人信息（转型后）

### 8.1 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 城 创 业 板 指 数 增 强 发 起 式 A	2,777	20,912.39	20,833,002.66	35.87%	37,240,717.83	64.13%
长 城 创 业 板 指 数 增 强 发 起 式 C	2,482	7,938.52	-	-	19,703,399.57	100.00%
合计	5,259	14,789.34	20,833,002.66	26.79%	56,944,117.40	73.21%

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 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	长城创业 板指数增 强发起式 A	131,272.57	0.2260%
	长城创业 板指数增 强发起式 C	12,818.08	0.0651%
	合计	144,090.65	0.1853%

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 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	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	长城创业板指数增强发起式 A	0
	长城创业板指数增强发起式 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城创业板指数增强发起式 A	0
	长城创业板指数增强发起式 C	0
	合计	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。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,534,202.33	14.83	11,534,202.33	14.83	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,534,202.33	14.83	11,534,202.33	14.83	3 年

## § 8 基金份额持有人信息（转型前）

### 8.1 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
351	96,532.60	11,534,202.33	34.04%	22,348,741.52	65.96%

### 8.2 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。

### 8.3 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。

## § 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	长城创业板指数增强 发起式 A	长城创业板指数增 强发起式 C
基金合同生效日基金份额总额	33,882,943.85	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	76,603,341.11	57,860,791.80
减:基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	52,412,564.47	38,157,392.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆 分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,073,720.49	19,703,399.57

## § 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	398,108,405.90
本报告期期初基金份额总额	33,989,174.66
本报告期期间基金总申购份额	5,920.93
减:本报告期期间基金总赎回份额	112,151.74
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	33,882,943.85

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人以通讯方式组织召开了长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，于 2019 年 1 月 17 日表决通过了《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》：长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。具体内容详见本管理人于 2019 年 1 月 18 日发布的《长城创新动力灵活配置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公告》及 2019 年 1 月 29 日发布的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》等法律文件。

### 10.2 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，沈阳女士担任长城基金管理有限公司副总经理，卢盛春先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2019 年 5 月 16 日起，赵建兴先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

#### 2、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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

根据 2019 年 1 月 17 日生效的长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议，自 2019 年 1 月 29 日起，长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金，基金的投资目标、投资范围、投资策略和风险收益特征等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。自 2019 年 1 月 29 日起，《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

### 10.7.1 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	
东方证券	1	1310,278,058.07	93.78%	125,226.84	86.73%	-
长城证券	1	20,566,357.26	6.22%	19,153.53	13.27%	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

截止本报告期末共计 2 个交易单元，均为新增交易单元。

### 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。

### 10.7.2 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	3,053,206.86	100.00%	-	-	-	-

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

#### 10.7.1 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	
东方证券	1	6,308,758.00	59.93%	5,875.43	59.93%	-
长城证券	1	4,218,287.31	40.07%	3,928.43	40.07%	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 2 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。

### 10.7.2 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	55,000,000.00	100.00%	-	-

### 10.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于长城创新动力灵活配置混合型基金转型为长城创业板指数增强型发起式基金的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2019年1月29日
2	长城创业板指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定投业务的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2019年1月29日
3	关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型后变更基金经理的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2019年1月30日
4	关于增加蚂蚁基金、汇成基金、肯特瑞、富济财富为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金代销机构的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2019年2月15日
5	长城基金管理有限公司关于参	中国证券报、上海证券	2019年2月22日

	加奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
6	长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“信威集团”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 2 月 22 日
7	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
8	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
9	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
10	关于参与工商银行基金申购费率优惠的公告	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 4 月 1 日
11	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
12	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	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

	方法的公告(格力电器)	券日报及本基金管理人网站	
13	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
14	长城基金管理有限公司关于变更公司副总经理的公告	证券日报及基金管理人网站	2019 年 4 月 4 日
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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）	证券日报及基金管理人网站	2019 年 5 月 17 日
20	长城基金关于增加华瑞保险销	中国证券报、上海证券	2019 年 5 月 24 日

	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	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
21	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
22	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 6 月 18 日
23	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
24	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
25	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

## 10.9 其他重大事件（转型前）

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	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 1 月 7 日

	务的公告	理人网站	
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	长城创新动力灵活配置混合型基金持有人大会表决结果暨决议生效公告	上海证券报及本基金管理人网站	2019 年 1 月 18 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20190101-20190307	11,534,202.33	-	-	11,534,202.33	14.8298%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

##### 1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

##### 2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20% 的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

##### 3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

##### 4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

##### 5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会许可长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的文件
2. 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会准予长城创业板指数增强型发起式证券投资基金变更注册的文件
5. 《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
6. 《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
7. 法律意见书
8. 基金管理人业务资格批件、营业执照
9. 基金托管人业务资格批件、营业执照
10. 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 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

### 12.3 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](http://www.ccfund.com.cn)