

信息披露

Disclosure

长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

本报告期末基金净值增长率为-4.38%，本基金业绩比较基准收益率为-7.00%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
本报告期内,本基金无需要说明的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	49,008,248.38	69.60
2	其中:股票	49,008,248.38	69.60
3	债券投资	5,501,660.00	6.83
4	其中:国债	5,501,660.00	6.83
5	资产支持证券	—	—
6	贵金属投资	—	—
7	金融衍生品投资	—	—
8	买入返售金融资产	23,000,000.00	27.53
9	其他资产	1,509,364.43	1.83
10	合计	82,381,202.81	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、渔业	2,369,672.00	2.94
B	矿业	2,629,590.00	3.29
C	制造业	20,526,800.00	27.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,346,360.00	5.65
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	1,649,540.00	1.96
J	金融业	10,400,000.00	12.86
K	房地产业	1,493,730.00	1.86
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	1,627,670.00	2.02
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	4,827,030.00	5.99
S	综合	—	—
合计		49,008,248.38	60.80

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002531	天顺风能	746,300	3,316,585.00	4.12
2	600567	中孚实业	141,300	3,244,260.00	4.03
3	200443	金诚信矿业	297,000	3,243,340.00	4.03
4	600027	华鲁恒升	694,300	2,622,020.00	3.28
5	601899	紫金矿业	790,400	2,620,300.00	3.26
6	300076	碧水源	247,000	2,496,134.24	3.08
7	300014	亿联网络	151,475	2,381,377.00	2.95
8	300468	华信新材	40,400	2,366,072.00	2.94
9	601222	安泰集团	362,000	1,762,000.00	2.17
10	000312	康缘药业	34,912	1,726,001.92	2.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	国债	—	—
B	金融债	—	—
C	制造业	2,148,006.72	0.18
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	—	—
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	—	—
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		2,148,006.72	0.18

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100432	10国债32	3,600,000	360,000,000.00	28.33
2	11180369	18国债09	1,800,000	177,210,000.00	14.26
3	11180216	18国债16	1,000,000	98,460,000.00	8.18
4	11181561	18国债61	1,000,000	98,460,000.00	8.26
5	11181266	18国债26	1,000,000	98,460,000.00	8.26
6	11181389	18国债39	1,000,000	98,320,000.00	8.27
7	11180276	18国债76	600,000	59,076,000.00	4.96
合计				1,509,364.43	1.11

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 本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进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除浦发银行、兴业银行两家发行主体外,其他证券的发行主体未被国家发展和改革委员会立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	11,023.34
2	应收证券清算款	10,256,864.82
3	应收股利	—
4	应收利息	19,126,464.62
5	其他应收款	1,400.26
6	其他流动资产	—
7	其他长期资产	—
8	其他	—
9	合计	19,697,274.07

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	003156	舜农生物	2,148,006.72	0.18	新股发行	

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除浦发银行、招商银行两家发行主体外,其他证券的发行主体未被国家发展和改革委员会立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	11,023.34
2	应收证券清算款	10,256,864.82
3	应收股利	—
4	应收利息	19,126,464.62
5	其他应收款	1,400.26
6	其他流动资产	—
7	其他长期资产	—
8	其他	—
9	合计	21,396,134.08

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	11180369	18国债09	3,600,000	273,112,000.00	19.29	
2	100329	10国债29	1,800,000	180,576,000.00	10.11	
3	11180216	18国债16	1,200,000	117,048,000.00	6.66	
4	11181267	18国债27	1,200,000	117,048,000.00	6.66	
5	100331	10国债31	1,000,000	100,200,000.00	5.40	
6	11180226	18国债26	1,000,000	97,540,000.00	6.86	

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除浦发银行、招商银行两家发行主体外,其他证券的发行主体未被国家发展和改革委员会立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	11,023.34
2	应收证券清算款	10,256,864.82
3	应收股利	—
4	应收利息	19,126,464.62
5	其他应收款	1,400.26
6	其他流动资产	—
7	其他长期资产	—
8	其他	—
9	合计	21,396,134.08

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	11180369	18国债09	3,600,000	273,112,000.00	19.29	
2	100329	10国债29	1,800,000	180,576,000.00	10.11	
3	11180216	18国债16	1,200,000	117,048,000.00	6.66	
4	11181267	18国债27	1,200,000	117,048,000.00	6.66	
5	100331	10国债31	1,000,000	100,200,000.00	5.40	
6	11180226	18国债26	1,000,000	97,540,000.00	6.86	

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券除浦发银行、招商银行两家发行主体外,其他证券的发行主体未被国家发展和改革委员会立案调查,或在报告编制前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2 报告期内本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	11,023.34
2	应收证券清算款	10,256,864.82
3	应收股利	—
4	应收利息	19,126,464.62
5	其他应收款	1,400.26
6	其他流动资产	—
7	其他长期资产	—
8	其他	—
9	合计	21,396,134.08

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细