# 长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:长安基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年03月29日

## §1重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。
基金托管人兴业银行股份有限公司(以下简称:兴业银行)根据本基金合同规定,于2019年03月28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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告中财务资料已经会计师事务所审计。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

## §2基金简介

### 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 长安裕盛混合 | |
| 基金主代码 | 005343 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年11月29日 | |
| 基金管理人 | 长安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 43,996,912.36份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005343 | 005344 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 14,818,543.43份 | 29,168,368.93份 |

### 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 通过个股精选和资产配置,在严格控制风险和保持流动性的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略主要包括三大方面,图大类资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略。<br>(一)大类资产配置策略<br>相对于债券和货币市场工具,股票资产波动较大,风险较大,但潜在收益相对较高,在大类资产配置上,本基金着力把握股票市场的投资机会,优先配置满足股票投资标准的个股,其余资产配置于债券或货币市场工具。在基金管理人通过定性和定量分析认为股票市场风险较大、满足投资标准的个股较少或投资组合中的个股已不适合继续持有时,将降低股票资产的配置比例或将全部资产投资于债券或货币市场工具。<br>同时,本基金将从重点关注大陆和香港股票市场的资金供求、投资者构成、市场情绪、流动性和不同市场的相对估值等指标,在基金合同约定的范围内,调整A股和港股通股票的配置比例。<br>(二)股票投资策略<br>在不同的经济发展阶段和发展周期,不同的行业环境,不同的市场中,总是有一些个股凭借其基本面优势、事件性因素或估值优势等,实现较好的回报。因此,本基金A股和港股通股票的投资策略,主要采用自下而上的个股精选策略。<br>基金管理人坚持价值投资理念,通过案头分析和实地调研,对个股进行深入的基本面研究,分析不同企业的业务发展模式、进入壁垒、行业地位、产品线、营销渠道、研发实力、管理能力及资产价值和结构等价值驱动或决定因素,结合经济发展情况,所处行业的景气度等因素,评估个股的内在投资价值,并密切关注其价值实现的方式和时机,综合考虑可能影响企业内在投资价值及市场价格的因素,把握投资时机,投资于具有内在价值优势和估值优势的公司。同时,根据市场价格的变化和价值的实现程度,选择卖出时机,更好控制风险,实现基金资产的长期稳健增值。<br>(三)债券投资策略<br>1.普通债券投资策略<br>本基金将通过分析利率变动趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性、税赋特点、信用风险等因素,精选安全边际较高的个券进行投资,以获取债券市场的长期稳健收益。<br>2.可转债投资策略<br>本基金在综合分析可转债的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上,采用数量化估值工具评定其投资价值,选择安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好以及基础股票基本面优良的品种进行投资。<br>3.中小企业私募债投资策略<br>本基金将根据审慎原则,密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况,通过对中小企业私募债进行信用评级控制,通过对投资单只中小企业私募债的比例限制,严格控制风险,并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响。通过信用研究和流动性管理后,决定投资品种。<br>(四)资产支持证券投资策略<br>本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化和提前偿还率等影响资产支持证券价值的相关要素,并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析和收益率利差分析等方法,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。<br>(五)衍生品投资策略<br>1.股指期货投资策略<br>本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,以套期保值为主要目的,适度参与股指期货投资。<br>本基金管理人将根据持有的股票投资组合状况,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型对其估值水平合理性的评估,并通过与现货资产进行匹配,选择合适的投资时机,采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具,降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险,提高基金的建仓或变现效率。<br>2.国债期货投资策略<br>本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定,以套期保值为主要目的,结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析,预测债券市场变动趋势,基金管理人通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。<br>3.权证投资策略<br>本基金对权证的投资以对冲下跌风险、实现保值和锁定收益为主要目的。本基金在权证投资中综合考虑股票合理价值、标的股票价格、结合权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素估计权证合理价值,采用杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略、买入跨式投资策略还到改善组合风险收益特征的目的。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。<br>本基金除了投资A股外,还可投资港股通股票,因此本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 长安基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李永波 | 吴玉婷 |
| | 联系电话 | 021-20329700 | 021-52629999-212052 |
| | 电子邮箱 | service@changanfunds.com | 0152389@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-820-9688 | 021-52629999 |
| 传真 | | 021-50598018 | 021-62152155 |

### 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.changanfunds.com |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼 |

## §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 | 2018年 | | 2017年11月29日(基金合同生效日)-2017年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C | 长安裕盛混合A | 长安裕盛混合C |
| 本期已实现收益 | -991,029.02 | -1,618,093.60 | -19,510.52 | -79,114.34 |
| 本期利润 | -1,633,599.69 | -3,167,862.65 | 358,812.54 | 1,129,775.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0651 | -0.0507 | 0.0071 | 0.0069 |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.18% | -7.56% | 0.71% | 0.70% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末 | | 2017年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0652 | -0.0691 | -0.0004 | -0.0005 |
| 期末基金资产净值 | 13,852,974.58 | 27,153,250.73 | 50,832,771.37 | 159,974,214.09 |
| 期末基金份额净值 | 0.9348 | 0.9309 | 1.0071 | 1.0070 |

1、本期已实现收益是指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长安裕盛混合A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -3.40% | 1.12% | -7.27% | 1.09% | 3.87% | 0.03% |
| 过去六个月 | -3.14% | 1.04% | -9.00% | 0.98% | 5.86% | 0.06% |
| 过去一年 | -7.18% | 1.03% | -15.02% | 0.89% | 7.84% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | -6.52% | 0.99% | -15.02% | 0.86% | 8.50% | 0.13% |

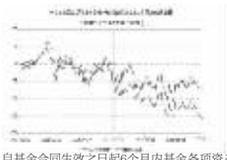
本基金整体业绩比较基准构成为:沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%

长安裕盛混合C

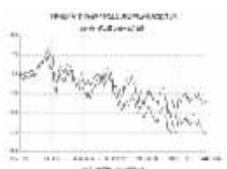
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -3.43% | 1.12% | -7.27% | 1.09% | 3.84% | 0.03% |
| 过去六个月 | -3.21% | 1.04% | -9.00% | 0.98% | 5.79% | 0.06% |
| 过去一年 | -7.56% | 1.03% | -15.02% | 0.89% | 7.46% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | -6.91% | 0.99% | -15.02% | 0.86% | 8.11% | 0.13% |

本基金整体业绩比较基准构成为:沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%

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

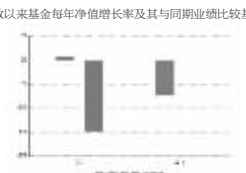


根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间超过一年。图示日期为2017年11月29日至2018年12月31日。



根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束后,各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间超过一年。图示日期为2017年11月29日至2018年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



本基金合同生效日为2017年11月29日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

本基金合同生效日为2017年11月29日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为2017年11月29日,本基金本报告期及上年度均未进行利润分配。

## §4管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日,公司的股东分别为:长安国际信托股份有限公司、杭州景林投资管理合伙企业(有限合伙)、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2018年12月31日,本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫垚主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫匪价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕鑫灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金18只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 徐小勇 | 本基金的基金经理 | 2018-12-24 | - | 23年 | 中国人民大学工商管理硕士。曾就职于建设银行总行信托投资公司、中国信达信托投资公司、中国银河证券有限责任公司,曾任银河基金管理有限公司研究员、基金经理,华泰证券(上海)资产管理有限公司权益部负责人等职,现任长安基金管理有限公司总经理助理、投资总监、基金经理。 |
| 陈立秋 | 本基金的基金经理 | 2017-11-29 | 2018-11-29 | 12年 | 工商管理硕士及工学硕士学位,曾任Blue Pool Capital投资经理,江海证券有限公司研究主管等,人保资产管理有限公司高级投资经理,上海知几资产管理有限公司投资总监,鸿商资本股权投资有限公司董事总经理(期间委派至旗下控股的中法人寿保险有限责任公司担任投资总监),长安基金管理有限公司基金经理等职。 |
| 沈晔 | 本基金的基金经理 | 2017-12-27 | 2018-12-28 | 10年 | 十年金融行业从业经历。曾任通用电气资产管理公司研究部分析员,上海建信股权投资管理有限公司投资部投资总监,上海汉理投资管理有限公司投资部投资总监,上海彬元资产管理有限公司研究部高级研究员,长安基金管理有限公司基金经理等职。 |

1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日;
2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在本报告期内,本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,投资管理和交易执行相隔离,实行集中交易制度,公平对待所管理的所有基金和投资组合,未出现违反公平交易制度的情况,亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基金在2018年大部分时间以消费、医药和科技股为主要持仓。由于市场大体单边下跌,基金产品的投资获利困难,净值表现不理想。我们希望能够突出基金的绝对收益目标,因此在2018年底将股票仓位降低到比较低的水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安裕盛混合A基金份额净值为0.9348元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-7.18%,同期业绩比较基准收益率为-15.02%;截至报告期末长安裕盛混合C基金份额净值为0.9309元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-7.56%,同期业绩比较基准收益率为-15.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股市场经历2018年的单边下跌,多数上市公司的估值显著低估,近期风险偏好提升也带来了一波较为强烈的估值修复行情。我们认为,A股大部分上市公司会受益于2018年以来出台的一系列减税降费、稳就业等积极的财政政策和货币政策。预计2019的货币政策环境较2018年变化不大,稳定的利率环境保障了全年权益市场和债券市场的均衡稳定。本基金将根据市场的变化,力求以绝对收益为目标,保持合理的债券比例,积极寻找优质标的增强收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序,清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。

对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外),采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外,其他基金经理不参与所估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期审计报告为标准无保留意见审计报告。

#### 4.9 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

本基金从2018年12月3日至2018年12月28日连续20个工作日出现基金资产净值低于五千万情形,未连续出现二十个工作日(含)持有人人数不足200人的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当的措施。

## §5托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,兴业银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,完全尽职尽责地履行了应尽义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6审计报告

本报告期基金年度财务会计报告经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## §7年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 7,548,678.10 | 4,435,928.73 |
| 结算备付金 | 544,656.05 | 863,636.36 |
| 存出保证金 | 88,006.80 | 721,230.43 |
| 交易性金融资产 | 21,964,591.72 | 121,193,905.70 |
| 其中:股票投资 | 18,031,699.72 | 106,909,400.90 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 3,932,892.00 | 14,284,504.80 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 11,000,000.00 | 83,100,000.00 |
| 应收证券清算款 | 7,397.26 | 5,221,852.98 |
| 应收利息 | 126,956.75 | 339,289.34 |
| 应收股利 | 6,370.56 | - |
| 应收申购款 | - | 1,000.00 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 41,286,657.24 | 215,876,843.54 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 0.33 | - |
| 应付赎回款 | - | 4,624,852.01 |
| 应付管理人报酬 | 46,262.63 | 218,366.94 |
| 应付托管费 | 3,856.25 | 18,197.23 |
| 应付销售服务费 | 3,725.13 | 20,840.61 |
| 应付交易费用 | 26,588.59 | 117,601.29 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 200,000.00 | 70,000.00 |
| 负债合计 | 280,431.93 | 5,069,858.08 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 43,996,912.36 | 209,339,338.10 |
| 未分配利润 | -2,980,687.05 | 1,467,647.36 |
| 所有者权益合计 | 41,006,225.31 | 210,806,985.46 |
| 负债和所有者权益合计 | 41,286,657.24 | 215,876,843.54 |

1、报告截止日2018年12月31日,本基金A类份额和C类份额的单位净值分别为0.9348元和0.9309元,基金份额分别为14,818,543.43份和29,168,368.93份。
2、本基金基金合同生效日为2017年11月29日,本财务报表的实际编制期间为2018年01月01日至2018年12月31日。

### 7.2 利润表

会计主体:长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期2018年01月01日至2018年12月31日 | 上年度可比期间2017年11月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -1,711,270.51 | 1,993,338.24 |
| 1.利息收入 | 740,829.19 | 634,077.35 |
| 其中:存款利息收入 | 255,285.53 | 46,330.63 |
| 债券利息收入 | 150,695.02 | 23,003.65 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 334,848.64 | 564,743.07 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -329,465.99 | -227,952.39 |
| 其中:股票投资收益 | -1,387,786.29 | -227,952.39 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 49,549.12 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,008,771.18 | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -2,192,339.72 | 1,587,213.28 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 69,706.01 | - |
| 减:二、费用 | 3,090,191.83 | 504,749.82 |
| 1. 管理人报酬 | 1,034,063.99 | 225,388.98 |
| 2. 托管费 | 86,171.98 | 18,782.40 |
| 3. 销售服务费 | 91,956.48 | 21,511.04 |
| 4. 交易费用 | 1,744,803.81 | 168,667.40 |
| 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 | 133,195.57 | 70,400.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -4,801,462.34 | 1,488,588.42 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -4,801,462.34 | 1,488,588.42 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2018年01月01日至2018年12月31日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 209,339,338.10 | 1,467,647.36 | 210,806,985.46 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -4,801,462.34 | -4,801,462.34 |
| 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) | -165,352,425.74 | 353,127.93 | -164,999,297.81 |
| 其中:1.基金申购款 | 31,310,017.32 | 229,562.87 | 31,539,570.19 |
| 2.基金赎回款 | -196,662,443.06 | 123,575.06 | -196,538,868.00 |
| 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) | 43,986,912.36 | -2,980,687.05 | 41,006,225.31 |

| 项 目 | 上年度可比期间 2017年11月29日(基金合同生效日)至2017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) | 213,570,002.35 | - | 213,570,002.35 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,488,588.42 | 1,488,588.42 |
| 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) | -4,230,664.25 | -20,941.06 | -4,251,605.31 |
| 其中:1.基金申购款 | 370,263.76 | 2,982.94 | 373,246.70 |
| 2.基金赎回款 | -4,600,928.01 | -23,924.00 | -4,624,852.01 |
| 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) | 209,339,338.10 | 1,467,647.36 | 210,806,985.46 |

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

| 袁丹旭 | 吴樱 | 欧鹏 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

### 7.4 报表附注

#### 7.4.1 基金基本情况

长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1946号文)注册,由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2017年11月29日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集规模为213,570,002.35份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")。

本基金于2017年11月20日至2017年11月24日募集,募集期间净认购资金人民币213,554,932.35元,认购资金在募集期间产生的利息人民币15,069.40元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计213,570,002.35份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,并出具了毕马威华振验字第1700657号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、港股通股票、衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货等)、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单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)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0-95%,其中投资于国内依法发行上市的股票占基金资产的0-95%,投资于港股通股票占基金股票资产的0-50%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*20%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第2个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况、自2017年11月29日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年01月01日至2018年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

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

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;
- 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;
- 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具,在估值日有报价的,除会计准则规定的情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。与上述金融工具相同,但具有不同特征的,以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 买收基金

买收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的买收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的买收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的买收基金增加和转出基金的买收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认