(上接B471版)

注:除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末未持有本基金份额。本基金的基金合同生效日为2018年6月22日,无上年度末数据。

7.4.8.5 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 2018年6月22日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	83,839,171.42	431,060.31

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押证券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无质押证券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1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。

7.4.14.2其他事项

(1)公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币11,693,500.00元,划分为第二层次的余额为人民币19,848,000.00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。

§1 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体:长城久鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日: 2018年6月21日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月21日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		474,771,835.69	10,060,595.79
结算备付金		11,484,545.45	462,468.27
存出保证金		44,075.63	87,825.08
交易性金融资产		–	1,145,224,491.98
其中:股票投资		–	31,492,200.88
基金投资		–	–
债券投资		–	1,113,732,291.10
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		–	79,744,239.62
应收证券清算款		–	–
应收利息		10,014.22	13,787,022.83
应收股利		–	–
应收申购款		–	2,577.41
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		486,310,470.99	1,249,369,220.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月21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		–	60,000,000.00
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		213,555,208.58	2,749,095.54
应付管理人报酬		434,500.64	1,236,404.37
应付托管费		72,416.77	206,067.40
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		2,783.19	75,743.61
应交税费		–	–
应付利息		–	92,404.56
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		204,463.68	407,940.14
负债合计		214,269,372.86	64,767,655.62
所有者权益:			
实收基金		212,579,746.27	940,054,033.70
未分配利润		59,461,351.86	244,547,531.66
所有者权益合计		272,041,098.13	1,184,601,565.36
负债和所有者权益总计		486,310,470.99	1,249,369,220.98

注:1)报告截止日2018年6月21日(基金合同失效前日),基金份额净值人民币1.0453元,基金份额总额260,240,448.00份。

2)自2018年6月22日起,由《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。?

7.2 利润表

会计主体:长城久鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月21日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月21日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		24,006,502.32	61,544,144.19
1.利息收入		19,635,294.26	62,893,516.67
其中:存款利息收入		295,759.58	10,107,752.39
债券利息收入		18,240,118.64	44,021,354.99
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		1,099,416.04	8,764,409.29
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-11,863,647.31	10,762,410.70
其中:股票投资收益		-6,455,142.64	18,558,519.93
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-5,392,238.03	-8,240,571.51
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		-16,266.64	444,462.28
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		15,881,059.11	-14,472,764.38
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)		353,796.26	2,360,981.20
减:二、费用		7,426,445.34	26,015,414.98
1. 管理人报酬		5,823,747.15	20,644,608.27
2. 托管费		970,624.53	3,440,767.98
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		87,563.91	796,322.96
5. 利息支出		347,561.24	683,739.35
其中:卖出回购金融资产支出		347,561.24	683,739.35
6. 税金及附加		–	–
7. 其他费用		196,948.51	449,976.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		16,580,056.98	35,528,729.21
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		16,580,056.98	35,528,729.21

注:2018年6月21日为基金合同失效前日,本期是指2018年1月1日至2018年6月21日,上年度可比期间是指2017年1月1日至2017年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月21日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月21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)	940,054,033.70	244,547,531.66	1,184,601,565.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	16,580,056.98	16,580,056.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-727,474,287.43	-201,666,236.78	-929,140,524.21
其中:1.基金申购款	1,040,512.78	284,703.40	1,325,216.18
2.基金赎回款	-728,514,800.21	-201,950,940.18	-930,465,740.39
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)	212,579,746.27	59,461,351.86	272,041,098.13
项目	上年度可比期间 2017年1月1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)	1,736,882,349.80	408,317,580.77	2,145,199,930.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	35,528,729.21	35,528,729.21
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)	-796,828,316.10	-199,298,778.32	-996,127,094.42
其中:1.基金申购款	1,560,379.76	379,667.49	1,940,047.25
2.基金赎回款	-798,388,695.86	-199,678,445.81	-998,067,141.67
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)	940,054,033.70	244,547,531.66	1,184,601,565.36

注:2018年6月21日为基金合同失效前日,本期是指2018年1月1日至2018年6月21日,上年度可比期间是指2017年1月1日至2017年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

______ 王 军 ______ ______ 熊 科 金 ______ ____赵永强____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城久鑫保本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[2014]469号文"关于核准长城久鑫保本混合型证券投资基金募集的批复" 的核准,由长城基金管理有限公司向社会公开募集, 首次设立募集规模为2,800,983,932.91份基金份额。基金合同于2014年7月30日生效。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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称"中国银行")。

根据《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,2018年6月15日为本基金第二个保本周期到期日, 本基金第二个保本周期到期后,由于未能符合保本基金存续条件,自2018年6月22日起本基金变更为"长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金",转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据《长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的各类债券、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)、权证、银行存款及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的相关规定。本基金将投资对象主要分为安全资产和风险资产,其中安全资产为国内依法公开发行的各类债券(包括国债、央行票据、公司债、企业债、短期融资券、资产支持证券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券和债券回购等)、银行存款等;风险资产为股票、权证等。本基金按照CPPI和TIPP策略对各类金融工具的投资比例进行动态调整。其中,股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%;债券、银行存款等安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构今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:3年期银行定期存款税后收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号 〈年度报告和半年度报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月21日(基金合同失效前日)的财务状况以及自2018年1月1日至2018年06月21日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最新一期年度报告相一致的说明

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。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6税项

1.印花税

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

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

2.增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称 "资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。?

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

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

3.个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司("长城证券")	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月21日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	–	–	32,065,628.89	6.42%

7.4.8.1.2 债券交易

注:本基金于本期及上年度可比期间,均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:本基金本期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月21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	–	–	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长城证券	29,862.70	6.42%	–	–

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上海证券交易所买(卖)证管费等。)

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月21日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,823,747.15	20,644,608.27
其中:支付销售机构的客户维护费	3,023,412.34	10,363,908.32

注:基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.2%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月21日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	970,624.53	3,440,767.98

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月21日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	474,771,835.69	254,287.71	10,060,595.79	236,753.57

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,并按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末(2018年6月21日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末2018年06月21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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月21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。

7.4.10 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2018年06月21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0.00元, 划分为第二层次的余额为人民币0.00元,无划分为第三层次余额。于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币30,611,399.68元, 划分为第二层次的余额为人民币1,114,613,092.30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,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告(转型后)

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	11,693,500.00	7.49
	其中:股票	11,693,500.00	7.49
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	19,848,000.00	12.71
	其中:债券	19,848,000.00	12.71
	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	40,000,000.00	25.62
	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	84,486,601.13	54.10
8	其他各项资产	128,421.41	0.08
9	合计	156,156,522.54	100.00

8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	3,716,400.00	3.23
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	824,100.00	0.72
J	金融业	–	–
K	房地产业	7,153,000.00	6.22
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	11,693,500.00	10.17

8.3 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

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	600340	华夏幸福	100,000	2,545,000.00	2.21
2	600048	保利地产	210,000	2,475,900.00	2.15
3	601155	新城控股	90,000	2,132,100.00	1.86
4	002007	华兰生物	65,000	2,132,000.00	1.86
5	002064	华峰氨纶	240,000	1,005,600.00	0.87
6	002555	三七互娱	70,000	660,800.00	0.57
7	300450	先导智能	20,000	578,800.00	0.50
8	002929	润建通信	5,000	163,300.00	0.14
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站(www.ccfund.com.cn)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	000661	长春高新	10,976,586.96	9.55
2	000860	顺鑫农业	7,516,556.84	6.54
3	002007	华兰生物	7,296,065.61	6.35
4	300408	三环集团	5,465,819.00	4.76
5	600340	华夏幸福	4,339,619.40	3.78
6	000968	蓝焰控股	4,074,888.00	3.55
7	600029	南方航空	4,056,261.00	3.53
8	002555	三七互娱	3,845,074.76	3.35
9	601318	中国平安	3,644,700.00	3.17
10	600312	平高电气	2,989,761.00	2.60
11	603737	三棵树	2,756,728.40	2.40
12	600048	保利地产	2,752,492.00	2.39
13	600763	通策医疗	2,637,930.00	2.30
14	601155	新城控股	2,600,275.42	2.26
15	603799	华友钴业	2,477,954.00	2.16
16	002812	恩捷股份	2,457,222.00	2.14
17	000725	京东方A	2,157,000.00	1.88
18	002821	凯莱英	1,828,548.50	1.59
19	002419	天虹股份	1,825,865.00	1.59
20	300294	博雅生物	1,818,644.00	1.58

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	000661	长春高新	10,764,670.00	9.37
2	000860	顺鑫农业	7,161,766.84	6.23
3	002007	华兰生物	5,036,865.00	4.38
4	300408	三环集团	4,604,492.12	4.01
5	000968	蓝焰控股	4,282,400.00	3.73
6	600029	南方航空	3,993,662.00	3.47
7	601318	中国平安	3,660,145.00	3.18
8	600312	平高电气	3,215,768.00	2.80
9	002555	三七互娱	2,872,898.00	2.50
10	002812	恩捷股份	2,733,011.75	2.38
11	600763	通策医疗	2,625,016.54	2.28
12	603737	三棵树	2,290,867.39	1.99
13	603799	华友钴业	2,139,352.00	1.86
14	000725	京东方A	2,138,000.00	1.86
15	300294	博雅生物	1,908,532.00	1.66
16	600340	华夏幸福	1,878,205.00	1.63
17	002419	天虹股份	1,820,763.82	1.58
18	002821	凯莱英	1,671,428.00	1.45
19	000703	恒逸石化	1,636,025.60	1.42
20	002624	完美世界	1,634,533.00	1.42

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	107,853,457.23
卖出股票收入(成交)总额	91,999,537.76

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	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	19,848,000.00	17.27
9	其他	–	–
10	合计	19,848,000.00	17.27

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111815588	18民生银行CD588	200,000	19,848,000.00	17.27
2	–	–	–	–	–
3	–	–	–	–	–
4	–	–	–	–	–
5	–	–	–	–	–

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资股指期货,本期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券除民生银行发行主体外,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:

中国民生银行股份有限公司(简称民生银行)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。同时,本基金持有的上述银行同业存单评级较高,流动性好。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。本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18民生银行CD588进行了投资。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.12.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,384.30
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	97,066.67
5	应收申购款	1,970.44
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	128,421.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§1 投资组合报告(转型前)

8.13 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	486,256,381.14	99.99
8	其他资产	54,089.85	0.01
9	合计	486,310,470.99	100.00

8.14 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

8.15 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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

8.16 报告期内股票投资组合的重大变动

8.16.1 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	600667	太极实业	4,485,238.42	0.38
2	002217	合力泰	1,920,900.00	0.16
3	300088	长信科技	1,549,734.08	0.13

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

8.16.2 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	002376	新北洋	10,554,578.00	0.89
2	300088	长信科技	6,725,872.88	0.57
3	002217	合力泰	4,587,768.00	0.39
4	600285	羚锐制药	4,201,602.00	0.35
5	600667	太极实业	3,463,890.00	0.29
6	600297	广汇汽车	2,515,500.00	0.21
7	601222	林洋能源	2,081,444.00	0.18
8	600711	盛屯矿业	887,000.00	0.07
9	600075	新疆天业	746,046.40	0.06
10	002859	洁美科技	579,064.50	0.05
11	603823	百合花	546,036.40	0.05
12	002860	星帅尔	315,580.00	0.03

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

8.16.3 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	7,955,872.50
卖出股票收入(成交)总额	37,204,382.18

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

8.17 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。

8.18 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。

8.19 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。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

8.21 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.22 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.22.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资股指期货,本期末未持有股指期货。

8.22.2 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。

8.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.23.1 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。

8.23.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

8.23.3 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。

8.24 投资组合报告附注

8.24.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.24.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.24.3 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	44,075.63
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	10,014.22
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	54,089.85

8.24.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.24.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.24.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
1,643	69,349.41	–	–	113,941,088.14	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注:同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的,分别计算在内。

§1 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
2,505	103,888.40	–	–	260,240,448.00	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注:同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的,分别计算在内。

§10 开放式基金份额变动(转型后)

单位:份

基金合同转型日基金份额总额	260,240,448.00
基金合同转型日起至报告期期末基金总申购份额	74,878.78
减:基金合同转型日起至报告期期末基金总赎回份额	146,374,238.64
基金合同转型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	113,941,088.14

§1 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	2,800,983,932.91
本报告期期初基金份额总额	1,150,806,210.21
本报告期期间基金总申购份额	1,273,820.61
减:本报告期期间基金总赎回份额	891,839,582.82
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	260,240,448.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

自2018年2月13日起桑煜先生不再担任公司副总经理。

自2018年11月2日起范小新先生不再担任公司董事,由杨超先生担任公司董事。

自2018年11月2日起王连洲先生不再担任公司独立董事,由唐纹女士担任公司独立董事。

自2018年11月16日起何伟先生不再担任公司董事长,由王军先生担任公司董事长。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内,2018年8月,刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期长城久鑫保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期,但本基金管理人无法为转入下一保本周期确定保障义务人,不符合避险策略基金的存续条件,按照基金合同的约定,经基金管理人和基金托管人同意,变更为"长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金",基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的相关约定作相应修改。自2018年6月22日起,《长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《长城久鑫保本混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、长城久鑫保本混合型证券投资基金本报告期审计费为叁万元,长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金本报告期审计费为贰万元。

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券	2	82,124,074.69	41.09%	76,481.79	41.09%	–
安信证券	2	53,250,129.71	26.64%	49,591.72	26.64%	–
长城证券	1	45,097,637.25	22.57%	41,999.57	22.57%	–
华泰证券	1	19,381,153.34	9.70%	18,049.83	9.70%	–
华鑫证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	2	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
东北证券	2	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
华西证券	2	–	–	–	–	–

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21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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	–	–	656,000,000.00	61.48%	–	–
安信证券	–	–	211,000,000.00	19.78%	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	200,000,000.00	18.74%	–	–
华鑫证券	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
华西证券	–	–	–	–	–	–

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
方正证券	2	45,160,254.68	100.00%	42,057.88	100.00%	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
光大证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	2	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
华西证券	2	–	–	–	–	–
华鑫证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	2	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
长城证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	–	–	–	–	–

注:1、报告期内租用证券公司席位的变更情况:

本报告期内交易单元无变动,截止本报告期末共计21个交易单元。

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

(1)实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币;

(2)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;

(3)经营行为规范,能满足基金运作的合法、合规需求;

(4)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

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

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

根据上述标准考察确定后,基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议,并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定,在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
方正证券	38,373,010.05	56.03%	4,938,000,000.00	100.00%	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
华西证券	–	–	–	–	–	–
华鑫证券	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	30,113,210.69	43.97%	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。