

长城久益灵活配置混合型证券投资基金
(原长城久益保本混合型证券投资基金转
型)

2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 1 月 19 日

§1 重要提示

本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。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

长城久益灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 11 月 2 日起至 12 月 31 日止，原长城久益保本混合型证券投资基金报告期自 2018 年 10 月 01 日起至 11 月 1 日止。

本报告期长城久益保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期，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“长城久益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 11 月 2 日起，《长城久益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久益保本混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长城久益混合
基金主代码	002543
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	141,959,533.10 份
投资目标	本基金通过把握经济周期及行业轮动，挖掘中国经济成长过程中强势行业的优质上市公司，在控制风险的前提下，力求实现基金资产长期稳定的增值。
投资策略	1、大类资产配置策略

	<p>在大类资产配置中，本基金将采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险及提高基金收益的目的。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金在行业配置上，采用“投资时钟理论”，对于经济周期景气进行预判，并按照行业轮动的规律进行行业配置。通过对于经济增速、通货膨胀率、以及其他宏观经济指标的分析，可以将经济周期大致划分入复苏、增长、萧条、衰退四个阶段。对应不同的阶段，不同的阶段，配置不同的大类资产及不同的行业，将取得不同的收益，并能够呈现出一定的规律性。</p> <p>3、个股投资策略</p> <p>在个股选择上，基金管理人将优选具备核心竞争力并估值合理的优势个股。主要评价维度包括：</p> <p>（1）公司主营业务具备核心竞争力，核心优势突出。公司在细分行业中处于龙头位置，具备核心竞争力，比如垄断的资源优势、独特的商业模式、稳定的销售网络、卓越的品牌影响力等；</p> <p>（2）公司处于快速成长期，收入、利润连续快速增长；同时从盈利模式、公司治理、人员稳定性、创新能力等多角度来分析其成长性的持续能力；</p> <p>（3）个股的估值优势。针对处于不同成长阶段、不同行业的公司，运用不同的估值方法进行评估，挖掘具备安全边际的个股。</p>	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+中债总财富指数收益率×45%	
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城久益混合 A	长城久益混合 C
下属分级基金的交易代码	002543	002544
报告期末下属分级基金的份额总额	131,661,395.24 份	10,298,137.86 份

转型前：

基金简称	长城久益保本
基金主代码	002543

基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 日	
报告期末基金份额总额	215,331,030.06 份	
投资目标	本基金严格控制风险，在确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的稳定增值。	
投资策略	<p>本基金投资策略分为两个层次：一层为基金在固定收益类资产和权益类资产之间的大类资产配置策略；另一层为固定收益类资产的投资策略和权益类资产的投资策略。</p> <p>本基金采用固定比例组合保险策略（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称“CPPI”）建立和运用严格的动态资产数量模型，动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，以保证基金资产在 2.5 年保本周期末本金安全，并力争实现基金资产的保值增值。</p>	
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率	
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城久益保本 A	长城久益保本 C
下属分级基金的交易代码	002543	002544
报告期末下属分级基金的份额总额	191,572,330.35 份	23,758,699.71 份

注：该基金于 2018 年 11 月 2 日转型，该日起长城久益保本混合型证券投资基金变更为长城久益灵活配置混合型证券投资基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 11 月 2 日 — 2018 年 12 月 31 日）	
	长城久益混合 A	长城久益混合 C
1. 本期已实现收益	140,239.44	-275.84
2. 本期利润	152,901.71	-577.41
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0013	-0.0000
4. 期末基金资产净值	139,572,313.80	10,751,812.90

5. 期末基金份额净值	1.0601	1.0441
-------------	--------	--------

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本基金转型日期为 2018 年 11 月 2 日，截止本报告期末，基金转型未满一个季度。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 11 月 1 日）	
	长城久益保本 A	长城久益保本 C
1. 本期已实现收益	573,736.99	19,286.25
2. 本期利润	676,767.86	27,072.18
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0012	0.0006
4. 期末基金资产净值	202,856,224.22	24,802,497.56
5. 期末基金份额净值	1.0589	1.0439

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。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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

长城久益混合 A

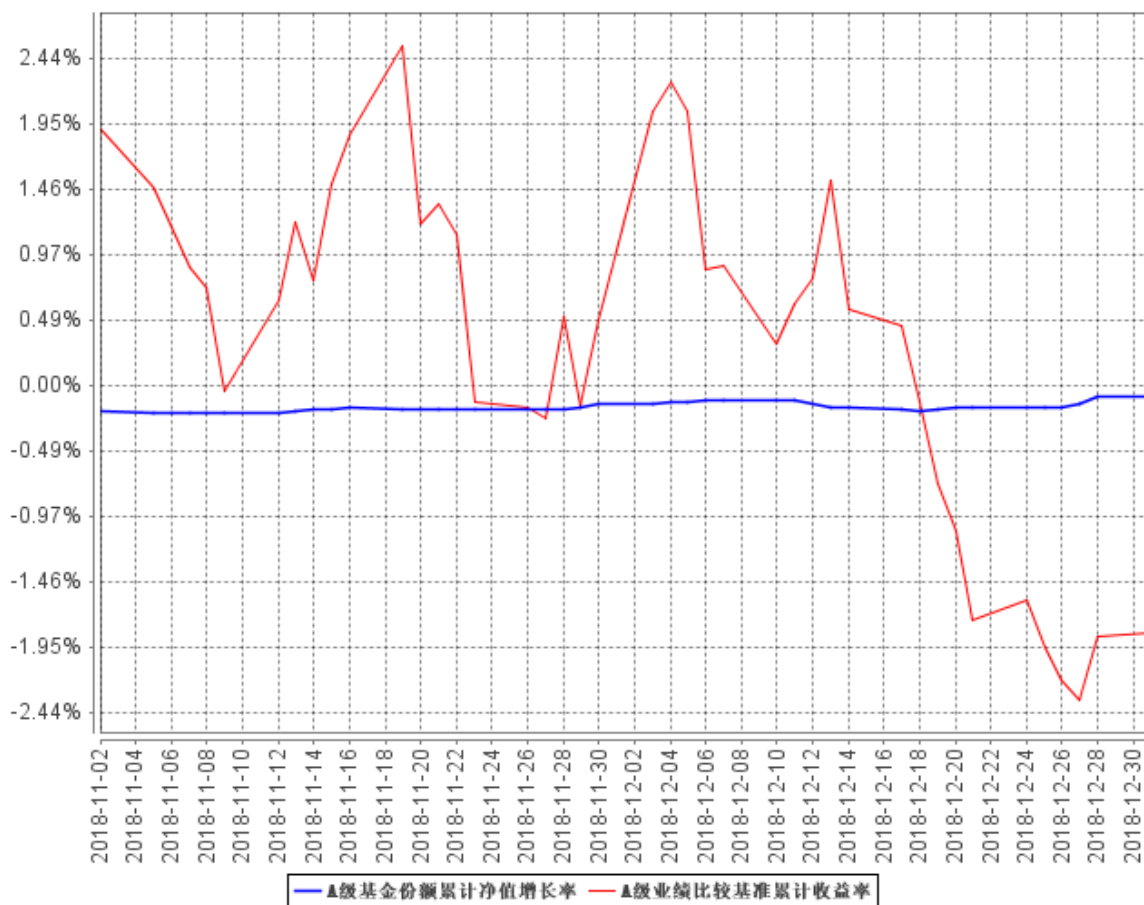
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.11%	0.01%	-1.85%	0.67%	1.96%	-0.66%

长城久益混合 C

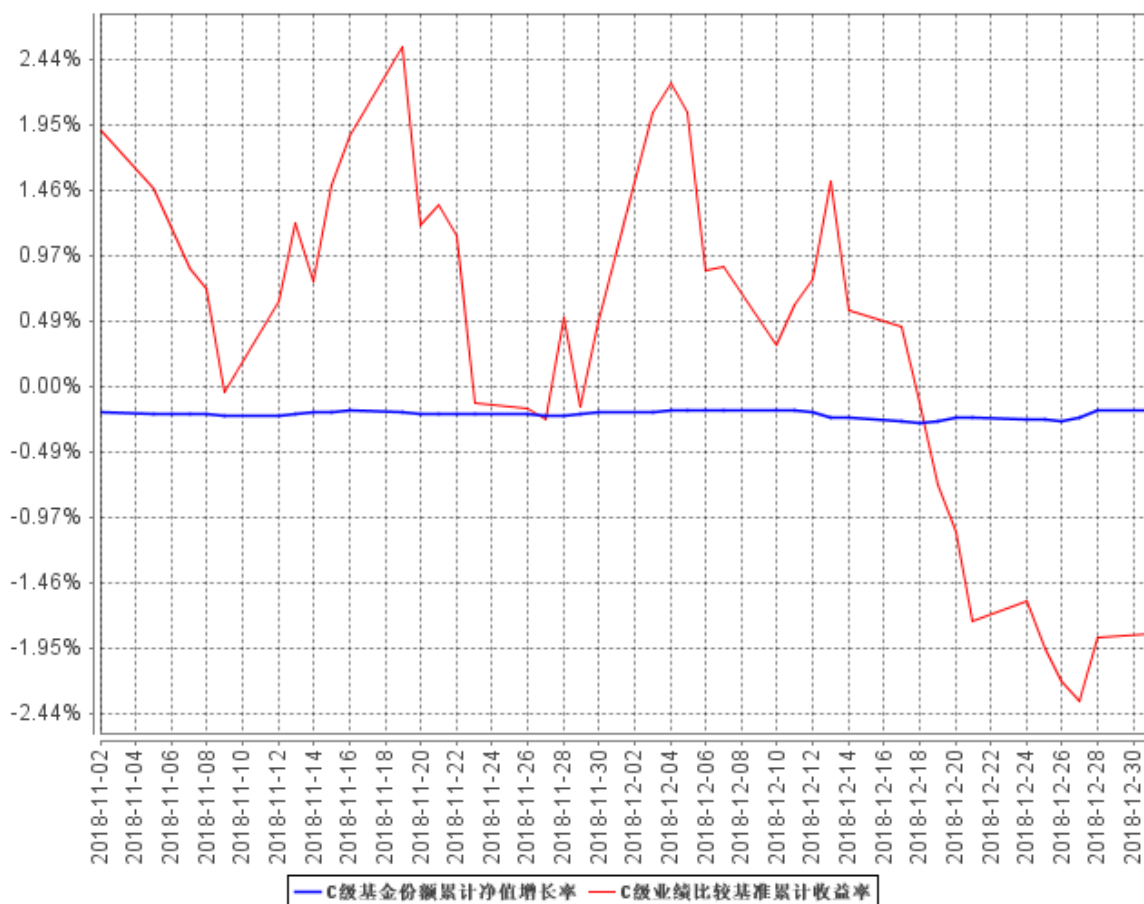
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.02%	0.01%	-1.85%	0.67%	1.87%	-0.66%

3.2.2 自基金转型以来基金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本基金合同规定本基金股票等权益类投资（包括股票、权证）占基金资产的比例范围为 0-95%；债券等固定收益类投资（包括债券、货币市场工具和银行存款）占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。
 ②本基金的建仓期为自基金转型之日起六个月内，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 2018 年 11 月 02 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 本报告期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

长城久益保本 A

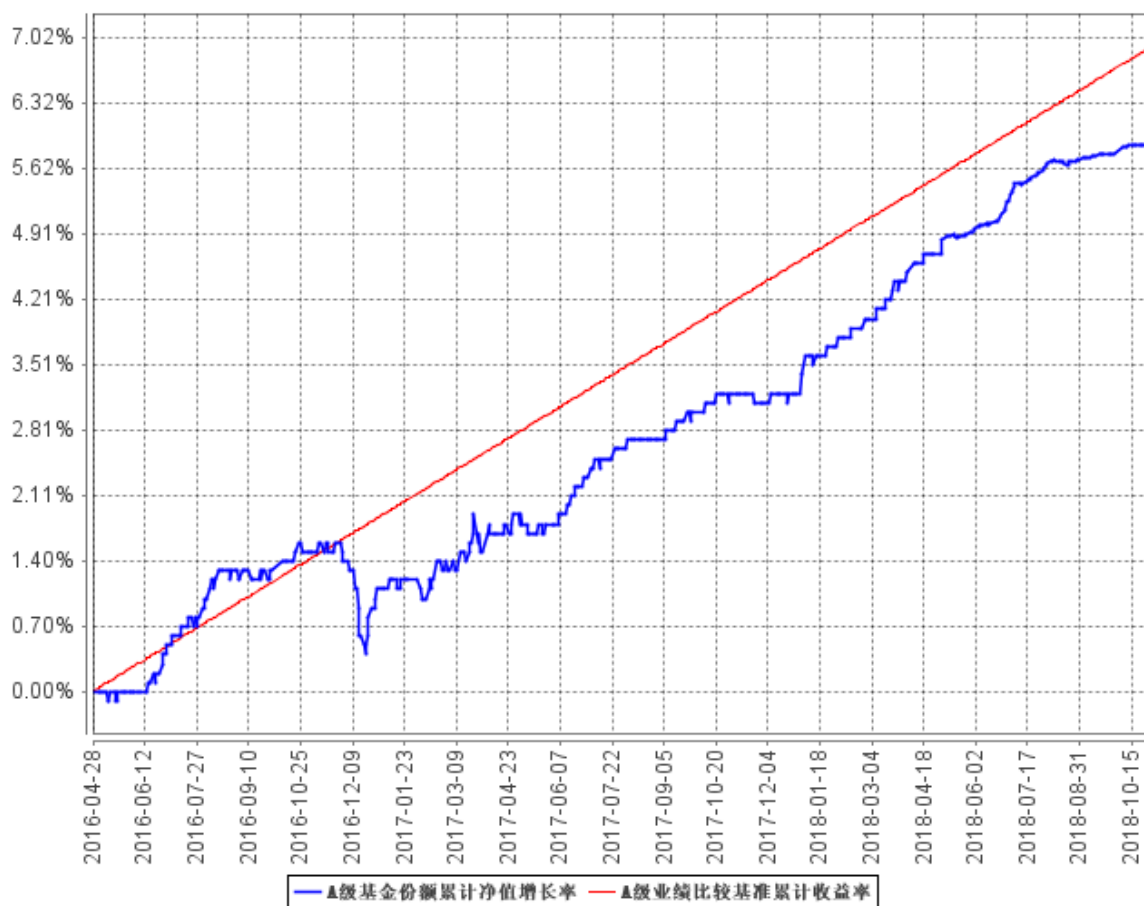
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.11%	0.02%	0.24%	0.01%	-0.13%	0.01%

长城久益保本 C

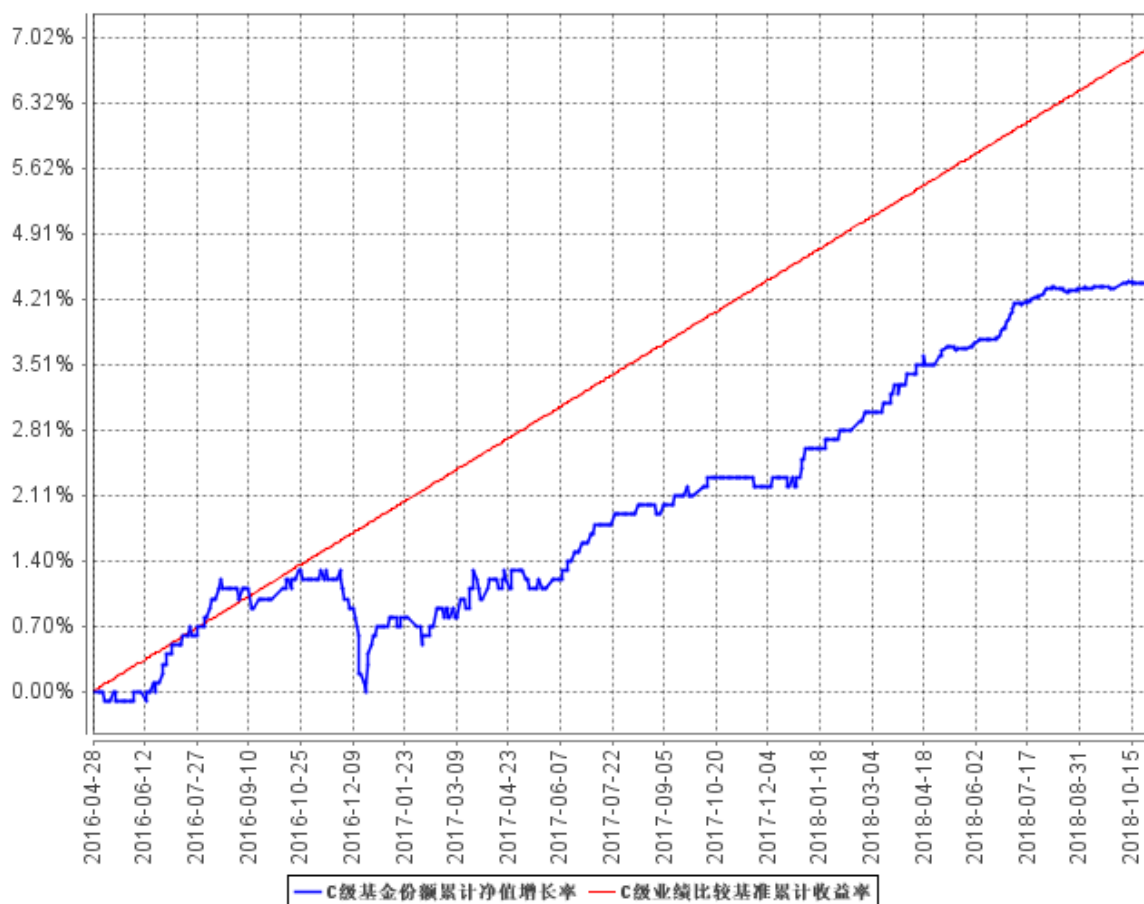
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.06%	0.01%	0.24%	0.01%	-0.18%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、银行存款等固定收益类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%。

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 2018 年 11 月 2 日起，由《长城久益保本混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《长城久益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久益保本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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

<p>马强</p>	<p>固定收益部总经理、长城新策略混合、长城新优选混合、长城久安保本、长城久润保本、长城久益保本、长城久鼎保本、长城久盛安稳债券、长城积极增利债券、长城新视野混合、长城久惠混合基金和长城久益灵活配置混合型基金的基金经理</p>	<p>2016 年 4 月 28 日</p>	<p>2018 年 11 月 2 日</p>	<p>6 年</p>	<p>男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012 年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部副总经理“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”和“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理，“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”、“长城久鑫保本混合型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”和“长城久益保本混合型证券投资基金”的基金经理。</p>
<p>陈良栋</p>	<p>长城久安保本、长城久益保本、长城久鼎保本、长城新兴产业混合基金、长城久祥灵活配置混合型基金的基金经理</p>	<p>2016 年 5 月 12 日</p>	<p>2018 年 11 月 2 日</p>	<p>7 年</p>	<p>男，中国籍，清华大学微电子学与经济学双学士、清华大学电子科学与技术硕士。2011 年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、长城消费增值混合型证券投资基金基金经理助理，长城保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金和长城久祥保本混合型证券投资</p>

					基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

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

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马强	固定收益部总经理、长城新策略混合、长城新优选混合、长城久安保本、长城久润保本、长城久鼎保本、长城久盛安稳债券、长城积极增利债券、长城新视野混合、长城久惠混合基金和长城久益灵活配置混合型基金的基金经理	2018 年 11 月 2 日	-	6 年	男，中国籍，特许金融分析师（CFA），北京航空航天大学计算机科学与技术专业学士、北京大学计算机系统结构专业硕士。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012 年进入长城基金管理有限公司，曾任产品研发部产品经理、固定收益部副总经理“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”和“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理助理，“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”、“长城久鑫保本混合型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”和“长城久益保本混合型证券投资基金”的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久益灵活配置混合型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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，国内消费和出口增速有所回落，经济下行压力较前三季度增加，但投资展现了较强的韧性，对经济起了一定的托底作用。在复杂多变的经济环境下，国内的政策继续围绕着稳增长的目标来展开。年底的中央经济工作会议强调了政策的逆周期调节作用，2019 年将会继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策。中美贸易摩擦也出现了缓解，双方同意暂停贸易战，并给出明确的谈判时间，不确定性有所降低。但同时也不能忽略，随着 2016 年初以来的全球经济同步复苏逐步走向终结，全球经济增速也会放缓，对于出口的负面影响将于 2019 年持续展现，四季度的 PMI 新出口订单指数已对此有所反映。通胀方面，四季度国际原油价格大跌，布伦特原油跌至 50 美元附近，缓解了部分通胀的压力。生猪价格也较为平稳，非洲猪瘟的蔓延导致生猪异地调运受限。但随着供给的减少，2019 年的猪价存在一定的不确定性。

四季度，货币市场流动性持续宽松，以隔夜和 7d 为代表的短端资金利率处于历史最低区间，存单和短融等较短期限的债券收益率也在低位震荡。随着经济下行压力的增加，长端债券收益

率继续下行，10Y 国债收益率最后一个交易日收于全年最低点，信用利差和期限利差均有所收窄。

面对复杂的国内外政治经济形势，以及较为确定的流动性宽松环境，债券资产的配置价值凸显。四季度，本基金配置了部分信用评级较高的债券，组合的仓位和久期都有所提升，同时也保持了较强的灵活性。股票操作方面，由于股市持续下跌，市场无任何赚钱效应，交易量不断萎缩。作为一只灵活配置的基金，本组合在四季度没有参与个股投资，净值表现稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，转型前长城久益混合 A 级净值增长率为 0.11%，长城久益混合 C 级净值增长率为 0.06%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%；转型后长城久益混合 A 级净值增长率为 0.11%，长城久益混合 C 级净值增长率为 0.02%，同期业绩比较基准收益率为-1.85%。

4.6 报告期内基金持有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

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,615,848.00	47.89
	其中：债券	81,615,848.00	47.89
	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	58,000,000.00	34.03
	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	28,545,866.75	16.75
8	其他资产	2,253,199.79	1.32
9	合计	170,414,914.54	100.00

5.2 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。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,040,500.00	3.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	76,575,348.00	50.94
	其中：政策性金融债	76,575,348.00	50.94
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	81,615,848.00	54.29

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	650,000	65,208,000.00	43.38
2	018006	国开 1702	100,000	10,207,000.00	6.79
3	010303	03 国债(3)	50,000	5,040,500.00	3.35
4	018002	国开 1302	11,600	1,160,348.00	0.77
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	356.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,252,843.02
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,253,199.79

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

转型前：

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	428,027,972.45	99.97
8	其他资产	142,455.21	0.03
9	合计	428,170,427.66	100.00

5.2 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。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告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。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

5.11.2

本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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,889.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	138,565.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	142,455.21

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	长城久益混合 A	长城久益混合 C
----	----------	----------

基金转型日（2018 年 11 月 2 日）基金份额总额	191,572,330.35	23,758,699.71
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	23,963,069.26	174,804.84
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	83,874,004.37	13,635,366.69
基金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）	-	-
报告期期末基金份额总额	131,661,395.24	10,298,137.86

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	长城久益保本 A	长城久益保本 C
报告期期初基金份额总额	646,580,601.73	49,329,296.37
报告期期间基金总申购份额	17,739.06	1,580.63
减：报告期期间基金总赎回份额	455,026,010.44	25,572,177.29
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	191,572,330.35	23,758,699.71

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

备查文件目录

1. 中国证监会许可长城久益保本混合型证券投资基金注册的文件
2. 《长城久益保本混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城久益保本混合型证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会准予长城久益灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件
5. 《长城久益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
6. 《长城久益灵活配置混合型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

9.2 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

9.3 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