

长城中证 500 指数增强型证券投资基金证
券投资基金（原长城久兆中小板 300 指数
分级证券投资基金基金转型）
2018 年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 03 月 27 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。

长城中证 500 指数增强型证券投资基金报告期自 2018 年 8 月 13 日起至 12 月 31 日止，原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 8 月 12 日止。

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金以通讯方式召开了长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，于 2018 年 7 月 5 日表决通过了《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（详见 2018 年 7 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登的《长城久兆中小板 300 指数分级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》）。长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金于 2018 年 8 月 6 日终止上市，由上市型基金转型为非上市基金，同时名称变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金，其基金简称、交易代码、基金运作方式、基金合同存续期、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等均发生改变。自 2018 年 8 月 13 日起，由《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》自同日起失效。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	长城中证 500 指数增强
基金主代码	006048
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 8 月 13 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	18,728,350.38 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级
基金主代码	162010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 1 月 30 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,420,400.59 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012 年 2 月 21 日

本基金于 2018 年 8 月 13 日转型，该日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。

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，分享中国经济的长期增长，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，股票投资以中证 500 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	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，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	本基金通过投资约束和数量化监控，力求实现对中小板 300（价格）指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。		
投资策略	本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板 300（价格）指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%		
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

注：本基金于 2018 年 8 月 13 日转型，该日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。

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	中国建设银行股份有限公司

			公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275853

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	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

§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	2018 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,464,415.48
本期利润	-2,929,606.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1451
本期基金份额净值增长率	-20.47%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.3413
期末基金资产净值	14,860,686.92
期末基金份额净值	0.7935

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本基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，截止本报告期末，基金转型未满一年。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-6,741,990.33	-3,055,720.92	-4,364,973.32
本期利润	-4,635,675.92	929,691.88	-7,636,674.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2051	0.0358	-0.2609
本期基金份额净值增长率	-5.62%	4.17%	-19.66%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 8 月 12 日	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2084	0.1366	0.2684
期末基金资产净值	16,972,171.66	23,515,027.55	28,631,394.12
期末基金份额净值	0.874	1.087	1.067

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。

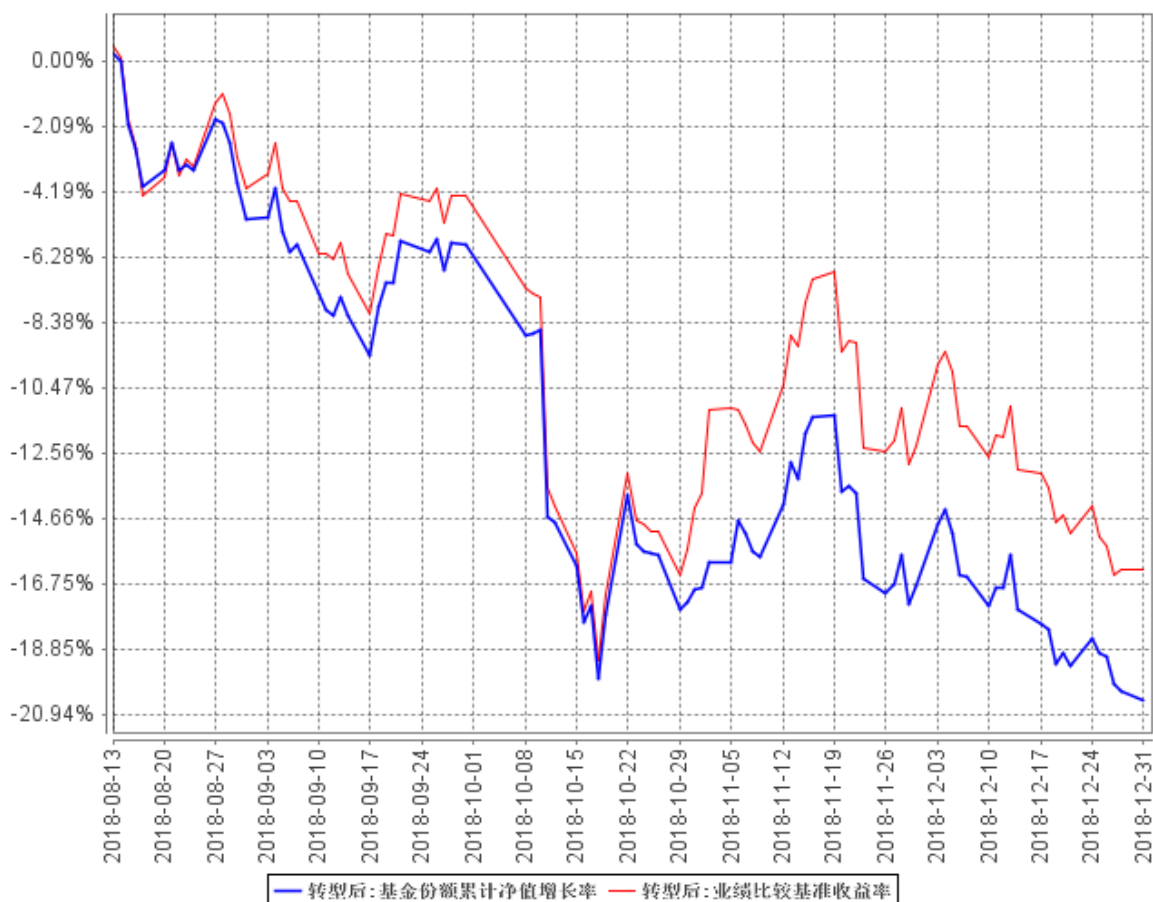
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 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
过去三个月	-15.53%	1.64%	-12.52%	1.74%	-3.01%	-0.10%
自基金转型起至今	-20.47%	1.42%	-16.31%	1.52%	-4.16%	-0.10%

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

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 90%，其中投资于中证 500 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

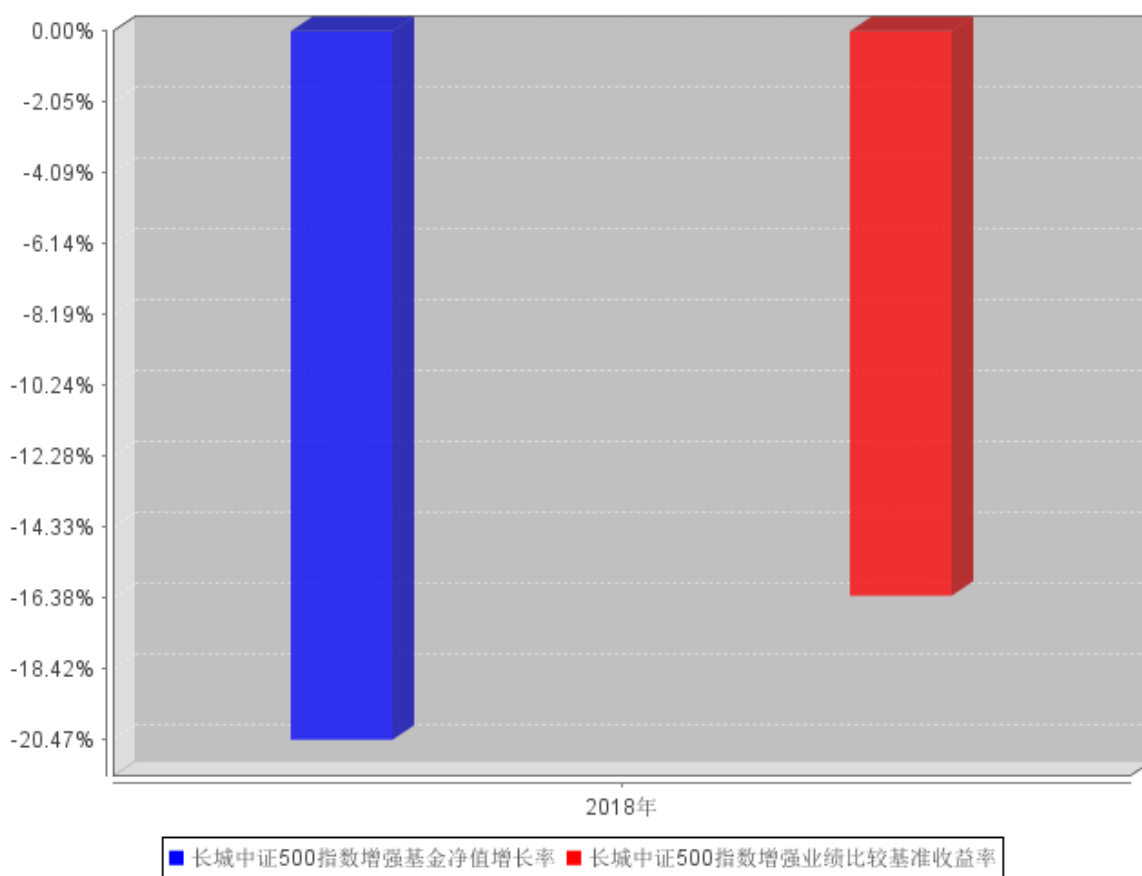
交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

③本基金转型日期为 2018 年 8 月 13 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

3.2.3 自基金转型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

长城中证500指数增强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对比图



注：基金转型当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

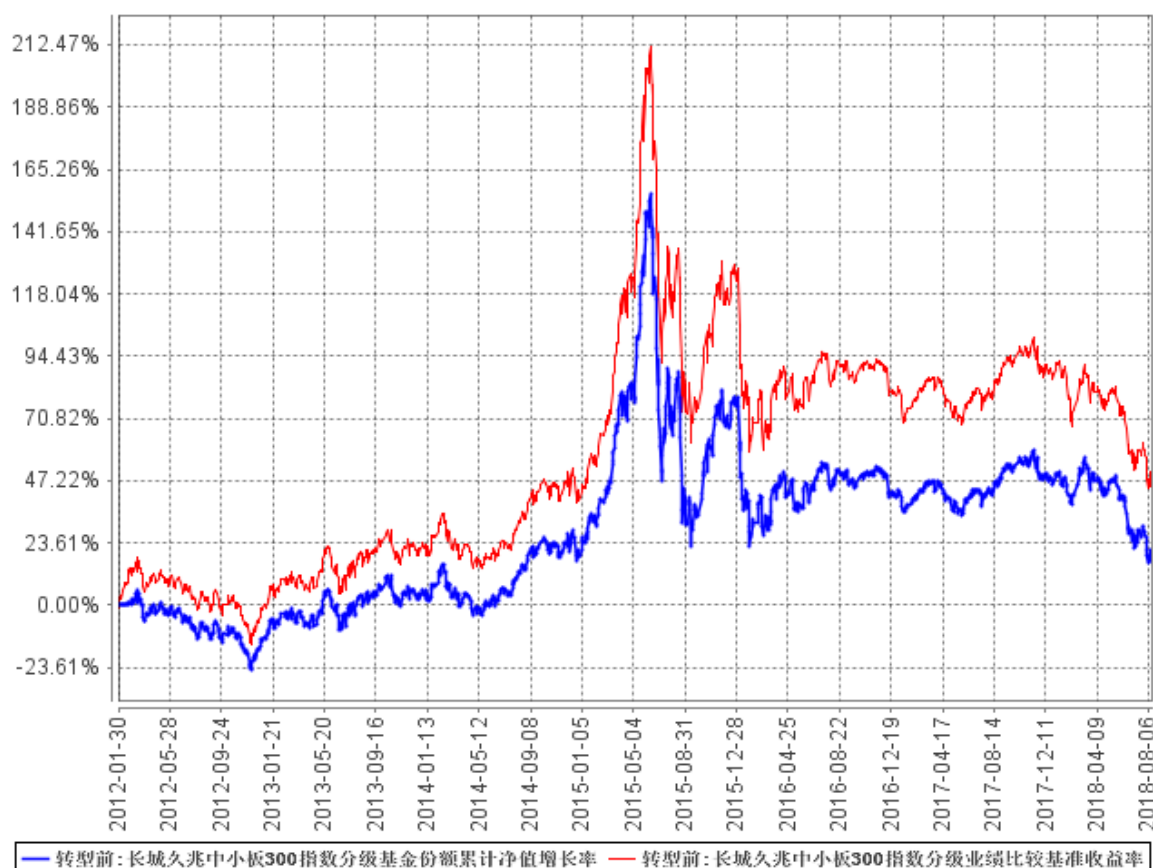
3.2 基金净值表现（转型前）

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
过去六个月	-5.62%	1.48%	-5.52%	1.51%	-0.10%	-0.03%
过去一年	-17.85%	1.29%	-19.91%	1.36%	2.06%	-0.07%
过去三年	-31.25%	1.38%	-32.87%	1.39%	1.62%	-0.01%
过去五年	15.45%	1.76%	23.17%	1.69%	-7.72%	0.07%
自基金合同 生效起至 2018 年 8 月 12 日	20.75%	1.65%	50.35%	1.60%	-29.60%	0.05%

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

长城久兆中小板300指数分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

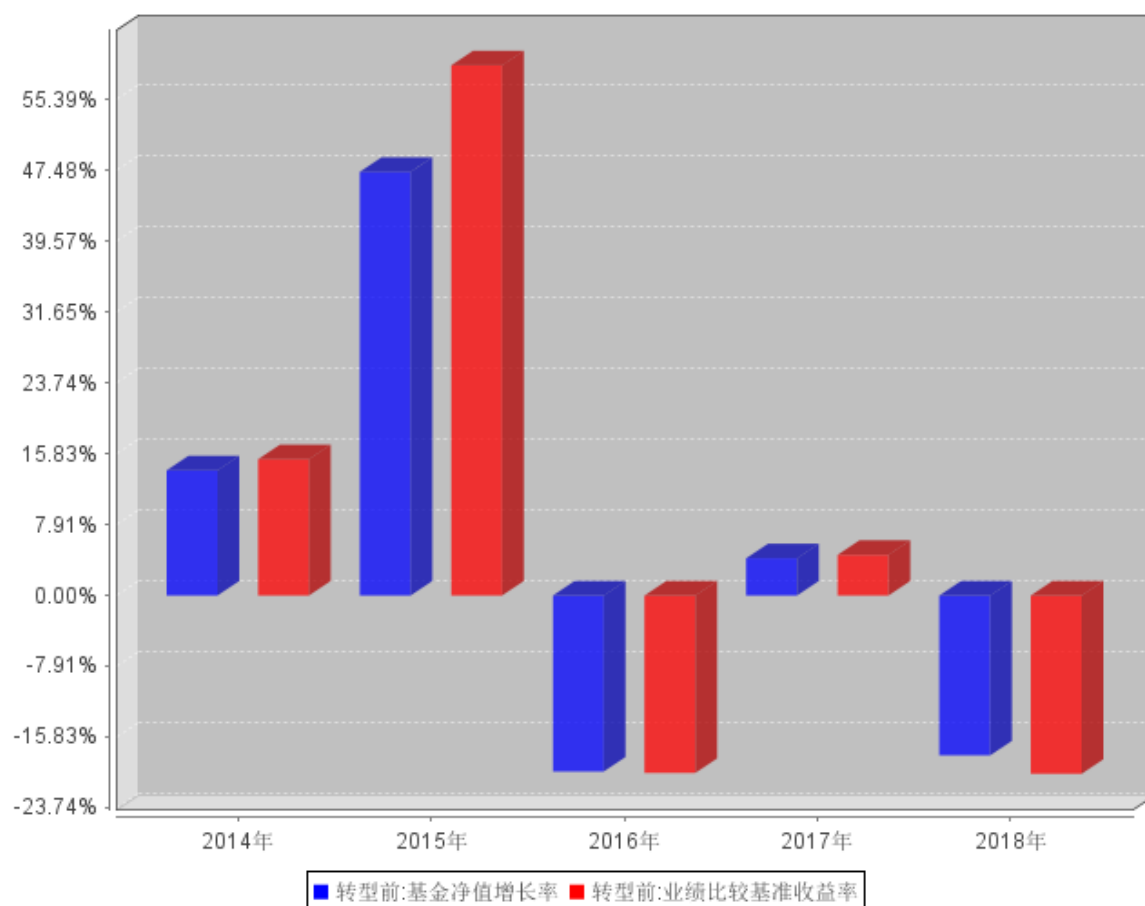


注：本基金合同约定：本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，将不低于 90% 的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应

收申购款。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

转型后

注：转型后报告期内本基金未实施利润分配。

§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、资产管理和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：长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、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、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报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)、长城品牌优选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、长城久利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、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、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、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、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本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、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、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、长城创新动力灵活

配置混合型证券投资基金、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。

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 指数增强型基金和长城久泰沪深 300 指数基金的基金经理	2018 年 11 月 30 日	-	10	北京大学信息与计算科学学士、信号与信息处理硕士。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。
王卫林	长城久泰沪深 300 指数和长城中证 500 指数增强基金的基金经理助理	2018 年 8 月 13 日	-	2 年	男，华中科技大学船舶与海洋工程学士、北京大学金融信息工程硕士。曾就职于南方基金管理有限公司。2018 年 1 月进入长城基金管理有限公司，曾任量化研究员、“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”的基金经理助理。
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理，长城久泰、长城品牌、长城久嘉创新成长混合型和长城中证 500 指数增强型基金的基金经理	2018 年 8 月 13 日	2018 年 11 月 30 日	18 年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券股份有限公司投资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司，曾任研究部总经理和公司总经理助理，基金经理助理、“长城安心回报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”、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”、“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”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。

4.1.2 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		
杨建华	公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理，长城久兆中小板 300 指数分级、长城久泰、长城品牌和长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理	2017 年 6 月 19 日	2018 年 8 月 13 日	18 年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券股份有限公司投资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司，曾任研究部总经理和公司总经理助理，基金经理助理、“长城安心回报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”、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”的基金经理。
王卫林	长城久泰沪深 300 指数和长城久兆 300 指数分级基金的基金经理助理	2018 年 6 月 8 日	2018 年 8 月 13 日	2 年	男，华中科技大学船舶与海洋工程学士、北京大学金融信息工程硕士。曾就职于南方基金管理有限公司。2018 年 1 月进入长城基金管理有限公司，曾任量化研究员。

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》、《长城中证 500 指数增强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 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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 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。

4.3.3 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，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

2018 年, 我国宏观经济面临的外部环境错综复杂, 美国经济继续保持强劲增长, 欧元区则逐步

走弱,自 3 月份开始中美贸易关系渐趋紧张,4 月份美国出台对华加征关税措施后贸易摩擦不断加重,并贯穿全年,直至年末两国元首会晤后重启谈判才暂时缓解。美联储全年进行了四次加息,人民币对美元汇率也先升后降,全年波动幅度较大。在外需出现波动的情况下,国内投资和消费也逐步走弱,全年官方 PMI 呈现稳步回落态势,并在年末跌至 49.4 的低点,这是 2016 年以来首次跌至荣枯线下方。宏观经济走弱,汇率波动,外资跨境流动波动加大,信用违约频发,股权质押爆仓风险增加,药品集中招标采购试点价格降幅超出预期,这些因素叠加在一起,打击了投资者的信心。A 股市场全年震荡下跌,录得史上第二大年度跌幅。全年沪深 300 指数涨幅-25.31%,上证 50 指数涨幅-19.83%,中小板指涨幅-37.75%,创业板指涨幅-28.65%。

本基金自 2018 年 8 月 13 日正式变更成为以中证 500 指数为跟踪标的指数增强型基金。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

转型后:

长城中证 500 指数比较基准涨幅为-16.31%,本基金净值增长率为 -20.47%

转型前:

长城中小 300 基金比较基准涨幅为: -19.91%,净值增长率为-17.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年,我国面临的外部环境虽难言缓解,但是预计不会进一步恶化。美国大规模税改法案带来的减税效应将逐步弱化,美国经济增速大概率会回落,美联储也很有可能放慢加息的步伐,人民币汇率压力有望缓解。欧元区虽然也困难重重,预计也不会更差。中美贸易摩擦尽管前景仍不明朗,但预计对实体经济和资本市场的影响也会弱于 2018 年。货币政策预计将保持适度宽松,财政政策也有望更加积极。证券市场也一定程度上已经反映了对诸多方面的悲观预期。随着国内大规模减税降费政策的不断落地,投资、消费的逐步企稳回升,投资者的信心将逐步恢复。综上所述,2019 年国内证券市场面临的宏观政策环境有望好于 2018 年。随着国内资本市场制度建设的不断完善、对外开放不断深化,长期资金的持续引入,那些具有核心竞争力、研发

创新突出、长期成长性良好的个股将成为市场的稀缺标的和中流砥柱。我们对中国证券市场的长期发展越来越充满信心。

我们将通过对基金合同的严格遵守，对跟踪误差的严格控制，将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。本基金将继续按照基金合同的规定，努力控制跟踪偏差，争取获得适度超越目标指数的超额收益。

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估值委员会，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估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、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其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的从业经验，具有良好的专业能力，并能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，向受托资产估值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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本基金于 2018 年 8 月 13 日转型，该日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。转型前的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金，自 2018 年 01 月 02 日起至 2018 年 01 月 31 日止连续 22 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元，自 2018 年 02 月 05 日起至 2018 年 08 月 10 日止连续 129 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。转型后的长城中证 500 指数增强型证券投资基金自 2018 年 08 月 13 日起至 2018 年 10 月 29 日止连续 52 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元，自 2018 年 11 月 06 日起至 2018 年 12 月 29 日止连续 40 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告（转型后）

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告（转型前）

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款		995,674.59
结算备付金		76,212.72
存出保证金		10,547.02
交易性金融资产		14,045,692.97
其中：股票投资		14,045,692.97
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		-
买入返售金融资产		-
应收证券清算款		-
应收利息		254.10
应收股利		-
应收申购款		17,078.72
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		15,145,460.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 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		-
应付赎回款		1,344.25
应付管理人报酬		12,997.42
应付托管费		1,949.61
应付销售服务费		-
应付交易费用		29,988.06
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		238,493.86
负债合计		284,773.20
所有者权益：		
实收基金		15,475,892.60
未分配利润		-615,205.68
所有者权益合计		14,860,686.92
负债和所有者权益总计		15,145,460.12

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值为 0.7935 元，基金份额总额为 18,728,350.38 份。

2. 本基金合同于 2018 年 08 月 13 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.2 利润表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-2,638,340.46
1. 利息收入		9,939.63
其中：存款利息收入		9,939.63
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,370,217.57
其中：股票投资收益		-2,393,319.45
基金投资收益		-
债券投资收益		-
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		23,101.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-465,191.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）		187,128.99
减：二、费用		291,266.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	67,757.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,196.13
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		84,663.10
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		128,650.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,929,606.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,929,606.99

注：本基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）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）	14,055,442.06	2,916,729.60	16,972,171.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,929,606.99	-2,929,606.99
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）	1,420,450.54	-602,328.29	818,122.25
其中：1. 基金申购款	38,898,364.50	-11,097.13	38,887,267.37
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-37,477,913.96	-591,231.16	-38,069,145.12
五、期末所有者权益（基金净值）	15,475,892.60	-615,205.68	14,860,686.92

注：本基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

附注为本财务报表的组成部分。

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：

<u>王军</u>	<u>熊科金</u>	<u>赵永强</u>
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

长城中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”),是根据中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”及原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金(以下简称“久兆中小板基金”)基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》,由原久兆中小板基金转型而来。原久兆中小板基金为契约型开放式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限不定,首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。根据深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》,自 2018 年 8 月 6 日起,久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。根据久兆中小板基金基金份额持有人大会的授权,管理人自 2018 年 8 月 6 日至 2018 年 8 月 13 日对久兆中小板基金实施转型与基金份额转换。基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成,久兆中小板基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”,原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止,《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金,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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市后,基金管理人于 2018 年 8 月 6 日(份额转换起始日)将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换为久兆 300 份额的场内份额;于 2018 年 8 月 13 日(份额转换基准日)将久兆 300 份额的场内份额、久兆 300 份额的场外份额转换为份额净值为 1.0000 元的本基金基金份额。基金份额转换后,本基金份额数保留到小数点后 2 位,小数点后第 3 位截位,由此产生的计算误差归入基金财产。

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)。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 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：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 08 月 13 日至 2018 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 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 2018 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

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

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)”。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：后

(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为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为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) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

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
中国建设银行	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
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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 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8月13日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	63,540,613.14	100.00%

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本年度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：本基金于本年度未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本期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8月13日(基金合同生效日)至2018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	47,759.23	100.00%	29,988.06	100.00%

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。

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8月13日(基金合同生效日)至2018年12月31日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	67,757.12
其中：支付销售机构的客户维护费	12,979.18

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,196.13

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 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

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未运用固有资金投资于本基金，于本期末亦未持有本基金份额。本基金的基金合同生效日为 2018 年 8 月 13 日，无上年度可比期间数据。

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未持有本基金份额。本基金的基金合同生效日为 2018 年 8 月 13 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 8 月 13 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
中国建设银行	995,674.59	9,385.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：本基金于本期末未在承销期内直接购入关联方承销证券。

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：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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**

截至本报告期末 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，无质押债券。

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，无质押债券。

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、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 14,045,692.97 元，划分为第二层次的余额为人民币 0.00 元，无划分为第三层次的余额。

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划分为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) 截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 14,860,686.92 元，已连续超过 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。

(3) 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 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2018 年 8 月 12 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 8 月 12 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		1,303,653.96	2,331,907.54
结算备付金		1,122.27	-
存出保证金		5,562.62	1,107.34
交易性金融资产		15,896,413.81	21,540,695.96
其中：股票投资		15,896,413.81	21,540,695.96
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		6,610,788.51	-
应收利息		1,651.28	520.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	943.67
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		23,819,192.45	23,875,174.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 8 月 12 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		6,703,929.87	-
应付赎回款		-	89,201.83
应付管理人报酬		5,573.38	23,842.10
应付托管费		1,226.14	5,245.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		25,823.56	1,528.92
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		110,467.84	240,329.23
负债合计		6,847,020.79	360,147.35
所有者权益：			
实收基金		14,055,442.06	16,002,610.57
未分配利润		2,916,729.60	7,512,416.98
所有者权益合计		16,972,171.66	23,515,027.55
负债和所有者权益总计		23,819,192.45	23,875,174.90

注：1. 报告截止日 2018 年 8 月 12 日（基金合同失效前日），长城久兆中小板 300 指数分级份额净值人民币 0.874 元，基金份额总额为 19,420,400.59 份。

2. 自 2018 年 8 月 13 日起，由《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效。

7.2 利润表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-4,049,468.43	1,750,633.27
1. 利息收入		19,894.54	31,607.12
其中：存款利息收入		19,894.54	31,601.33
债券利息收入		-	5.79
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）		-6,250,705.99	-2,438,363.27
其中：股票投资收益		-6,411,465.79	-2,622,977.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	2,289.81
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		160,759.80	182,324.35

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,106,314.41	3,985,412.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		75,028.61	171,976.62
减：二、费用		586,207.49	820,941.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	142,539.97	277,884.07
2. 托管费	7.4.10.2.2	31,358.83	61,134.47
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		83,825.65	29,597.42
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		328,483.04	452,325.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,635,675.92	929,691.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,635,675.92	929,691.88

注：本基金合同终止日为 2018 年 8 月 12 日，本期是指 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 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）	16,002,610.57	7,512,416.98	23,515,027.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,635,675.92	-4,635,675.92
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）	-1,947,168.51	39,988.54	-1,907,179.97
其中：1. 基金申购款	42,430,834.67	17,807,086.69	60,237,921.36
2. 基金赎回款	-44,378,003.18	-17,767,098.15	-62,145,101.33

五、期末所有者权益（基金净值）	14,055,442.06	2,916,729.60	16,972,171.66
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）	20,299,917.77	8,331,476.35	28,631,394.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	929,691.88	929,691.88
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）	-4,297,307.20	-1,748,751.25	-6,046,058.45
其中：1. 基金申购款	92,186,056.72	41,713,389.77	133,899,446.49
2. 基金赎回款	-96,483,363.92	-43,462,141.02	-139,945,504.94
五、期末所有者权益（基金净值）	16,002,610.57	7,512,416.98	23,515,027.55

注：本基金合同终止日为 2018 年 8 月 12 日，本期是指 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 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：

<u>王军</u>	<u>熊科金</u>	<u>赵永强</u>
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

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2011]1474 号“关于核准长城久兆中小板 300 指数分级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发行募集，首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。基金合同于 2012 年 01 月 30 日正式生效。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，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）。

本基金的基金份额包括长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“久兆 300 份额”）、“久兆稳健份额”与“久兆积极份额”。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为久兆 300 份额；场内认购的全部份额将按照基金合同约定比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。久兆 300 份额设置单独的基金代码，只接受场外与场内申购和赎回；久兆稳健份额、久兆积极份额交易代码不同，只上市交易，不接受申购和赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及基金合同等法律文件的规定，长城基金管理有限公司决定自 2015 年 6 月 8 日起将长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由“久兆稳健”（代码：150057）变更为“中小 300A”，将长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称“久兆积极”（代码：150058）变更为“中小 300B”。

本基金四份中小 300A 份额与六份中小 300B 份额的参考净值之和将等于十份久兆 300 份额的净值。中小 300A 份额的约定收益率为 5.8%。中小 300A 份额的约定收益率除以 365 得到中小 300A 份额的约定日简单收益率。中小 300A 份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用中小 300A 份额的约定日简单收益率单利进行计算。计算出中小 300A 份额的份额参考净值后，根据久兆 300 份额、中小 300A 份额、中小 300B 份额净值的关系，可以计算出中小 300B 份额的份额参考净值。

定期份额折算：自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止，本基金将按照基金合同规定进行基金的定期份额折算。本基金进行定期份额折算后，中小 300A 份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆 300 份额分配给中小 300A 份额持有人，中小 300A 份额的份额参考净值调整为 1.000 元；久兆 300 份额持有人持有的每十份久兆 300 份额将按四份中小 300A 份额获得新增久兆 300 份额的分配，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。

经过定期份额折算，久兆 300 份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，中小 300B 份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

不定期份额折算：本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或中小 300B 份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照基金合同规定进行基金的不定期份额折算。当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。不定期份额折

算后，持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应增加，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。持有人持有的中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额数在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

当中小 300B 份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及中小 300A 份额与中小 300B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应减少，中小 300B 份额持有人持有的中小 300B 份额数按照中小 300B 份额的折算比例相应减少。为保持中小 300A 份额和中小 300B 份额比例不变，中小 300A 份额的折算比例与中小 300B 份额相同，中小 300A 份额持有人持有的中小 300A 份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，中小 300A 份额和中小 300B 份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

根据中国证监会 2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》、深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》，自 2018 年 8 月 6 日起，本基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。

中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市后，基金管理人于 2018 年 8 月 6 日（份额转换起始日）将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换为久兆 300 份额的场内份额；于 2018 年 8 月 13 日（份额转换基准日）将久兆 300 份额的场内份额、久兆 300 份额的场外份额转换为份额净值为 1.0000 元的长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额。

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额转换结果公告》，本基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成，本基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）

指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

本基金的业绩比较基准为：中小板 300（价格）指数收益率 \times 95%+活期存款利率（税后） \times 5%。

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 08 月 12 日的财务状况以及自 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 8 月 12 日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、会计估计与最近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的说明

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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、基金销售机构
中国建设银行	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
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：于本期，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 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8月12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	27,335,615.73	49.97%	-	-

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本年度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：本基金于本年度及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于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8月12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	25,457.54	49.97%	25,457.54	98.58%
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	-	-	-	-

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。

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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日	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	142,539.97	277,884.07
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	40,129.03	77,091.73

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 8 月 12 日	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	31,358.83	61,134.47

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 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

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8月12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
中国建设银行	1,303,653.96	19,221.23	2,331,907.54	29,996.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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证券。

7.4.9 期末（2018年8月12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

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项停牌	17.08	2018年11月6日	15.31	15,073	274,327.34	257,446.84	-
002075	沙钢股份	2016年9月	重大事项停牌	21.31	2018年	14.48	7,800	112,008.00	166,218.00	-

		19 日			11 月 16 日						
002739	万达电 影	2017 年 7 月 4 日	重大事 项停牌	23.79	2018 年 11 月 5 日	31.10	6,003	303,820.06	142,811.37		
002408	齐翔腾 达	2018 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	12.28	2018 年 11 月 14 日	11.05	6,729	56,410.85	82,632.12		
002310	东方园 林	2018 年 5 月 25 日	重大事 项停牌	14.97	2018 年 8 月 27 日	13.47	5,333	68,109.86	79,835.01		
002573	清新环 境	2018 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	11.45	2018 年 10 月 11 日	10.31	5,669	117,677.51	64,910.05		
002602	世纪华 通	2018 年 6 月 12 日	重大事 项停牌	32.50	2018 年 11 月 7 日	18.23	1,800	35,010.00	58,500.00		
002665	首航节 能	2018 年 5 月 29 日	重大事 项停牌	5.80	2018 年 11 月 5 日	5.22	9,459	89,848.65	54,862.20		
002630	华西能 源	2018 年 6 月 18 日	重大事 项停牌	6.54	2018 年 9 月 19 日	5.90	8,080	64,649.15	52,843.20		
002051	中工国 际	2018 年 4 月 9 日	重大事 项停牌	15.27	2018 年 9 月 25 日	13.74	3,331	61,474.61	50,864.37		
002716	金贵银 业	2018 年 5 月 3 日	重大事 项停牌	9.85	2018 年 8 月 31 日	8.87	4,593	34,419.10	45,241.05		
002437	誉衡药 业	2018 年 6 月 11 日	重大事 项停牌	6.19	2018 年 8 月 13 日	5.57	7,019	69,284.64	43,447.61		
002263	*ST 东 南	2018 年 2 月	重大事 项停牌	2.96	2018 年	2.81	14,318	62,781.64	42,381.28		

		26 日			8 月 28 日						
002147	新光圆成	2018 年 1 月 18 日	重大事项停牌	14.76	2018 年 11 月 1 日	13.28	2,500	29,788.46	36,900.00		
002477	雏鹰农牧	2018 年 6 月 14 日	重大事项停牌	3.29	2018 年 9 月 13 日	2.96	10,185	57,078.56	33,508.65		
002431	棕榈股份	2018 年 5 月 30 日	重大事项停牌	6.71	2018 年 8 月 30 日	6.04	4,983	49,864.24	33,435.93		
002512	达华智能	2018 年 6 月 19 日	重大事项停牌	9.66	2018 年 11 月 19 日	8.69	3,200	51,232.00	30,912.00		
002436	兴森科技	2018 年 6 月 14 日	重大事项停牌	4.29	2018 年 9 月 20 日	3.86	7,021	53,734.34	30,120.09		
002102	冠福股份	2018 年 6 月 1 日	重大事项停牌	4.02	2018 年 8 月 30 日	3.62	7,100	32,442.74	28,542.00		
002502	骅威文化	2018 年 6 月 5 日	重大事项停牌	5.77	2018 年 11 月 22 日	5.19	3,501	42,450.44	20,200.77		
002011	盾安环境	2018 年 5 月 2 日	重大事项停牌	6.40	2018 年 10 月 8 日	5.76	2,800	22,073.94	17,920.00		
002610	爱康科技	2018 年 6 月 5 日	重大事项停牌	2.10	2018 年 10 月 8 日	1.89	900	2,899.91	1,890.00		

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

截至本报告期末 2018 年 8 月 12 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 08 月 12 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, 无质押债券。

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、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 8 月 12 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 14,520,991.27 元, 划分为第二层次的余额为人民币 1,375,422.54 元, 无划分为第三层次的余额。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 20,580,018.80 元, 划分为第二层次的余额为人民币 960,677.16 元, 无划分为第三层次的余额。

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划分为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) 截至资产负债表日, 本基金的资产净值为人民币 16,972,171.66 元, 已连续超过 20 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。

(3) 除上述事项外, 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	14,045,692.97	92.74
	其中：股票	14,045,692.97	92.74
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	1,071,887.31	7.08
8	其他各项资产	27,879.84	0.18
9	合计	15,145,460.12	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	213,366.00	1.44
B	采矿业	571,787.00	3.85
C	制造业	6,480,926.32	43.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	253,344.00	1.70
E	建筑业	216,612.00	1.46
F	批发和零售业	469,031.00	3.16
G	交通运输、仓储和邮政业	279,909.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	705,609.00	4.75

	务业		
J	金融业	272,642.00	1.83
K	房地产业	487,744.00	3.28
L	租赁和商务服务业	424,260.00	2.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	221,645.00	1.49
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	516,928.00	3.48
S	综合	196,539.00	1.32
	合计	11,310,342.32	76.11

8.2.2 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	67,384.00	0.45
C	制造业	2,006,285.65	13.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	34,600.00	0.23
F	批发和零售业	96,568.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	176,877.00	1.19
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	107,588.00	0.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	67,590.00	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	141,226.00	0.95
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	37,232.00	0.25
S	综合	-	-

合计	2,735,350.65	18.41
----	--------------	-------

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	601928	凤凰传媒	35,200	279,488.00	1.88
2	000975	银泰资源	27,200	277,168.00	1.87
3	000656	金科股份	43,200	267,408.00	1.80
4	600161	天坛生物	12,300	261,375.00	1.76
5	601016	节能风电	109,200	253,344.00	1.70
6	002242	九阳股份	15,800	252,958.00	1.70
7	000049	德赛电池	8,600	246,648.00	1.66
8	600160	巨化股份	37,000	245,310.00	1.65
9	300133	华策影视	26,500	237,440.00	1.60
10	600312	平高电气	28,700	231,896.00	1.56

8.3.2 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前五名股票投资明细

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	603043	广州酒家	1,500	40,620.00	0.27
2	600305	恒顺醋业	3,800	39,520.00	0.27
3	603338	浙江鼎力	700	39,424.00	0.27
4	603985	恒润股份	1,900	39,330.00	0.26
5	603606	东方电缆	4,305	38,443.65	0.26
6	000301	东方盛虹	7,000	38,220.00	0.26
7	300673	佩蒂股份	900	38,070.00	0.26
8	300391	康跃科技	3,900	37,908.00	0.26
9	603313	梦百合	1,800	37,818.00	0.25
10	300725	药石科技	700	37,681.00	0.25

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	600673	东阳光科	485,192.00	3.26
2	000528	柳工	472,521.00	3.18
3	600056	中国医药	451,015.50	3.03
4	600563	法拉电子	445,996.00	3.00
5	002191	劲嘉股份	439,297.00	2.96
6	600694	大商股份	422,770.00	2.84
7	601689	拓普集团	391,994.00	2.64
8	002410	广联达	319,001.00	2.15
9	601128	常熟银行	298,851.00	2.01
10	002463	沪电股份	298,745.00	2.01
11	600808	马钢股份	295,744.00	1.99
12	600760	中航沈飞	295,580.00	1.99
13	601717	郑煤机	287,839.00	1.94
14	601233	桐昆股份	280,815.00	1.89
15	601016	节能风电	277,368.00	1.87
16	000062	深圳华强	273,178.00	1.84
17	600633	浙数文化	271,004.00	1.82
18	600161	天坛生物	270,716.00	1.82
19	300058	蓝色光标	268,940.00	1.81
20	002028	思源电气	264,370.00	1.78

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	600673	东阳光科	509,162.00	3.43
2	600563	法拉电子	449,362.00	3.02
3	600808	马钢股份	435,485.00	2.93

4	002191	劲嘉股份	429,114.00	2.89
5	600282	南钢股份	364,683.00	2.45
6	601128	常熟银行	336,718.00	2.27
7	002463	沪电股份	319,082.00	2.15
8	002110	三钢闽光	315,380.00	2.12
9	600064	南京高科	279,357.00	1.88
10	002410	广联达	275,041.00	1.85
11	600633	浙数文化	273,292.00	1.84
12	601717	郑煤机	262,479.00	1.77
13	002028	思源电气	259,530.00	1.75
14	002332	仙琚制药	257,328.00	1.73
15	600757	长江传媒	256,711.00	1.73
16	600422	昆药集团	243,421.00	1.64
17	603228	景旺电子	241,771.00	1.63
18	600611	大众交通	237,382.00	1.60
19	600179	安通控股	234,084.00	1.58
20	000860	顺鑫农业	232,415.00	1.56

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	32,274,201.63
卖出股票收入（成交）总额	31,266,411.51

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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：本基金本报告期末未投资股指期货，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：本基金本报告期末未进行国债期货投资，本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。

8.12.2 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	10,547.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	254.10
5	应收申购款	17,078.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,879.84

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末积极投资前五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。

§8 投资组合报告（转型前）

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	15,896,413.81	66.74
	其中：股票	15,896,413.81	66.74
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	1,304,776.23	5.48
8	其他资产	6,618,002.41	27.78
9	合计	23,819,192.45	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	33,508.65	0.20
B	采矿业	157,538.24	0.93
C	制造业	2,380,125.43	14.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	164,135.31	0.97
F	批发和零售业	42,168.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	752.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	303,838.25	1.79

J	金融业	-	-
K	房地产业	208,270.00	1.23
L	租赁和商务服务业	307,663.00	1.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	64,910.05	0.38
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	142,811.37	0.84
S	综合	-	-
	合计	3,805,721.24	22.42

8.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	42,968.00	0.25
B	采掘业	330,770.00	1.95
C	制造业	6,931,428.80	40.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	660,606.00	3.89
E	建筑业	82,509.00	0.49
F	批发和零售业	747,534.00	4.40
G	交通运输、仓储和邮政业	536,899.00	3.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	655,556.00	3.86
J	金融业	496,985.00	2.93
K	房地产业	794,408.00	4.68
L	租赁和商务服务业	209,470.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	165,788.00	0.98
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	435,770.77	2.57
S	综合	-	-
	合计	12,090,692.57	71.24

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	002450	康得新	15,073.00	257,446.84	1.52
2	002503	搜于特	76,204.00	256,045.44	1.51
3	002110	三钢闽光	10,900.00	217,782.00	1.28
4	002701	奥瑞金	38,943.00	214,186.50	1.26
5	002233	塔牌集团	15,400.00	208,516.00	1.23
6	002244	滨江集团	34,274.00	171,370.00	1.01
7	002180	纳思达	5,600.00	166,768.00	0.98
8	002075	沙钢股份	7,800.00	166,218.00	0.98
9	002517	恺英网络	28,600.00	166,166.00	0.98
10	002818	富森美	6,500.00	162,955.00	0.96

8.3.2 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	600578	京能电力	65,700.00	212,868.00	1.25
2	000519	中兵红箭	26,400.00	211,200.00	1.24
3	603025	大豪科技	10,800.00	206,604.00	1.22
4	000078	海王生物	48,800.00	206,424.00	1.22
5	600801	华新水泥	9,600.00	205,824.00	1.21
6	601016	节能风电	68,300.00	204,900.00	1.21
7	601717	郑煤机	34,100.00	203,577.00	1.20
8	000006	深振业 A	29,200.00	169,068.00	1.00
9	603225	新凤鸣	7,600.00	168,416.00	0.99
10	600179	安通控股	17,000.00	168,130.00	0.99

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	002035	华帝股份	1,365,854.00	5.81
2	002027	分众传媒	1,190,408.00	5.06
3	002475	立讯精密	960,043.00	4.08
4	002236	大华股份	750,474.00	3.19
5	002572	索菲亚	727,951.00	3.10
6	002008	大族激光	720,857.00	3.07
7	002399	海普瑞	714,047.00	3.04
8	002110	三钢闽光	621,969.00	2.64
9	002032	苏泊尔	568,702.05	2.42
10	002384	东山精密	566,030.00	2.41
11	002410	广联达	554,767.00	2.36
12	002415	海康威视	415,828.00	1.77
13	002709	天赐材料	245,374.98	1.04
14	002503	搜于特	242,763.00	1.03
15	600578	京能电力	212,956.00	0.91
16	002233	塔牌集团	211,752.00	0.90
17	000519	中兵红箭	207,872.00	0.88
18	000078	海王生物	207,520.00	0.88
19	603025	大豪科技	205,222.00	0.87
20	601016	节能风电	204,867.00	0.87

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	002415	海康威视	1,369,476.36	5.82
2	002027	分众传媒	1,336,352.84	5.68
3	002035	华帝股份	1,202,818.33	5.12
4	002475	立讯精密	1,120,480.94	4.76
5	002008	大族激光	1,061,960.78	4.52

6	002236	大华股份	932,603.20	3.97
7	002572	索菲亚	866,866.00	3.69
8	002410	广联达	727,992.52	3.10
9	002304	洋河股份	649,174.50	2.76
10	002384	东山精密	609,204.00	2.59
11	002032	苏泊尔	604,940.80	2.57
12	002399	海普瑞	574,109.40	2.44
13	002110	三钢闽光	475,113.00	2.02
14	002230	科大讯飞	421,706.48	1.79
15	002456	欧菲科技	420,117.66	1.79
16	002024	苏宁易购	392,360.52	1.67
17	002202	金风科技	343,637.43	1.46
18	002142	宁波银行	278,908.12	1.19
19	002271	东方雨虹	256,599.68	1.09
20	002466	天齐锂业	248,617.76	1.06

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	26,683,973.81
卖出股票收入（成交）总额	28,023,104.58

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

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，本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。

8.12.2 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 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	5,562.62
2	应收证券清算款	6,610,788.51
3	应收股利	-
4	应收利息	1,651.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,618,002.41

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002450	康得新	257,446.84	1.52	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	166,218.00	0.98	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

本基金期末积极投资前五名股票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。

§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	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
1,240	15,103.51	5,917,780.95	31.60%	12,810,569.43	68.40%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,338.95	0.0285%

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。

§9 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	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
2,555	7,600.94	68,919.00	0.35%	19,351,481.59	99.65%

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

基金转型日基金份额总额	19,420,400.59
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	47,077,825.62
减:基金合同转型日起至报告期期末基金总赎回份额	45,360,493.17
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)	-2,409,382.66
本报告期期末基金份额总额	18,728,350.38

§ 10 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	965,942,785.13
本报告期期初基金份额总额	21,638,175.21
本报告期期间基金总申购份额	58,607,364.06
减:本报告期期间基金总赎回份额	61,247,904.86
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	422,766.18
本报告期期末基金份额总额	19,420,400.59

§11 重大事件揭示

11.1 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久兆中小板 300 指数分级证券投资基金份额持有人大会，于 2018 年 7 月 5 日表决通过了《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。具体内容详见本管理人于 2018 年 7 月 6 日发布的《长城久兆中小板 300 指数分级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 2018 年 8 月 13 日发布的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件。

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

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。

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

根据长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会决议，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金于 2018 年 8 月 6 日终止上市，由上市型基金转型为非上市基金，同时名称变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金，其投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等均发生改变。自 2018 年 8 月 13 日起，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久兆中小板 300 指数分级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、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币叁万捌仟肆佰玖拾贰元柒角伍分。
- 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

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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		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	
长城证券		563,540,613.14	100.00%	47,759.23	100.00%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

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		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
长城证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

1、截止本报告期末租用证券公司席位共计 58 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
- (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 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		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	
兴业证券	1	27,371,462.66	50.03%	25,490.90	50.03%	-
长城证券	3	27,335,615.73	49.97%	25,457.54	49.97%	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
九州证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

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		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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

九州证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共新增 2 个专用交易单元（太平洋证券新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 56 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。

§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

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	20180201-20180211	-	19,285,438.77	19,285,438.77	-	-
	2	20181030-20181105	-	24,306,028.20	24,306,028.20	-	-
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。

注：本基金由长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型而来，上表机构投资者 1 为原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金投资者。

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。