

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金
(原长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型)

2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 4 月 22 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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 04 月 18 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。

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金报告期自 2019 年 01 月 29 日起至 03 月 31 日止，原长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 01 月 28 日止。

根据 2019 年 1 月 17 日生效的基金份额持有人大会决议，自 2019 年 1 月 29 日起，本基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。详见 2019 年 1 月 29 日登载于本基金管理人网站的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》，变更后的基金合同于 2019 年 1 月 29 日生效。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长城创业板指数增强发起式
基金主代码	001879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日
报告期末基金份额总额	84,267,082.52 份
投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，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，股票投资以创业板指数作为目标指数。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	创业板指数收益率×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，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。	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	001879	006928
报告期末下属分级基金的份额总额	64,500,684.05 份	19,766,398.47 份

转型前：

基金简称	长城创新动力混合
基金主代码	001879
交易代码	001879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 1 日
报告期末基金份额总额	33,882,943.85 份
投资目标	本基金重点投资于经济发展过程中具备持续增长潜力，能够代表经济发展方向的行业龙头公司，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法进行大类资产配置。自上而下地综合分析宏观经济、政策环境、流动性指标等因素，在此基础上综合考虑决定股票市场、债券市场走向的关键因素，如对股票市场影响较大的市场流动性水平和市场波动水平等；对债券市场走势具有重大影响的未来利率变动趋势和债券的需求等。自下而上地根据可投资股票的基本面和构成情况，对自上而下大类资产配置进行进一步修正。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。 本基金创新动力主题包括新兴产业的创新和传统产业的升级两个方面。其中，新兴产业的创新主要包括新产业、新科技和新的商业模式；传统产业的升级主要包括三个层面：一是通过对传统行业进行技术改造、组织架构和治理结构调整、资产梳理与整合而实现更高效、更环保、更集约、更有竞争力的生产与经营；二是通过创新，尤其

	是信息技术的应用，使得在传统行业中产生新的业态；三是传统行业主动寻求变革，向新兴行业转型。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中债综合财富指数收益率。
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：本基金于 2019 年 01 月 29 日转型，该日起长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。

§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（2019 年 1 月 29 日 — 2019 年 3 月 31 日）	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
1. 本期已实现收益	1,736,050.72	220,667.85
2. 本期利润	9,799,631.70	932,085.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2237	0.0995
4. 期末基金资产净值	73,197,840.25	22,415,041.00
5. 期末基金份额净值	1.1348	1.1340

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 2019 年 1 月 29 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（2019 年 1 月 1 日 — 2019 年 1 月 28 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	7,510.32
2. 本期利润	36,418.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0011
4. 期末基金资产净值	29,445,240.89
5. 期末基金份额净值	0.8690

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

长城创业板指数增强发起式 A

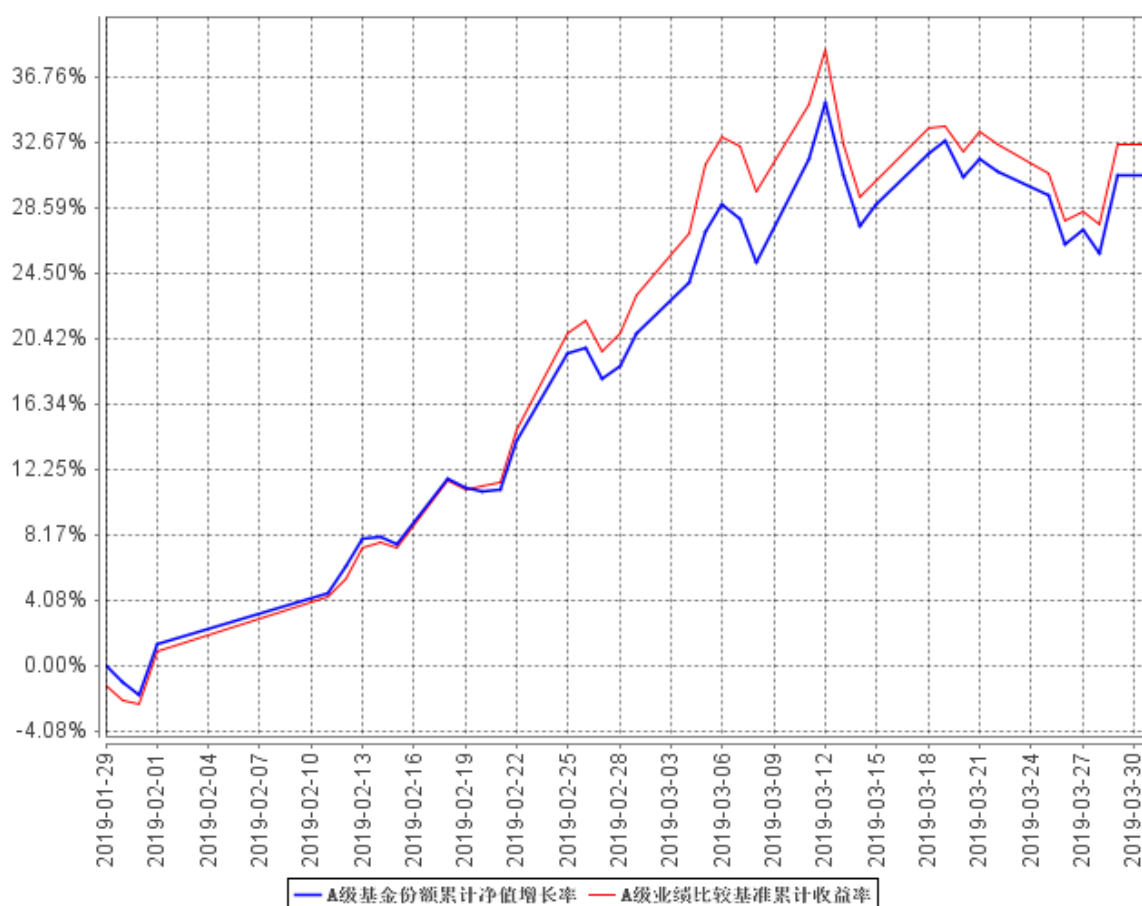
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	30.59%	2.06%	32.53%	2.12%	-1.94%	-0.06%

长城创业板指数增强发起式 C

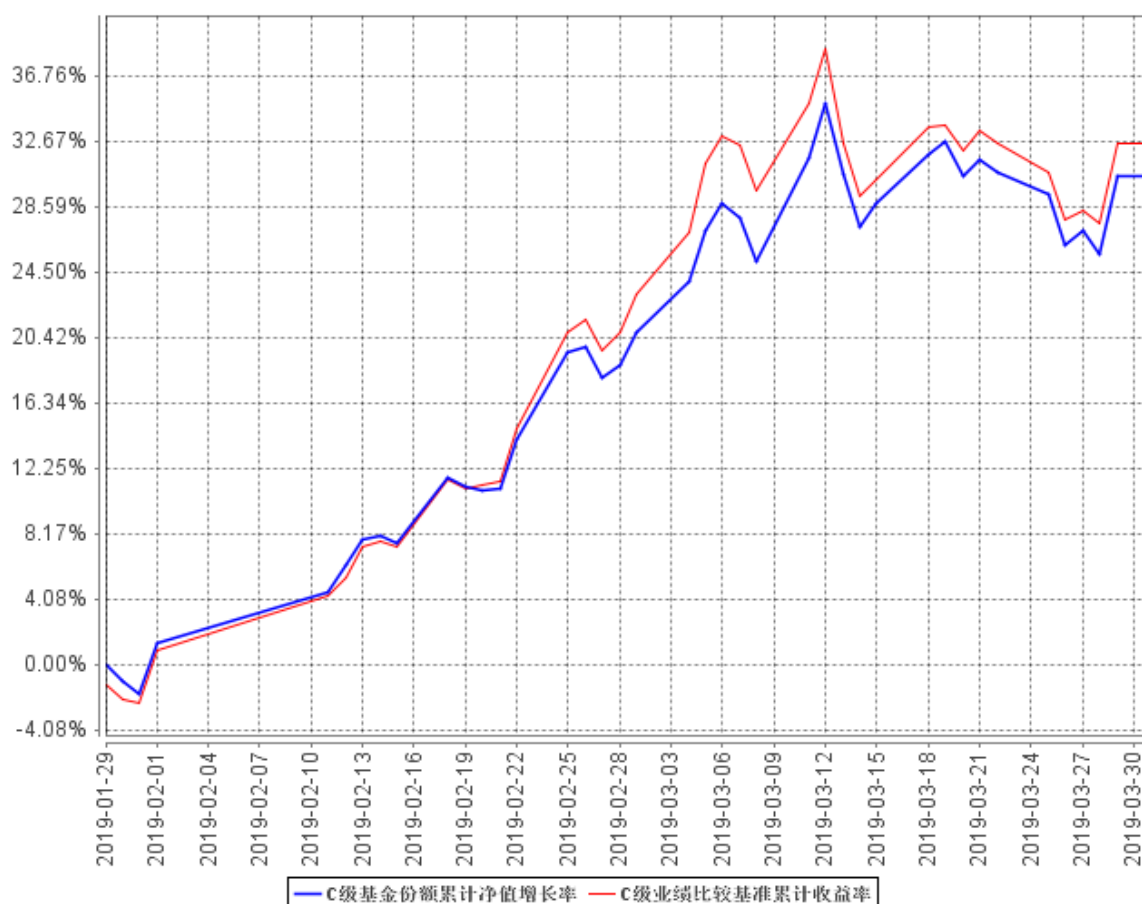
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	30.49%	2.06%	32.53%	2.12%	-2.04%	-0.06%

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本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板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 2019 年 1 月 29 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

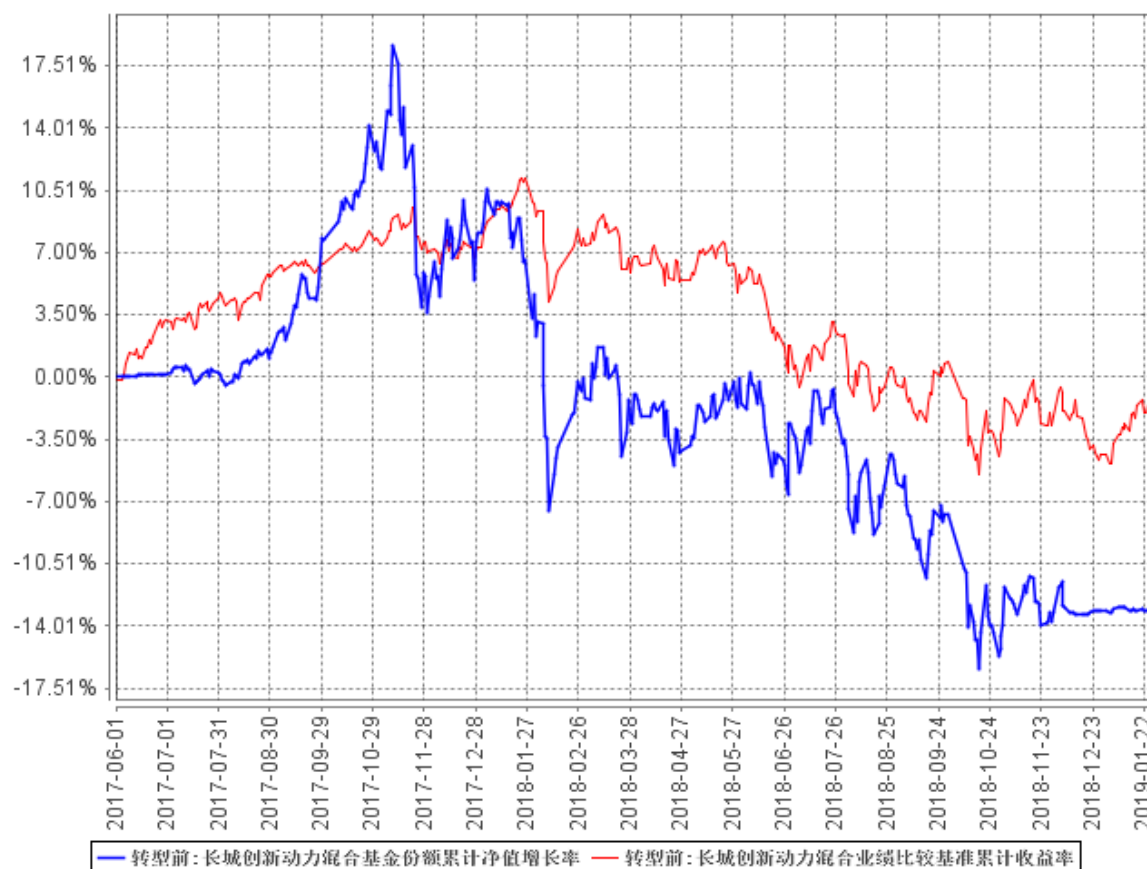
3.2 基金净值表现（转型前）

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

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	1.54%	0.62%	1.74%	0.61%	-0.20%	0.01%

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

长城创新动力混合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投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-95%，其中，投资于创新动力主题的上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金现金或者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%，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 2019 年 1 月 29 日起，由《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》生效，原《长城创新动力灵活配置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		
赵波	长城景气行业龙头混合、长城改革红利混合、长城转型成长混合、长城创新动力混合和长城久鑫混合的基金经理	2017 年 6 月 1 日	2019 年 1 月 29 日	11 年	男，伦敦大学皇家霍洛威学院理学学士、英国城市大学卡斯商学院理学硕士、中国社会科学院经济学博士。曾就职于中银国际证券有限责任公司。2011 年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城品牌优选股票型证券投资基金”基金经理助理和“长城双动力混合型证券投资基金”的基金经理。
张捷	长城创新动力混合、长城优化升级混合和长城稳健成长混合基金的基金经理	2018 年 3 月 8 日	2019 年 1 月 29 日	10 年	英国中央兰开夏大学工学学士、英国伦敦帝国理工大学理学硕士。曾就职于平安集团、柏坊资产管理有限公司、信达澳银基金管理有限公司。2014 年进入长城基金管理有限公司，曾任行业研究员、“长城安心回报混合型证券投资基金”的基金经理助理。

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		
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、	2019 年 1 月 29 日	-	11	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

	长城久泰沪深 300 指数基金和长城创业板指数增强发起式基金的基金经理				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。
--	-------------------------------------	--	--	--	-----------------------------

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》、《长城创业板指数增强型发起式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

一季度，A 股市场总体触底后急剧反弹，在流动性改善和风险偏好提升的多重作用下，市场活跃度大幅提升，市场回暖初期，小市值股票表现明显优于大市值股票；创业板指权重股表现强势，猪周期、TMT 等新兴产业权重占比较高，表现明显优于其他指数。报告期内，本基金在 1 月下旬由老基金转型成立；转型后基于对市场的判断，本基金采取了迅速建仓策略，充分紧跟市场指数表现。

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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，转型前长城创新动力混合净值增长率为 1.54%，业绩比较基准收益率为 1.74%；转型后长城创业板指数增强发起式 A 级净值增长率为 30.59%，长城创业板指数增强发起式 C 级净值增长率为 30.49%，同期业绩比较基准收益率为 32.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金于 2019 年 01 月 29 日转型，该日起长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金。本报告期内，本基金自 2019 年 01 月 29 日起至 2019 年 03 月 04 日止连续 20 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

§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	90,499,769.28	91.74
	其中：股票	90,499,769.28	91.74
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	5,846,896.32	5.93
8	其他资产	2,297,583.64	2.33
9	合计	98,644,249.24	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	8,623,440.00	9.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,737,138.00	27.96
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	21,883,671.96	22.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,482,888.00	1.55
M	科学研究和技术服务业	2,905,760.00	3.04
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	7,579,960.00	7.93
R	文化、体育和娱乐业	7,694,520.00	8.05
S	综合	-	-
	合计	76,907,377.96	80.44

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	347,976.00	0.36
B	采掘业	-	-

C	制造业	6,932,565.56	7.25
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	4,686,187.76	4.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,245,562.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	380,100.00	0.40
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	13,592,391.32	14.22

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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300498	温氏股份	212,400	8,623,440.00	9.02
2	300408	三环集团	279,600	5,798,904.00	6.06
3	300059	东方财富	285,300	5,529,114.00	5.78
4	300015	爱尔眼科	152,350	5,179,900.00	5.42
5	300383	光环新网	268,400	5,032,500.00	5.26
6	300271	华宇软件	225,870	4,804,254.90	5.02
7	300124	汇川技术	123,700	3,244,651.00	3.39
8	300012	华测检测	330,200	2,905,760.00	3.04
9	300133	华策影视	317,100	2,536,800.00	2.65
10	300122	智飞生物	48,900	2,498,790.00	2.61

5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300369	绿盟科技	100,046	1,356,623.76	1.42
2	300149	量子生物	68,000	1,187,280.00	1.24
3	300258	精锻科技	87,400	1,148,436.00	1.20
4	002124	天邦股份	64,100	1,120,468.00	1.17
5	300261	雅本化学	151,750	881,667.50	0.92

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 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

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	31,826.27
2	应收证券清算款	835,979.10
3	应收股利	-
4	应收利息	1,951.63
5	应收申购款	1,427,826.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,297,583.64

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300124	汇川技术	3,244,651.00	3.39	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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	2,160,700.00	7.30
	其中：股票	2,160,700.00	7.30
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	26,868,251.96	90.74
8	其他资产	581,831.68	1.96
9	合计	29,610,783.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,001,050.00	3.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	804,050.00	2.73
K	房地产业	183,600.00	0.62

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	172,000.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	2,160,700.00	7.34

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	400	270,800.00	0.92
1	601939	建设银行	40,000	270,800.00	0.92
2	600104	上汽集团	10,000	260,900.00	0.89
3	601818	光大银行	60,000	236,400.00	0.80
4	601128	常熟银行	33,000	210,870.00	0.72
5	600048	保利地产	15,000	183,600.00	0.62
6	300251	光线传媒	20,000	172,000.00	0.58
7	300078	思创医惠	20,000	169,400.00	0.58
8	000100	TCL 集团	60,000	164,400.00	0.56
9	300596	利安隆	5,000	135,550.00	0.46
10	600036	招商银行	3,000	85,980.00	0.29

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光大银行发行主体外，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：中国光大银行股份有限公司（简称光大银行）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。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光大银行进行了投资。

5.11.2 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

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	27,377.38
2	应收证券清算款	534,839.29
3	应收股利	-
4	应收利息	19,615.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	581,831.68

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	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
基金转型日（2019 年 1 月 29 日）基金份额总额	33,882,943.85	-
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	49,460,296.38	32,626,251.26
减：基金转型日起至报告期期末基金总	18,842,556.18	12,859,852.79

赎回份额		
报告期期末基金份额总额	64,500,684.05	19,766,398.47

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	33,989,174.66
报告期期间基金总申购份额	5,920.93
减：报告期期间基金总赎回份额	112,151.74
报告期期末基金份额总额	33,882,943.85

§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）

单位：份

基金转型日管理人持有的本基金份额	11,534,202.33
基金转型日起至报告期期末买入/申购总份额	—
基金转型日起至报告期期末卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,534,202.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	13.69

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）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,534,202.33
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,534,202.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	34.04

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型后）

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,534,202.33	13.69	11,534,202.33	13.69	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	11,534,202.33	13.69	11,534,202.33	13.69	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20190101-20190307	11, 534, 202. 33	-	-	11, 534, 202. 33	13. 6877%
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

本基金在短期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。

9.2 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。

§10 备查文件目录

备查文件目录

1. 中国证监会批准长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
2. 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4. 中国证监会准予长城创业板指数增强型发起式证券投资基金变更注册的文件
5. 《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
6. 《长城创业板指数增强型发起式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

10.2 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

10.3 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