

# 长城久兆中小板 300 指数分级 证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半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 2017 年 08 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21

6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合.....	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
7.6 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.....	65
7.7 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.....	65
7.8 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.....	65
7.9 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.....	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.12 投资组合报告附注.....	66
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>68</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
8.4 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.....	70
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>71</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>72</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	72
10.2 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.....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	72
10.4 基金投资策略的改变.....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	72
10.8 其他重大事件.....	76
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>80</b>

11.1 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 .....	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>82</b>
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金		
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	24,653,286.12 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		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金场内简称:	长城久兆	中小 300A	中小 300B
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	17,095,131.12 份	3,023,262.00 份	4,534,893.00 份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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
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	010-66275865
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	518026	100033
法定代表人	何伟	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算公司深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 层



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-1,861,194.19
本期利润	185,947.69
加权平均基金份额本期利润	0.0067
本期加权平均净值利润率	0.64%
本期基金份额净值增长率	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	4,708,924.21
期末可供分配基金份额利润	0.1910
期末基金资产净值	26,181,439.65
期末基金份额净值	1.062
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	43.60%

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“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

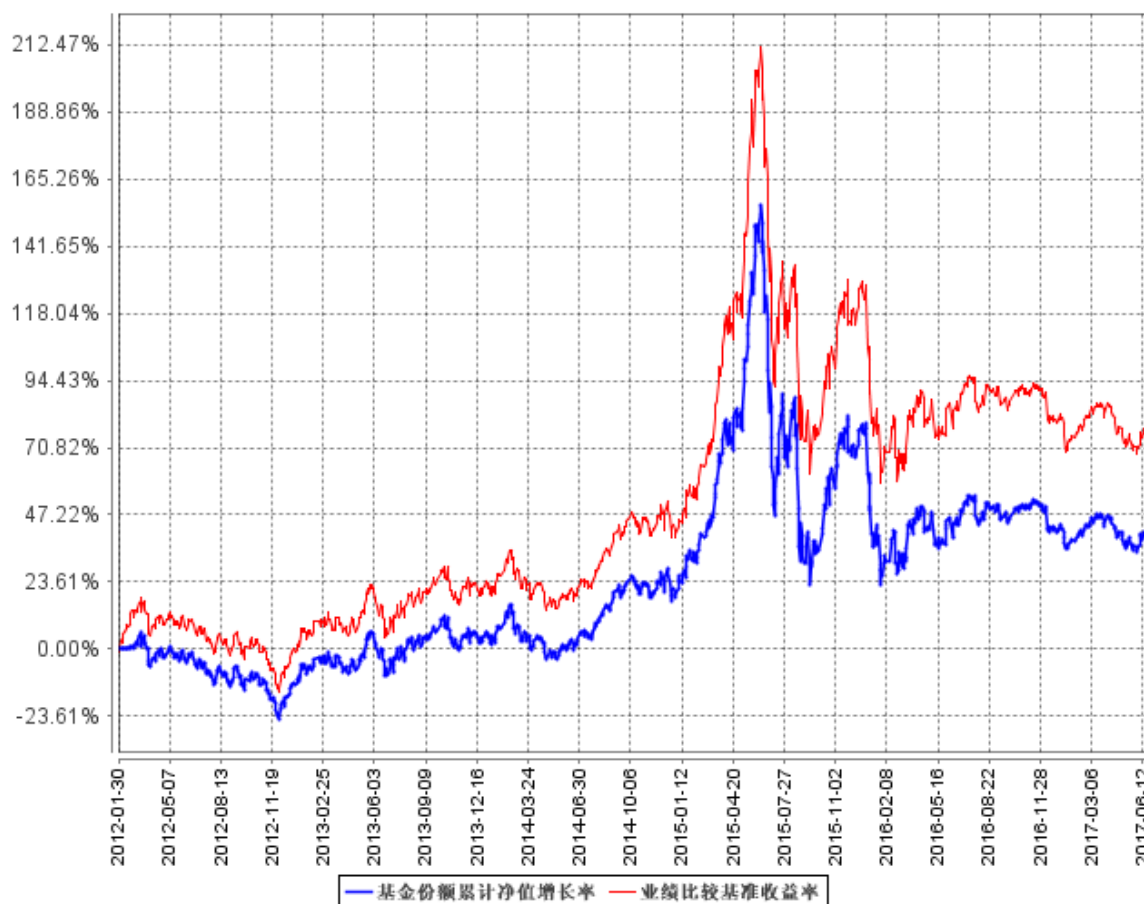
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.67%	0.84%	5.84%	0.83%	-0.17%	0.01%
过去三个月	-0.28%	0.82%	-1.08%	0.83%	0.80%	-0.01%
过去六个月	1.77%	0.75%	0.77%	0.82%	1.00%	-0.07%
过去一年	-3.30%	0.83%	-4.78%	0.85%	1.48%	-0.02%
过去三年	37.51%	2.01%	48.04%	1.90%	-10.53%	0.11%
自基金合同 生效起至今	43.60%	1.74%	80.96%	1.68%	-37.36%	0.06%

### 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

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：本基金合同规定本基金投资组合为：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%。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。

## § 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：久嘉证券投资基金（2017 年 7 月 5 日起由封闭式基金转为开放式基金，并更名为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、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本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、长城久鑫保本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、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本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、长城久益保本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。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年 限	说明
		任职日期	离任日期		
余礼冰	长城久兆 中小板 300 指数 分级证券 投资基金 的基金经 理	2012 年 4 月 17 日	2017 年 6 月 19 日	16 年	女，中国籍，华中理工大学工学硕士。曾就职于富国基金、宝盈基金、友邦华泰基金等，2007 年加入长城基金管理有限公司，曾任研究部副总经理。2012 年 1 月至 2012 年 4 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理助理，自 2012 年 4 月至 2017 年 6 月 19 日任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理。
杨建华	公司副总 经理、投 资总监、 基金管理 部总经 理、研究 部总经	2017 年 6 月 19 日	-	17 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

	理、长城久泰、长城品牌和长城久兆的基金经理				资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“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”基金经理、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。
--	-----------------------	--	--	--	---

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。

#### 4.2 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》、《长城久兆中小板 300 指数分级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 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

本基金之母基金是跟踪标的为中小板 300 指数的标准指数基金，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。本基金报告期内严格遵守基金合同，控制跟踪误差，策略基本得当。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金报告期净值收益率为 1.77%，本基金比较基准收益率为 0.77%，与比较基准相比超额收益为 1.00%。本基金年初至报告期末日均跟踪误差为 0.2813%，年化跟踪误差为 4.3428%。受到基金规模波动和部分成分股长期停牌的影响，跟踪误差有所扩大。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断外需、内需、制造业投资仍能维持目前的景气态势，宏观经济仍将保持平稳。关注企业价值的投资风格仍将延续，总体判断 A 股市场仍将维持震荡分化走势。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。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究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，对没有市价的投资品种综合宏观经济、

行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果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。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、剪操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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，由其按约定提供债券品种的估值数据。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定：

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。

### 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

本报告期内，本基金自 2017 年 1 月 23 日起至 2017 年 4 月 18 日止连续 56 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元，自 2017 年 4 月 24 日起至 2017 年 6 月 30 日止连续 48 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。

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》，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。

### 5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,816,258.75	1,383,249.64
结算备付金		-	-
存出保证金		1,533.46	1,034.05
交易性金融资产	6.4.7.2	24,571,673.35	27,378,900.66
其中：股票投资		24,571,673.35	27,378,900.66
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	371.10	332.80
应收股利		-	-
应收申购款		356.37	1,108.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,390,193.03	28,764,625.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		49.00	-
应付赎回款		4,237.57	12,400.37
应付管理人报酬		21,240.32	24,950.31
应付托管费		4,672.89	5,489.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,570.27	368.66
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	173,983.33	90,023.32
负债合计		208,753.38	133,231.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	18,235,693.99	20,299,917.77
未分配利润	6.4.7.10	7,945,745.66	8,331,476.35
所有者权益合计		26,181,439.65	28,631,394.12
负债和所有者权益总计		26,390,193.03	28,764,625.82

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长城久兆中小板 300 指数分级份额净值 1.062 元，长城久兆稳健指数的参考份额净值 1.025 元，长城久兆积极指数的参考份额净值 1.087 元。基金份额总额为 24,653,286.12 份，其中长城久兆中小板 300 指数分级份额 17,095,131.12 份，长城久兆稳健指数份额 3,023,262.00 份，长城久兆积极指数份额 4,534,893.00 份。

## 6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		607,445.39	-5,543,791.68
1.利息收入		14,957.76	11,386.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,957.30	11,377.12
债券利息收入		0.46	9.31
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）		-1,520,459.50	-1,381,560.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,661,538.63	-1,552,354.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	521.84	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	140,557.29	170,793.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,047,141.88	-4,238,606.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	65,805.25	64,988.97
<b>减：二、费用</b>		421,497.70	454,570.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	143,580.65	160,712.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	31,587.73	35,356.72

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	21,355.18	32,485.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	224,974.14	226,015.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		185,947.69	-5,998,362.00
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		185,947.69	-5,998,362.00

### 6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	-	185,947.69	185,947.69
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）	-2,064,223.78	-571,678.38	-2,635,902.16
其中：1.基金申购款	36,249,819.52	14,579,892.15	50,829,711.67
2.基金赎回款	-38,314,043.30	-15,151,570.53	-53,465,613.83

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）	18,235,693.99	7,945,745.66	26,181,439.65
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30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）	21,323,709.39	16,127,716.71	37,451,426.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,998,362.00	-5,998,362.00
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）	145,492.16	290,144.43	435,636.59
其中：1.基金申购款	39,173,033.48	13,455,260.45	52,628,293.93
2.基金赎回款	-39,027,541.32	-13,165,116.02	-52,192,657.34
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）	21,469,201.55	10,419,499.14	31,888,700.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨光裕</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）2011 年 9 月 15 日下发的证监许可【2011】1474 号文“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作为管理人自 2011 年 12 月 19 日至 2012 年 1 月 17 日止向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60737541\_H01 号验资报告。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 965,751,817.91 元，折合 965,751,817.91 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 190,967.22 元，折合 190,967.22 份基金份额。其中场外已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 919,615,817.91 元，折合 919,615,817.91 份基金份额，场外有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 181,884.22 元，折合 181,884.22 份基金份额；场内已收到的首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币 46,136,000.00 元，折合 46,136,000.00 份基金份额，场内有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 9,083.00 元，折合 9,083.00 份基金份额。以上实收基金（本息）合计人民币 965,942,785.13 元，折合 965,942,785.13 份基金份额。本基金的基金合同于 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



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。

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%。

#### 6.4.2 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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 3 号《半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、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。

#### 6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本基金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

本基金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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金于本期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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. 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，免征营业税。

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。管理人应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。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,816,258.75
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,816,258.75

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	29,065,367.97	24,571,673.35	-4,493,694.62
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	29,065,367.97	24,571,673.35	-4,493,694.62

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金于本期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	370.40
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.70
合计	371.10

注：其他为应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金于本期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	4,570.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,570.27

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.19
预提费用	123,974.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	173,983.33

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,844,377.77	20,299,917.77
本期申购	24,181,730.55	18,279,140.26
本期赎回(以“-”号填列)	-24,291,413.76	-18,363,206.56
2017年1月26日 基金拆分/份 额折算前	26,734,694.56	20,215,851.47
基金拆分/份额折算变动份额	602,074.88	-
本期申购	24,301,153.80	17,970,679.26
本期赎回(以“-”号填列)	-26,984,637.12	-19,950,836.74
本期末	24,653,286.12	18,235,693.99

注：1、根据长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2017 年 1 月 26 日为份额折算日，对久兆 300 份额的场外份额、场内份额和久兆稳健份额实施定期份额折算。

2、本基金本报告期申购包含基金转入的份额及金额，本期赎回包含基金转出的份额及金额。

3、根据《基金合同》规定：长城久兆中小板 300 指数分级份额只接受场外与场内申购和赎回；长城久兆稳健指数份额和长城久兆积极指数份额只上市交易，不接受申购和赎回，因此上表不再单独披露长城久兆稳健指数份额和长城久兆积极指数份额的情况。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,204,380.45	1,127,095.90	8,331,476.35
本期利润	-1,861,194.19	2,047,141.88	185,947.69
本期基金份额交易产生的变动数	-634,262.05	62,583.67	-571,678.38
其中：基金申购款	11,272,146.52	3,307,745.63	14,579,892.15
基金赎回款	-11,906,408.57	-3,245,161.96	-15,151,570.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,708,924.21	3,236,821.45	7,945,745.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,903.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	43.37
其他	1,010.24

合计	14,957.30
----	-----------

注：其他包括申购款利息收入 1,000.14 元以及结算保证金利息收入 10.10 元。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	8,106,044.67
减：卖出股票成本总额	9,767,583.30
买卖股票差价收入	-1,661,538.63

##### 6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,822.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,300.00
减：应收利息总额	0.46
买卖债券差价收入	521.84

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

##### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未发生贵金属投资，本期末持有数量及金额均为零，无收益/损失。



### 6.4.7.15 衍生工具收益

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金于本报告期无衍生工具投资收益/损失。

### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	140,557.29
基金投资产生的股利收益	-
合计	140,557.29

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,047,141.88
——股票投资	2,047,141.88
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,047,141.88

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	65,803.23
转出基金补偿收入	2.02
合计	65,805.25

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	21,355.18
银行间市场交易费用	-
合计	21,355.18

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	74,385.57
银行费用	640.00
指数使用费	100,000.00
上市年费	29,752.78
其他	360.00
合计	224,974.14

注：其他为托管账户维护费用。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金代销机构

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	143,580.65	160,712.68
其中：支付销售机构的客户维护费	38,538.13	48,777.49

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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	31,587.73	35,356.72

注：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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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	1,816,258.75	13,903.69	2,153,237.97	11,104.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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末未有在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：根据法律法规的规定及《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金（包括久兆 300 份额、久兆 300A 份额、久兆 300B 份额）不进行收益分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.27	-	-	21,562	391,693.09	178,317.74	-
002252	上海莱士	2017年4月21日	重大事项停牌	20.24	-	-	8,736	181,006.89	176,816.64	-
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大事项停牌	30.82	2017年7月17日	27.74	4,229	188,103.31	130,337.78	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项停牌	16.12	-	-	7,800	112,008.00	125,736.00	-

			牌							
002168	深圳 惠程	2017 年1 月23 日	重 大 事 项 停 牌	16.99	-	-	7,267	99,786.95	123,466.33	-
002426	胜利 精密	2017 年1 月16 日	重 大 事 项 停 牌	7.68	-	-	16,008	143,226.37	122,941.44	-
002622	融钰 集团	2017 年4 月20 日	重 大 事 项 停 牌	12.30	-	-	6,300	84,955.72	77,490.00	-
002642	荣之 联	2017 年4 月10 日	重 大 事 项 停 牌	25.06	2017 年7 月7 日	22.54	3,033	101,940.30	76,006.98	-
002399	海普 瑞	2017 年4 月28 日	重 大 事 项	20.23	-	-	3,710	89,969.06	75,053.30	-

			停牌							
002547	春兴精工	2017年2月20日	重大事项停牌	10.89	2017年8月18日	9.8	6,700	73,256.00	72,963.00	-
002127	南极电商	2017年6月29日	临时停牌	12.08	2017年7月6日	12.61	6,000	75,177.00	72,480.00	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	24.95	2017年7月4日	22.46	2,820	72,655.87	70,359.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	重大事项停牌	3.50	-	-	19,900	75,618.00	69,650.00	-
002013	中航机电	2017年5月12日	重大事项停	10.33	2017年8月2日	11.36	6,372	72,531.33	65,822.76	-



			牌							
002638	勤上股份	2017年4月26日	重大事件停牌	8.14	-	-	7,405	74,916.57	60,276.70	-
002625	光启技术	2017年4月13日	重大事件停牌	36.36	-	-	1,600	68,579.00	58,176.00	-
002070	*ST众和	2017年5月2日	重大事件停牌	10.17	-	-	5,587	109,613.73	56,819.79	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	重大事件停牌	8.70	2017年8月14日	9.57	6,104	61,106.51	53,104.80	-
002418	康盛股份	2017年3月20日	重大事件	9.31	2017年7月10日	9.30	5,600	57,733.05	52,136.00	-

			停牌							
002358	森源电气	2017年5月12日	临时停牌	17.02	2017年7月12日	16.68	2,995	62,756.81	50,974.90	-
002263	大东南	2017年4月24日	重大事项停牌	3.28	-	-	13,918	64,857.61	45,651.04	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	重大事项停牌	12.59	2017年7月3日	12.70	3,540	60,843.58	44,568.60	-
002447	壹桥股份	2017年5月2日	重大事项停牌	9.00	-	-	4,531	53,214.04	40,779.00	-
002504	*ST弘高	2017年5月2日	重大事项停	8.10	-	-	4,441	41,831.38	35,972.10	-

			牌								
002143	印纪传媒	2017年4月18日	重大事项停牌	24.93	-	-	1,187	32,194.98	29,591.91	-	
002600	江粉磁材	2017年2月27日	重大事项停牌	11.46		2017年8月9日	6.25	500	5,381.00	5,730.00	-
002610	爱康科技	2017年5月12日	重大事项停牌	2.44		2017年8月2日	2.44	1,000	3,222.12	2,440.00	-
002619	巨龙管业	2017年5月24日	重大事项停牌	6.37	-		-	360	3,488.00	2,293.20	-
002010	传化智联	2017年6月30日	临时停牌	15.26		2017年7月04日	16.77	3,000	58,400.62	45,780.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会和监察稽核部、相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值（所有者权益）的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,816,258.75	-	-	-	-	-	1,816,258.75
存出保证金	1,533.46	-	-	-	-	-	1,533.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-24,571,673.35	24,571,673.35
应收利息	-	-	-	-	-	371.10	371.10
应收申购款	-	-	-	-	-	356.37	356.37
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,817,792.21	-	-	-	-	-24,572,400.82	26,390,193.03

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	49.00	49.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,237.57	4,237.57
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,240.32	21,240.32
应付托管费	-	-	-	-	-	4,672.89	4,672.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,570.27	4,570.27
其他负债	-	-	-	-	-	173,983.33	173,983.33
负债总计	-	-	-	-	-	208,753.38	208,753.38
利率敏感度缺口	1,817,792.21	-	-	-	-	-	-
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,383,249.64	-	-	-	-	-	1,383,249.64
存出保证金	1,034.05	-	-	-	-	-	1,034.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-27,378,900.66	27,378,900.66
应收利息	-	-	-	-	-	332.80	332.80
应收申购款	-	-	-	-	-	1,108.67	1,108.67
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,384,283.69	-	-	-	-	-27,380,342.13	28,764,625.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,400.37	12,400.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,950.31	24,950.31
应付托管费	-	-	-	-	-	5,489.04	5,489.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	368.66	368.66
其他负债	-	-	-	-	-	90,023.32	90,023.32
负债总计	-	-	-	-	-	133,231.70	133,231.70
利率敏感度缺口	1,384,283.69	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：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。

本报告期末及上年度末本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	24,571,673.35	93.85	27,378,900.66	95.63
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,571,673.35	93.85	27,378,900.66	95.63

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	沪深300指数上升5%	1,218,511.25	1,869,484.69
沪深300指数下降5%	-1,218,511.25	-1,869,484.69	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (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2017年6月30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22,549,938.34元，划分为第二层次的余额为人民币2,021,735.01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（包括涨跌停时的交易



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,本基金本报告期末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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	24,571,673.35	93.11
	其中：股票	24,571,673.35	93.11
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,816,258.75	6.88
7	其他各项资产	2,260.93	0.01
8	合计	26,390,193.03	100.00

### 7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 7.2.1 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	404,716.17	1.55
B	采矿业	127,080.90	0.49
C	制造业	17,012,216.63	64.98
D	电力、热力、燃气及水生产和	107,148.90	0.41

	供应业		
E	建筑业	767,633.79	2.93
F	批发和零售业	841,254.21	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	109,282.44	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,634,011.71	10.06
J	金融业	909,156.34	3.47
K	房地产业	354,513.53	1.35
L	租赁和商务服务业	569,681.93	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	123,628.58	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	153,000.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	365,556.33	1.40
S	综合	-	-
	合计	24,478,881.46	93.50

注:根据中小 300(指数代码:399008)的指数调整公告,本基金对所持有的股票进行了预调整,本表是按调整后的指数进行填报。

### 7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	56,819.79	0.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	35,972.10	0.14
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	-	-
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	-	-
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	92,791.89	0.35

注:根据中小 300(指数代码: 399008)的指数调整公告,本基金对所持有的股票进行了预调整,本表是按调整后的指数进行填报。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

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	002415	海康威视	28,361	916,060.30	3.50
2	002450	康得新	20,179	454,431.08	1.74
3	002304	洋河股份	4,843	420,420.83	1.61

4	002230	科大讯飞	9,035	360,496.50	1.38
5	002024	苏宁云商	31,149	350,426.25	1.34
6	002236	大华股份	13,530	308,619.30	1.18
7	002241	歌尔股份	15,750	303,660.00	1.16
8	002142	宁波银行	15,732	303,627.60	1.16
9	002456	欧菲光	16,132	293,118.44	1.12
10	002466	天齐锂业	5,374	292,076.90	1.12
11	002008	大族激光	7,319	253,530.16	0.97
12	002736	国信证券	18,938	250,928.50	0.96
13	002594	比亚迪	5,010	250,249.50	0.96
14	002202	金风科技	15,561	240,728.67	0.92
15	002673	西部证券	16,350	232,497.00	0.89
16	002475	立讯精密	7,744	226,434.56	0.86
17	002508	老板电器	5,013	217,965.24	0.83
18	002739	万达电影	4,002	203,981.94	0.78
19	002460	赣锋锂业	4,299	198,828.75	0.76
20	002027	分众传媒	14,200	195,392.00	0.75
21	002572	索菲亚	4,600	188,600.00	0.72
22	002007	华兰生物	4,980	181,770.00	0.69
23	002405	四维图新	9,156	180,922.56	0.69
24	002085	万丰奥威	9,169	178,337.05	0.68
25	002129	中环股份	21,562	178,317.74	0.68
26	002252	上海莱士	8,736	176,816.64	0.68
27	002271	东方雨虹	4,364	161,904.40	0.62
28	002065	东华软件	7,347	160,091.13	0.61
29	002081	金螳螂	14,269	156,673.62	0.60
30	002044	美年健康	9,000	153,000.00	0.58
31	002146	荣盛发展	15,295	150,961.65	0.58

32	002340	格林美	24,661	149,199.05	0.57
33	002074	国轩高科	4,505	142,132.75	0.54
34	002385	大北农	22,241	139,895.89	0.53
35	002310	东方园林	8,333	139,327.76	0.53
36	002558	巨人网络	3,000	138,660.00	0.53
37	002311	海大集团	7,474	136,549.98	0.52
38	002183	怡亚通	15,516	133,903.08	0.51
39	002050	三花智控	8,192	133,693.44	0.51
40	002049	紫光国芯	4,229	130,337.78	0.50
41	002280	联络互动	11,825	128,656.00	0.49
42	002092	中泰化学	10,007	127,088.90	0.49
43	002030	达安基因	5,811	126,621.69	0.48
44	002075	沙钢股份	7,800	125,736.00	0.48
45	002573	清新环境	6,569	123,628.58	0.47
46	002168	深圳惠程	7,267	123,466.33	0.47
47	002426	胜利精密	16,008	122,941.44	0.47
48	002410	广联达	6,526	122,688.80	0.47
49	002223	鱼跃医疗	5,038	119,299.84	0.46
50	002500	山西证券	12,438	119,156.04	0.46
51	002407	多氟多	5,391	118,548.09	0.45
52	002179	中航光电	3,738	116,588.22	0.45
53	002470	金正大	15,334	115,465.02	0.44
54	002294	信立泰	3,169	113,006.54	0.43
55	002465	海格通信	10,463	112,372.62	0.43
56	002422	科伦药业	6,677	110,304.04	0.42
57	002384	东山精密	4,432	109,470.40	0.42
58	002038	双鹭药业	3,754	109,429.10	0.42
59	002185	华天科技	14,970	108,382.80	0.41

60	002001	新和成	5,578	108,268.98	0.41
61	002439	启明星辰	5,649	105,071.40	0.40
62	002108	沧州明珠	7,854	104,850.90	0.40
63	002138	顺络电子	5,615	104,326.70	0.40
64	002583	海能达	6,428	103,426.52	0.40
65	002714	牧原股份	3,792	103,218.24	0.39
66	002400	省广股份	12,640	101,499.20	0.39
67	002716	金贵银业	5,202	99,826.38	0.38
68	002004	华邦健康	12,586	98,548.38	0.38
69	002273	水晶光电	4,760	98,198.80	0.38
70	002195	二三四五	13,654	97,626.10	0.37
71	002292	奥飞娱乐	5,661	95,670.90	0.37
72	002048	宁波华翔	4,482	93,494.52	0.36
73	002221	东华能源	8,433	92,004.03	0.35
74	002051	中工国际	4,431	91,854.63	0.35
75	002217	合力泰	9,280	91,686.40	0.35
76	002491	通鼎互联	6,800	91,392.00	0.35
77	002462	嘉事堂	2,300	90,367.00	0.35
78	002176	江特电机	10,342	90,182.24	0.34
79	002191	劲嘉股份	9,589	89,753.04	0.34
80	002701	奥瑞金	13,843	88,456.77	0.34
81	002408	齐翔腾达	7,929	87,853.32	0.34
82	002640	跨境通	4,100	87,125.00	0.33
83	002343	慈文传媒	2,300	87,078.00	0.33
84	002174	游族网络	2,735	86,863.60	0.33
85	002595	豪迈科技	3,882	86,296.86	0.33
86	002019	亿帆医药	5,029	83,883.72	0.32
87	002444	巨星科技	5,364	83,571.12	0.32

88	002555	三七互娱	3,258	83,307.06	0.32
89	002153	石基信息	3,645	82,850.85	0.32
90	002022	科华生物	4,728	82,125.36	0.31
91	002497	雅化集团	8,423	81,703.10	0.31
92	002002	鸿达兴业	10,283	80,515.89	0.31
93	002477	雏鹰农牧	17,885	79,230.55	0.30
94	002431	棕榈股份	7,183	79,156.66	0.30
95	002368	太极股份	2,854	79,027.26	0.30
96	002353	杰瑞股份	4,987	78,894.34	0.30
97	002308	威创股份	5,960	77,778.00	0.30
98	002622	融钰集团	6,300	77,490.00	0.30
99	002665	首航节能	10,759	77,464.80	0.30
100	002424	贵州百灵	4,099	77,307.14	0.30
101	002152	广电运通	9,274	77,066.94	0.29
102	002089	新海宜	11,300	76,501.00	0.29
103	002635	安洁科技	2,100	76,062.00	0.29
104	002642	荣之联	3,033	76,006.98	0.29
105	002501	利源精制	6,650	75,610.50	0.29
106	002285	世联行	9,390	75,307.80	0.29
107	002131	利欧股份	22,865	75,225.85	0.29
108	002399	海普瑞	3,710	75,053.30	0.29
109	002155	湖南黄金	7,730	73,976.10	0.28
110	002547	春兴精工	6,700	72,963.00	0.28
111	002127	南极电商	6,000	72,480.00	0.28
112	002117	东港股份	2,798	72,412.24	0.28
113	002570	贝因美	5,322	72,379.20	0.28
114	002522	浙江众成	4,392	71,809.20	0.27
115	002544	杰赛科技	3,143	71,660.40	0.27



116	002250	联化科技	5,000	71,500.00	0.27
117	002366	台海核电	1,511	70,881.01	0.27
118	002299	圣农发展	4,749	70,617.63	0.27
119	002262	恩华药业	4,658	70,475.54	0.27
120	002244	滨江集团	10,174	70,404.08	0.27
121	002078	太阳纸业	9,575	70,376.25	0.27
122	002025	航天电器	2,820	70,359.00	0.27
123	002489	浙江永强	11,000	70,180.00	0.27
124	002047	宝鹰股份	8,100	69,984.00	0.27
125	002281	光迅科技	3,135	69,659.70	0.27
126	002505	大康农业	19,900	69,650.00	0.27
127	002672	东江环保	4,121	69,603.69	0.27
128	002436	兴森科技	11,021	69,432.30	0.27
129	002589	瑞康医药	4,505	69,377.00	0.26
130	002032	苏泊尔	1,690	69,374.50	0.26
131	002602	世纪华通	1,900	68,894.00	0.26
132	002624	完美世界	2,001	68,634.30	0.26
133	002028	思源电气	4,297	68,494.18	0.26
134	002266	浙富控股	13,934	67,997.92	0.26
135	002326	永太科技	4,900	67,914.00	0.26
136	002375	亚厦股份	7,600	67,716.00	0.26
137	002325	洪涛股份	9,162	66,882.60	0.26
138	002055	得润电子	2,924	66,462.52	0.25
139	002043	兔宝宝	4,801	66,445.84	0.25
140	002440	闰土股份	4,314	65,831.64	0.25
141	002013	中航机电	6,372	65,822.76	0.25
142	002056	横店东磁	8,742	65,565.00	0.25
143	002601	龙鳞佰利	4,000	65,520.00	0.25

144	002630	华西能源	5,650	65,483.50	0.25
145	002104	恒宝股份	6,912	64,903.68	0.25
146	002276	万马股份	6,410	64,676.90	0.25
147	002018	华信国际	9,423	64,547.55	0.25
148	002396	星网锐捷	3,327	64,377.45	0.25
149	002434	万里扬	4,000	63,680.00	0.24
150	002376	新北洋	4,628	63,496.16	0.24
151	002261	拓维信息	5,410	63,351.10	0.24
152	002603	以岭药业	3,614	63,100.44	0.24
153	002023	海特高新	6,082	62,462.14	0.24
154	002097	山河智能	6,913	61,456.57	0.23
155	002421	达实智能	9,998	61,187.76	0.23
156	002493	荣盛石化	6,243	60,931.68	0.23
157	002067	景兴纸业	10,300	60,461.00	0.23
158	002411	必康股份	2,090	60,442.80	0.23
159	002121	科陆电子	7,010	60,286.00	0.23
160	002638	勤上股份	7,405	60,276.70	0.23
161	002242	九阳股份	3,060	60,190.20	0.23
162	002106	莱宝高科	5,935	60,121.55	0.23
163	002237	恒邦股份	5,723	60,034.27	0.23
164	002517	恺英网络	1,700	59,823.00	0.23
165	002437	誉衡药业	8,119	59,106.32	0.23
166	002073	软控股份	6,919	58,673.12	0.22
167	002625	光启技术	1,600	58,176.00	0.22
168	002709	天赐材料	1,400	57,638.00	0.22
169	002463	沪电股份	12,616	57,402.80	0.22
170	002031	巨轮智能	18,445	57,363.95	0.22
171	002657	中科金财	1,969	57,081.31	0.22

172	002390	信邦制药	6,546	57,015.66	0.22
173	002608	江苏国信	4,500	56,205.00	0.21
174	002245	澳洋顺昌	6,222	56,122.44	0.21
175	002190	成飞集成	2,081	55,770.80	0.21
176	002268	卫士通	3,315	55,758.30	0.21
177	002224	三力士	5,002	55,522.20	0.21
178	002302	西部建设	2,500	55,425.00	0.21
179	002317	众生药业	4,446	55,219.32	0.21
180	002668	奥马电器	2,800	55,160.00	0.21
181	002597	金禾实业	2,500	54,650.00	0.21
182	002099	海翔药业	8,155	54,312.30	0.21
183	002413	雷科防务	4,801	53,771.20	0.21
184	002303	美盈森	6,920	53,422.40	0.20
185	002091	江苏国泰	5,587	53,355.85	0.20
186	002512	达华智能	3,300	53,295.00	0.20
187	002156	通富微电	5,227	53,210.86	0.20
188	002352	顺丰控股	1,000	53,160.00	0.20
189	002690	美亚光电	2,770	53,128.60	0.20
190	002128	露天煤业	6,104	53,104.80	0.20
191	002005	德豪润达	11,124	53,061.48	0.20
192	002341	新纶科技	2,819	52,574.35	0.20
193	002383	合众思壮	3,347	52,447.49	0.20
194	002063	远光软件	5,026	52,370.92	0.20
195	002402	和而泰	5,301	52,267.86	0.20
196	002418	康盛股份	5,600	52,136.00	0.20
197	002371	北方华创	2,179	52,121.68	0.20
198	002145	中核钛白	8,500	51,680.00	0.20
199	002428	云南锗业	4,798	51,242.64	0.20

200	002123	梦网荣信	4,593	51,028.23	0.19
201	002358	森源电气	2,995	50,974.90	0.19
202	002479	富春环保	4,281	50,943.90	0.19
203	002468	申通快递	2,000	50,820.00	0.19
204	002130	沃尔核材	7,866	50,578.38	0.19
205	002151	北斗星通	1,793	50,114.35	0.19
206	002663	普邦股份	9,094	49,380.42	0.19
207	002318	久立特材	6,029	49,317.22	0.19
208	002161	远望谷	5,943	48,138.30	0.18
209	002284	亚太股份	4,301	47,741.10	0.18
210	002283	天润曲轴	7,448	47,667.20	0.18
211	002563	森马服饰	5,601	47,496.48	0.18
212	002474	榕基软件	4,351	47,208.35	0.18
213	002467	二六三	5,940	47,044.80	0.18
214	002373	千方科技	3,438	46,894.32	0.18
215	002482	广田集团	5,190	46,658.10	0.18
216	002367	康力电梯	3,989	46,591.52	0.18
217	002721	金一文化	3,100	46,283.00	0.18
218	002664	信质电机	1,600	45,792.00	0.17
219	002010	传化智联	3,000	45,780.00	0.17
220	002414	高德红外	2,500	45,750.00	0.17
221	002433	太安堂	4,937	45,667.25	0.17
222	002263	大东南	13,918	45,651.04	0.17
223	002649	博彦科技	4,101	45,234.03	0.17
224	002095	生意宝	1,305	45,100.80	0.17
225	002503	搜于特	6,404	45,020.12	0.17
226	002389	南洋科技	2,119	44,626.14	0.17
227	002681	奋达科技	3,540	44,568.60	0.17

228	002167	东方锆业	4,000	43,920.00	0.17
229	002429	兆驰股份	13,975	42,903.25	0.16
230	002498	汉缆股份	11,700	42,822.00	0.16
231	002695	煌上煌	2,000	42,720.00	0.16
232	002094	青岛金王	2,000	42,660.00	0.16
233	002339	积成电子	3,104	42,338.56	0.16
234	002354	天神娱乐	1,960	42,140.00	0.16
235	002253	川大智胜	1,750	42,000.00	0.16
236	002288	超华科技	5,943	41,422.71	0.16
237	002249	大洋电机	6,277	41,302.66	0.16
238	002041	登海种业	3,111	41,220.75	0.16
239	002215	诺普信	4,842	40,963.32	0.16
240	002447	壹桥股份	4,531	40,779.00	0.16
241	002481	双塔食品	6,000	40,020.00	0.15
242	002699	美盛文化	2,880	39,744.00	0.15
243	002364	中恒电气	2,900	39,701.00	0.15
244	002036	联创电子	2,402	39,633.00	0.15
245	002588	史丹利	5,066	38,957.54	0.15
246	002581	未名医药	1,900	38,855.00	0.15
247	002416	爱施德	3,501	37,775.79	0.14
248	002052	同洲电子	5,925	37,564.50	0.14
249	002488	金固股份	3,200	37,024.00	0.14
250	002773	康弘药业	700	36,610.00	0.14
251	002568	百润股份	2,200	36,564.00	0.14
252	002329	皇氏集团	3,800	36,518.00	0.14
253	002448	中原内配	3,601	36,478.13	0.14
254	002120	韵达股份	700	36,120.00	0.14
255	002344	海宁皮城	4,264	35,476.48	0.14

256	002229	鸿博股份	3,157	35,358.40	0.14
257	002313	日海通讯	1,710	35,072.10	0.13
258	002502	骅威文化	3,701	34,752.39	0.13
259	002751	易尚展示	900	33,345.00	0.13
260	002180	纳思达	1,300	31,408.00	0.12
261	002147	新光圆成	2,000	31,080.00	0.12
262	002556	辉隆股份	4,201	30,625.29	0.12
263	002419	天虹股份	2,100	30,198.00	0.12
264	002143	印纪传媒	1,187	29,591.91	0.11
265	002157	正邦科技	6,500	29,575.00	0.11
266	002636	金安国纪	1,700	29,359.00	0.11
267	002821	凯莱英	400	29,188.00	0.11
268	002577	雷柏科技	1,195	27,449.15	0.10
269	002314	南山控股	4,000	26,760.00	0.10
270	002643	万润股份	500	7,380.00	0.03
271	002600	江粉磁材	500	5,730.00	0.02
272	002222	福晶科技	300	4,281.00	0.02
273	002797	第一创业	320	2,947.20	0.01
274	002102	冠福股份	700	2,926.00	0.01
275	002610	爱康科技	1,000	2,440.00	0.01
276	002619	巨龙管业	360	2,293.20	0.01
277	002707	众信旅游	102	1,339.26	0.01

### 7.3.2 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所有股票投资明细

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	002070	*ST 众和	5,587	56,819.79	0.22
2	002504	*ST 弘高	4,441	35,972.10	0.14

注:根据中小 300(指数代码: 399008)的指数调整公告,上述两只股票将调出成分股,截止本报告期末上述股票处于停牌状态,待其复牌后再进行卖出。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002044	美年健康	158,229.00	0.55
2	002558	巨人网络	131,417.00	0.46
3	002027	分众传媒	129,433.00	0.45
4	002280	联络互动	103,841.00	0.36
5	002673	西部证券	82,497.57	0.29
6	002415	海康威视	79,049.00	0.28
7	002450	康得新	77,868.00	0.27
8	002635	安洁科技	77,406.00	0.27
9	002024	苏宁云商	76,475.00	0.27
10	002127	南极电商	75,177.00	0.26
11	002624	完美世界	73,568.00	0.26
12	002601	龙鳞佰利	63,840.00	0.22
13	002434	万里扬	63,723.00	0.22
14	002302	西部建设	60,980.00	0.21
15	002146	荣盛发展	60,319.00	0.21
16	002512	达华智能	59,119.00	0.21
17	002145	中核钛白	57,920.00	0.20
18	002402	和而泰	55,914.00	0.20

19	002608	江苏国信	55,763.84	0.19
20	002597	金禾实业	53,657.00	0.19

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。

#### 7.4.2 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	002450	康得新	205,989.00	0.72
2	002024	苏宁云商	171,338.65	0.60
3	002313	日海通讯	168,596.00	0.59
4	002304	洋河股份	127,824.00	0.45
5	002466	天齐锂业	112,071.68	0.39
6	002415	海康威视	107,560.00	0.38
7	002456	欧菲光	99,675.63	0.35
8	002008	大族激光	91,250.22	0.32
9	002673	西部证券	90,505.36	0.32
10	002065	东华软件	86,442.00	0.30
11	002241	歌尔股份	86,340.98	0.30
12	002310	东方园林	83,579.00	0.29
13	002236	大华股份	83,518.00	0.29
14	002142	宁波银行	80,852.00	0.28
15	002312	*ST 三泰	80,407.52	0.28
16	002739	万达电影	76,076.00	0.27
17	002628	成都路桥	75,764.24	0.26
18	002594	比亚迪	75,368.95	0.26
19	002011	盾安环境	72,074.96	0.25
20	002486	嘉麟杰	69,886.00	0.24



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。

### 7.4.3 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	4,913,214.11
卖出股票收入（成交）总额	8,106,044.67

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。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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，期末未持有国债期货。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	1,533.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	371.10
5	应收申购款	356.37
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,260.93

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 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

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	002070	*ST 众和	56,819.79	0.22	重大事项停牌
2	002504	*ST 弘高	35,972.10	0.14	重大事项停牌

#### 7.12.6 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 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
长城久兆中小板 300 指数分级	2,360	7,243.70	55,330.00	0.32%	17,039,801.12	99.68%
长城久兆稳健指数	194	15,583.82	125,487.00	4.15%	2,897,775.00	95.85%
长城久兆积极指数	760	5,966.96	898,562.00	19.81%	3,636,331.00	80.19%
合计	3,314	7,439.13	1,079,379.00	4.38%	23,573,907.12	95.62%

注：①对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

②以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

长城久兆稳健指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李时龙	1,600,000.00	52.92%
2	王丽春	300,289.00	9.93%
3	李文霞	256,114.00	8.47%
4	李惠霞	154,000.00	5.09%

5	李时龙	129,785.00	4.29%
6	徐平	93,200.00	3.08%
7	东方汇智—光大银行—天演 1 号特定客户资产管理计划	84,939.00	2.81%
8	黄晖	33,492.00	1.11%
9	刘稳红	27,902.00	0.92%
10	北京天演资本管理有限公司—星辰之天演 2 号私募证券投资基金	22,800.00	0.75%

长城久兆积极指数

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东兴证券投资有限公司	884,411.00	19.50%
2	陈朝阳	406,900.00	8.97%
3	黄添胜	88,009.00	1.94%
4	蒋沁君	88,000.00	1.94%
5	吴柳梅	60,786.00	1.34%
6	金燕	58,363.00	1.29%
7	左婷	57,000.00	1.26%
8	叶兰祥	50,037.00	1.10%
9	杨玉锋	50,000.00	1.10%
10	陈利宁	49,700.00	1.10%

注：①持有人为场内持有人，占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例×100%。

②对于长城久兆稳健指数、长城久兆积极指数前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别份额总数。

③以基金账户为统计口径。

④以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 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。

### 8.4 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	份额级别	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	长城久兆中小板 300 指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城久兆中小板 300 指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	0
	合计	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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城久兆中小板 300 指数分级	长城久兆稳健 指数	长城久兆积极 指数
基金合同生效日（2012 年 1 月 30 日） 基金份额总额	919,797,702.13	18,458,033.00	27,687,050.00
本报告期期初基金份额总额	18,110,052.77	3,493,730.00	5,240,595.00
本报告期基金总申购份额	48,482,884.35	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	51,276,050.88	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少 以“-”填列)	1,778,244.88	-470,468.00	-705,702.00
本报告期期末基金份额总额	17,095,131.12	3,023,262.00	4,534,893.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金定期份额折算中新增的份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况



10.7.1 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	10,616,485.23	81.74%	9,887.16	81.74%	-
国金证券	2	2,371,782.98	18.26%	2,208.89	18.26%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	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	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 51 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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-
国金证券	3,822.30	100.00%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金通过工商银行定期定额投资实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管 理人网站	2017 年 1 月 14 日
3	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 1 月 23 日
4	关于长城久兆中小板 300 指数分级基金定期份额折算期间中小 300A	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2017 年 2 月 3 日

	份额停复牌的公告	基金管理人网站	
5	关于长城久兆中小板 300 指数分级基金定期份额折算结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 6 日
6	关于长城中小 300A 定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 6 日
7	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
8	长城基金管理有限公司关于参加微众银行费率优惠活动的公告（放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
9	长城基金关于旗下部分开放式基金参与广发证券开展的申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 10 日
10	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(华星创业)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 15 日
11	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 24 日
12	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(海达股份)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2017 年 4 月 25 日

		理人网站	
13	长城基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 4 月 25 日
14	长城基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 4 月 26 日
15	长城基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 4 月 28 日
16	长城基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 4 月 29 日
17	长城基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 5 月 2 日
18	长城基金管理有限公司关于参加长城证券费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管 理人网站	2017 年 5 月 15 日
19	长城基金管理有限公司关于参加中信建投证券费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管 理人网站	2017 年 5 月 18 日
20	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(新疆众和)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管 理人网站	2017 年 6 月 2 日
21	长城基金管理有限公司关于参加	中国证券报、上海证	2017 年 6 月 16 日

	中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
22	关于变更长城久兆基金经理的公告（杨建华、余礼冰）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 6 月 20 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20170116-20170421	-	47,688,398.77	47,688,398.77	-	-
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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立等相关批准文件
- (二) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 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

### 12.3 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](http://www.ccfund.com.cn)