

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>26</b>
7.1 资产负债表.....	26
7.2 利润表.....	27
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	31
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>64</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	64
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	64
8.3 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.....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	86
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.....	86

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	87
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.....	87
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.....	87
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	87
8.12 投资组合报告附注.....	88
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>90</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	90
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	90
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.....	91
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	91
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>92</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>93</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	93
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.....	93
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	93
11.4 基金投资策略的改变.....	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	93
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.....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	94
11.8 其他重大事件.....	95
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>97</b>
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.....	97
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>98</b>
13.1 备查文件目录.....	98
13.2 存放地点.....	98
13.3 查阅方式.....	98

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	长城久泰沪深 300 指数	
基金主代码	200002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 5 月 21 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	342,339,838.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码:	200002	006912
下属分级基金的前端交易代码	200002	
下属分级基金的后端交易代码	201002	
报告期末下属分级基金的份额总额	309,970,245.09 份	32,369,593.26 份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略：本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。</p> <p>(2) 股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。</p> <p>(3) 债券投资策略：本基金债券投资部分</p>

	以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险，获取市场平均收益。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	张燕
	联系电话	0755-23982338	0755-83199084
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95555
传真		0755-23982328	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		王军	缪建民

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	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

金额单位：人民币元

3.1. 1 期 间数 据和 指标	2020 年		2019 年		2018 年	
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪 深 300 指数 C	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	长城久泰沪深 300 指数 A	长 城 久 泰 沪 深 30 0 指 数 C
本期 已实 现收 益	209,032,000. 13	23,404,581. 56	152,963,602. 72	13,507,799.1 1	-5,548,187.17	-
本期 利润	224,661,166. 69	24,037,731. 88	276,598,074. 30	21,624,818.5 9	-158,142,347. 29	-
加权 平均 基金 份额 本期	0.6111	0.5431	0.5463	0.3349	-0.3386	-

利润						
本期 加权 平均 净值 利润率	29.72%	31.07%	32.53%	19.64%	-21.80%	-
本期 基金 份额 净值 增长率	33.25%	32.85%	38.22%	32.79%	-20.71%	-
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末 可供 分配 利润	224,739,368. 83	31,118,666. 59	69,241,023.2 7	47,318,215.4 9	-82,617,571.7 2	-
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.7250	0.9614	0.1475	0.4702	-0.1561	-
期末 基金	775,999,631. 83	69,564,565. 71	881,990,097. 81	162,793,438. 97	719,285,514.9 7	-

资产净值						
期末基金份额净值	2.5035	2.1491	1.8788	1.6177	1.3593	-
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	547.69%	76.41%	386.07%	32.79%	251.67%	-

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。

④本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额。

### 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

长城久泰沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	----------	----------	--------------	-----	-----

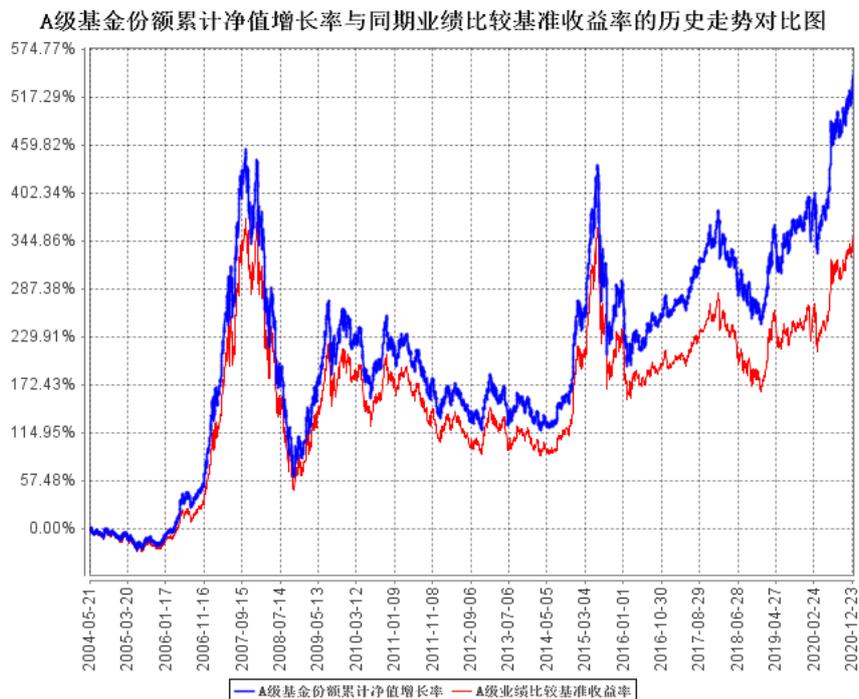
		准差②	率③	④		
过去三个月	12.36%	0.96%	12.90%	0.94%	-0.54%	0.02%
过去六个月	26.82%	1.23%	23.84%	1.28%	2.98%	-0.05%
过去一年	33.25%	1.33%	25.88%	1.36%	7.37%	-0.03%
过去三年	46.03%	1.25%	28.18%	1.28%	17.85%	-0.03%
过去五年	69.06%	1.17%	38.24%	1.18%	30.82%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	547.69%	1.59%	353.07%	1.59%	194.62%	0.00%

长城久泰沪深 300 指数 C

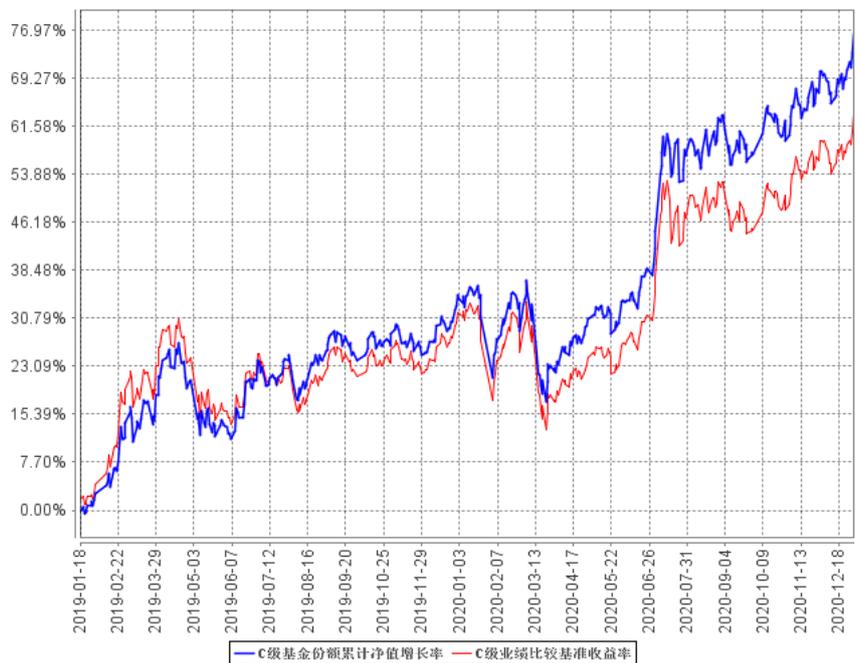
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①-③	②-④
过去三个月	12.27%	0.96%	12.90%	0.94%	-0.63%	0.02%
过去六个月	26.63%	1.23%	23.84%	1.28%	2.79%	-0.05%
过去一年	32.85%	1.33%	25.88%	1.36%	6.97%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	76.41%	1.25%	63.67%	1.28%	12.74%	-0.03%

注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

### 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



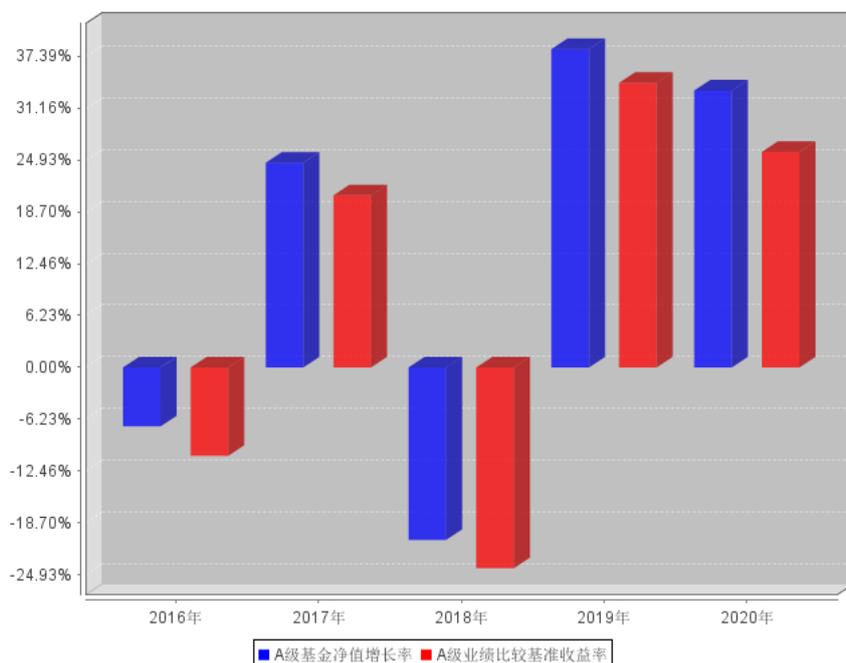
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



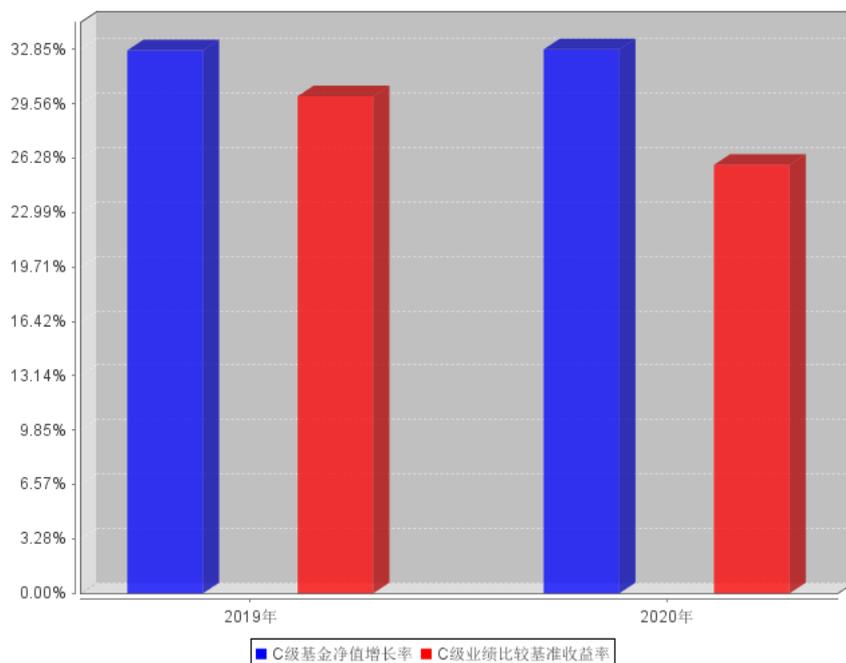
注：本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90%~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

### 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

A级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



C级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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C					
年度	每 10 份 基金	现金形式发放总额	再投资形式发放	年度利润分配合	备注

	份额分红数		总额	计	
2020	-	-	-	-	
2019	2.4900	40,479,338.58	210,364.31	40,689,702.89	
2018	-	-	-	-	
合计	2.4900	40,479,338.58	210,364.31	40,689,702.89	

注：本基金 2018、2020 年度未进行利润分配。

## §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。截至本报告期末，公司管理的基金有：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、长城核心优选灵活配置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、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置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、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳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、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长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、长城久鑫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、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、

长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城泰丰纯债债券型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长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		
杨建华	公司副总经理、权益投资总监、权益投资部总经理，长城久泰、长城品牌、长城核心优势、长城价值优选混合的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	20 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”、“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”和“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理。
雷俊	量化与指数投资部 总经理， 长城中证 500 指数增强型、 长城久泰沪深 300 指数、 长城创业板指数、 长城核心优选混合、 长城量化精选股票、 长城量化小盘股票、 长城中国智造混合	2018 年 11 月 30 日	-	12 年	男，北京大学理学学士、工学硕士。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。

	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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期，无基金经理兼任投资经理情况。

#### 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》、《长城久泰沪深 300 指数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

2020 年 A 股市场“欲扬先抑”，年初突如其来的“新冠疫情”极大扰动了全球资本市场，美股罕见地连续出现熔断，原油期货价格出现负数，各种极端事件不断刷新投资者对市场的认知，但是二季度以后，A 股市场强势反转，半导体、生物医药、白酒、光伏等板块轮番阶段性地领涨市场，A 股全年“动量”效应显著，呈现强者恒强特征，公募基金收益率高企，爆款基金频现。产品运作区间本基金产品运作坚持指数价值增强的投资风格，基金产品在同等情况下，会偏好估值便宜的个股，由于全年价值因子表现一般，基金超额收益处于同类中等水平。

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

本报告期内，基金份额净值增长率 A 为 33.25%，基金份额净值增长率 C 为 32.85%；同期业绩比较基准收益率为 25.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于后市，我们认为应该要乐观一点。各项宏观数据和经济预测数据均表明，宏观经济表现正在变好。我们对“新冠”疫情的处理也积累了一定的经验，疫情对经济活动的边际影响正在减弱。随着美国总统的顺利换届，国外环境的不确定性也在逐渐消失。因此虽大盘指数在高位震荡，但整体上我们认为对 A 股可以相对乐观一点。

以白酒、光伏为代表的高成长行业虽然估值水平相对较高，但是行业景气度很好。以金融地产为代表低估值的行业，股价表现虽然相对较弱，但是估值优势愈加明显。我们预计今年的行业分化不会那么严重，行业表现会更加均衡，每个行业都有阶段性的行情。我们的量化模型会根据产品的风险偏好特征，在行业偏离上会做适度地约束调整。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防

范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

#### 4.7 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，并能在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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.9 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，本基金无需要说明的情况。

## §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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2021)审字第 60737541_H03 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>长城久泰沪深 300 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对长城久泰沪深 300 指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截</p>

	<p>至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城久泰沪深 300 指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吴翠蓉   陈小青
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	44,302,934.69	14,790,867.87
结算备付金		1,605,409.96	4,942,219.84
存出保证金		175,096.45	277,993.84
交易性金融资产	7.4.7.2	801,164,843.11	1,028,816,598.10
其中：股票投资		801,150,884.91	986,362,030.10
基金投资		-	-
债券投资		13,958.20	42,454,568.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,664,116.95	5,866,016.98
应收利息	7.4.7.5	6,009.14	857,095.64
应收股利		-	-
应收申购款		128,991.16	354,963.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		849,047,401.46	1,055,905,755.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,973,578.00
应付赎回款		2,152,445.95	3,271,358.99
应付管理人报酬		707,774.47	947,572.12
应付托管费		144,443.78	193,382.07
应付销售服务费		17,017.17	69,642.73
应付交易费用	7.4.7.7	243,933.09	582,095.50
应交税费		0.93	1.71
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	217,588.53	84,587.97
负债合计		3,483,203.92	11,122,219.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	342,339,838.35	570,083,358.92
未分配利润	7.4.7.10	503,224,359.19	474,700,177.86
所有者权益合计		845,564,197.54	1,044,783,536.78
负债和所有者权益总计		849,047,401.46	1,055,905,755.87

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额净值 2.5035 元，基金份额总额 309,970,245.09 份；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.1491 元，基金份额总额 32,369,593.26 份。长城久泰沪深 300 指数份额总额合计为 342,339,838.35 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		264,490,256.37	316,312,430.03
1.利息收入		449,275.42	1,178,845.08
其中：存款利息收入	7.4.7.11	215,444.17	197,779.56
债券利息收入		233,831.25	981,065.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		247,091,614.37	182,841,332.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	228,982,727.31	164,724,854.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	696,141.01	7,395.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	17,412,746.05	18,109,082.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	16,262,316.88	131,751,491.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	687,049.70	540,761.42
<b>减：二、费用</b>		15,791,357.80	18,089,537.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,150,946.42	9,357,081.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,663,458.44	1,909,608.54
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	231,110.63	318,751.06
4. 交易费用	7.4.7.19	5,526,612.35	6,308,372.13

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.64	0.19
7. 其他费用	7.4.7.20	219,228.32	195,723.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		248,698,898.57	298,222,892.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		248,698,898.57	298,222,892.89

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	570,083,358.92	474,700,177.86	1,044,783,536.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	248,698,898.57	248,698,898.57
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）	-227,743,520.57	-220,174,717.24	-447,918,237.81
其中：1. 基金申购款	133,907,822.39	123,634,115.60	257,541,937.99
2. 基金赎回款	-361,651,342.96	-343,808,832.84	-705,460,175.80

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）	342,339,838.35	503,224,359.19	845,564,197.54
项目	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019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）	529,161,664.45	190,123,850.52	719,285,514.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	298,222,892.89	298,222,892.89
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）	40,921,694.47	27,043,137.34	67,964,831.81
其中：1. 基金申购款	420,380,573.15	279,139,976.60	699,520,549.75
2. 基金赎回款	-379,458,878.68	-252,096,839.26	-631,555,717.94
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）	-	-40,689,702.89	-40,689,702.89
五、期末所有者权益（基金净值）	570,083,358.92	474,700,177.86	1,044,783,536.78

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>邱春杨</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

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），由长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金更名而成，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字（2004）51 号文《关于同意长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人长城基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 5 月 21 日正式生效，首次设立募集规模为 1,512,020,891.32 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（“招商银行”）。

根据 2019 年 1 月 18 日《关于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金自 2019 年 1 月 18 日起为本基金增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。同时，本基金管理人将对《基金合同》进行相应修改。

本基金根据申购、赎回、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。长城久泰沪深 300 A 类和长城久泰沪深 300 C 类的基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购基金份额类别。

本基金的指数化投资采用分层抽样法，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。自 2011 年 4 月 1 日起，所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数，并在 2011 年 4 月 20 日前将现有的组合调整为跟踪沪深 300 指数的新组合。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 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。

自 2011 年 4 月 1 日起本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+5\% \times$  银行同业存款利率。自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  中信标普 300 指

数收益率+5%×银行同业存款利率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度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。

##### 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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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)于卖出债券成交日确认,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扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账;

(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 0.98% 的年费率计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提;

(3) A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率逐日计提;

(4) 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;

(5) 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

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额

类别对应的可分配收益将可能有所不同，本基金同一基金份额类别内的每份基金单位享有同等分配权；

(2) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(3) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(5) 在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可以不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(6) 投资者可以选择现金分红方式或红利再投资方式，默认方式为现金分红方式，投资者分红方式的变更须在分红权益登记日前向销售机构提出申请；

(7) 红利分配时所发生的银行转账或其他注册登记费用由投资者自行承担。基金管理人若收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定；

(8) 法律法规以及中国证监会的其他规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
活期存款	44,302,934.69	14,790,867.87
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	44,302,934.69	14,790,867.87

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	685,544,959.49	801,150,884.91	115,605,925.42	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	10,000.00	13,958.20	3,958.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,000.00	13,958.20	3,958.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	685,554,959.49	801,164,843.11	115,609,883.62	
项目	上年度末			
	2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	887,092,255.46	986,362,030.10	99,269,774.64	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	42,376,775.90	42,454,568.00	77,792.10
	银行间市场	-	-	-

	合计	42,376,775.90	42,454,568.00	77,792.10
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	929,469,031.36	1,028,816,598.10	99,347,566.74

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末及上年度末均未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末及上年度末均未持有因买断式逆回购交易获得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	5,126.21	2,523.13
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	794.64	2,446.40
应收债券利息	1.61	851,988.50
应收资产支持证券利息	-	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	86.68	137.61

合计	6,009.14	857,095.64
----	----------	------------

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	243,933.09	582,095.50
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	243,933.09	582,095.50

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,588.53	14,587.97
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	90,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	-
合计	217,588.53	84,587.97

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	469,450,594.08	469,450,594.08
本期申购	101,888,839.36	101,888,839.36
本期赎回（以“-”号填列）	-261,369,188.35	-261,369,188.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	309,970,245.09	309,970,245.09

金额单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,632,764.84	100,632,764.84
本期申购	32,018,983.03	32,018,983.03
本期赎回（以“-”号填列）	-100,282,154.61	-100,282,154.61
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	32,369,593.26	32,369,593.26

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	69,241,023.27	343,298,480.46	412,539,503.73
本期利润	209,032,000.13	15,629,166.56	224,661,166.69
本期基金份额交易	-53,533,654.57	-117,637,629.11	-171,171,283.68

产生的变动数			
其中：基金申购款	36,655,123.16	60,929,668.43	97,584,791.59
基金赎回款	-90,188,777.73	-178,567,297.54	-268,756,075.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,739,368.83	241,290,017.91	466,029,386.74

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	47,318,215.49	14,842,458.64	62,160,674.13
本期利润	23,404,581.56	633,150.32	24,037,731.88
本期基金份额交易产生的变动数	-39,604,130.46	-9,399,303.10	-49,003,433.56
其中：基金申购款	23,289,105.86	2,760,218.15	26,049,324.01
基金赎回款	-62,893,236.32	-12,159,521.25	-75,052,757.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,118,666.59	6,076,305.86	37,194,972.45

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	174,736.55	141,469.88
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	36,323.13	52,122.81
其他	4,384.49	4,186.87
合计	215,444.17	197,779.56

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

**7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
卖出股票成交总额	3,397,767,281.65	3,803,981,915.47
减：卖出股票成本总额	3,168,784,554.34	3,639,257,061.17
买卖股票差价收入	228,982,727.31	164,724,854.30

**7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	46,542,648.76	51,162,630.35
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	44,760,675.90	49,664,957.41
减：应收利息总额	1,085,831.85	1,490,277.19
买卖债券差价收入	696,141.01	7,395.75

**7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

注：本基金本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	17,412,746.05	18,109,082.42
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	17,412,746.05	18,109,082.42

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	16,262,316.88	131,751,491.06
——股票投资	16,336,150.78	131,657,762.35
——债券投资	-73,833.90	93,728.71
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	16,262,316.88	131,751,491.06

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	654,362.14	538,400.22
其他	180.84	-
转出基金补偿收入	32,506.72	2,361.20
合计	687,049.70	540,761.42

注：其他为 688688 上市失败退款利息收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	5,526,612.35	6,308,372.13
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,526,612.35	6,308,372.13

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	9,228.32	5,723.25
合计	219,228.32	195,723.25

#### 7.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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
招商银行	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、基金销售机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	6,341,527,236.29	100.00%	7,590,040,086.74	100.00%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	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 成交总额的 比例
长城证券	13,633,338.57	100.00%	66,658,029.90	100.00%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	1,466,787.47	100.00%	243,933.09	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,755,572.25	100.00%	582,095.50	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,150,946.42	9,357,081.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,431,694.85	1,422,614.15

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.98%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.98\% / \text{当年天数}$$

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付	1,663,458.44	1,909,608.54

的托管费		
------	--	--

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
招商银行	-	-	-
长城基金管理有限公司	-	214,177.87	214,177.87
长城证券	-	-	-
东方证券	-	-	-
合计	-	214,177.87	214,177.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
招商银行	-	-	-
长城基金管理有限公司	-	308,943.76	308,943.76
长城证券	-	-	-
东方证券	-	-	-
合计	-	308,943.76	308,943.76

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的

0.3%年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应支付的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额基金资产净值

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：本基金于本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自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。

##### 7.4.10.5.2 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其他关联方于本期末及上年度末未投资本基金。

#### 7.4.10.6 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	
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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
招商银行	44,302,934.69	174,736.55	14,790,867.87	141,469.88

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688521	芯原股份	2020年8月11日	2021年2月18日	新股锁定	38.53	77.99	13,200	508,596.00	1,029,468.00	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	118.27	603.36	313	37,018.51	188,851.68	-
300901	中胤时尚	2020年10月19日	2021年4月29日	新股锁定	8.96	15.00	9,611	86,114.56	144,165.00	-
688379	华光新材	2020年8月11日	2021年2月19日	新股锁定	16.78	23.63	4,950	83,061.00	116,968.50	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新股锁定	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300867	圣元环保	2020年8月	2021年3月	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-

		12 日	月 3 日							
300877	金春股份	2020 年 8 月 17 日	2021 年 3 月 3 日	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300876	蒙泰高新	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新股锁定	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股流通受限	4.59	5.46	52	238.68	283.92	
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

			日							
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月14日	2021年1月15日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 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。本基金持有一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券市值的 10%。

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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回

申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，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债券资产的公允价值。

除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及交易性金融资产等。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	44,302,934.69	-	-	-	-	-	44,302,934.69
结算备付金	1,605,409.96	-	-	-	-	-	1,605,409.96
存出保证金	175,096.45	-	-	-	-	-	175,096.45
交易性金融资产	-	-	-	-	13,958.20	801,150,884.91	801,164,843.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,664,116.95	1,664,116.95
应收利息	-	-	-	-	-	6,009.14	6,009.14
应收申购款	-	-	-	-	-	128,991.16	128,991.16

资产总计	46,083,441.10	-	-	-	13,958.20	802,950,002.16	849,047,401.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,152,445.95	2,152,445.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	707,774.47	707,774.47
应付托管费	-	-	-	-	-	144,443.78	144,443.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,017.17	17,017.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	243,933.09	243,933.09
应交税费	-	-	-	-	-	0.93	0.93
其他负债	-	-	-	-	-	217,588.53	217,588.53
负债总计	-	-	-	-	-	3,483,203.92	3,483,203.92
利率敏感度缺口	46,083,441.10	-	-	-	13,958.20		
上年度末 2019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	14,790,867.87	-	-	-	-	-	14,790,867.87
结算备付金	4,942,219.84	-	-	-	-	-	4,942,219.84
存出保证金	277,993.84	-	-	-	-	-	277,993.84
交易性金融资产	32,019,200.00	-	10,000,368.00	-	435,000.00	986,362,030.10	1,028,816,598.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,866,016.98	5,866,016.98
应收利息	-	-	-	-	-	857,095.64	857,095.64
应收申购款	-	-	-	-	-	354,963.60	354,963.60
资产总计	52,030,281.55	-	10,000,368.00	-	435,000.00	993,440,106.32	1,055,905,755.87
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,973,578.00	5,973,578.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,271,358.99	3,271,358.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	947,572.12	947,572.12
应付托管费	-	-	-	-	-	193,382.07	193,382.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	69,642.73	69,642.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	582,095.50	582,095.50
应交税费	-	-	-	-	-	1.71	1.71
其他负债	-	-	-	-	-	84,587.97	84,587.97
负债总计	-	-	-	-	-	11,122,219.09	11,122,219.09
利率敏感度	52,030,281.55	-	10,000,368.00	-	435,000.00		

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	利率上升 25 个基点	0.00	-18,149.26
	利率下降 25 个基点	0.00	18,191.85

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。于本期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	801,150,884.91	94.75	986,362,030.10	94.41
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	13,958.20	0.00	42,454,568.00	4.06
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	801,164,843.11	94.75	1,028,816,598.10	98.47

#### 7.4.13.4.3.2 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（2020年12月 31日）	上年度末（2019年12月 31日）
	沪深300指数上升5%	39,412,617.78	48,933,420.31
	沪深300指数下降5%	-39,412,617.78	-48,933,420.31

#### 7.4.14 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2020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 799,452,471.86 元,划分为第二层次的余额为人民币 1,712,371.25 元,无划分为第三层次的余额。于 2019 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 976,242,758.48 元,划分为第二层次的余额为人民币 52,573,839.62 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归属于第三层次的金融工具,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 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	801,150,884.91	94.36
	其中：股票	801,150,884.91	94.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,958.20	0.00
	其中：债券	13,958.20	0.00
	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	45,908,344.65	5.41
8	其他各项资产	1,974,213.70	0.23
9	合计	849,047,401.46	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,853,947.54	0.34
B	采矿业	25,844,134.37	3.06
C	制造业	303,823,602.55	35.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,936,027.62	1.65
E	建筑业	16,619,600.62	1.97
F	批发和零售业	4,230,763.15	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	6,144,715.31	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	11,544,138.25	1.37

	业		
J	金融业	217,846,855.29	25.76
K	房地产业	29,400,177.69	3.48
L	租赁和商务服务业	22,246,007.91	2.63
M	科学研究和技术服务业	1,090,538.88	0.13
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	7,793,672.88	0.92
R	文化、体育和娱乐业	22,764.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	663,396,946.66	78.46

### 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	7,483.25	0.00
B	采矿业	13,083.03	0.00
C	制造业	109,738,906.48	12.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,258,442.22	0.15
E	建筑业	2,454.99	0.00
F	批发和零售业	8,536,383.24	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,726,035.70	0.20
H	住宿和餐饮业	10,306.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,204,449.60	0.14
J	金融业	5,969.70	0.00

K	房地产业	15,989.40	0.00
L	租赁和商务服务业	1,055.48	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,340,656.20	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	60,683.24	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,582,665.68	1.02
R	文化、体育和娱乐业	2,249,374.04	0.27
S	综合	-	-
	合计	137,753,938.25	16.29

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 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

#### 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	600519	贵州茅台	31,306	62,549,388.00	7.40
2	601318	中国平安	533,593	46,411,919.14	5.49
3	000333	美的集团	416,858	41,035,501.52	4.85
4	601166	兴业银行	1,193,820	24,915,023.40	2.95
5	600887	伊利股份	544,736	24,169,936.32	2.86
6	600036	招商银行	502,569	22,087,907.55	2.61
7	002475	立讯精密	365,029	20,485,427.48	2.42
8	600030	中信证券	682,932	20,078,200.80	2.37
9	300059	东方财富	599,972	18,599,132.00	2.20
10	600031	三一重工	484,391	16,943,997.18	2.00
11	000002	万科 A	558,081	16,016,924.70	1.89

12	000568	泸州老窖	60,735	13,735,827.60	1.62
13	600900	长江电力	709,419	13,592,468.04	1.61
14	601398	工商银行	2,691,224	13,429,207.76	1.59
15	601888	中国中免	47,500	13,416,375.00	1.59
16	601012	隆基股份	144,358	13,309,807.60	1.57
17	000001	平安银行	604,253	11,686,253.02	1.38
18	000858	五粮液	39,309	11,472,331.65	1.36
19	601899	紫金矿业	1,218,853	11,323,144.37	1.34
20	600309	万华化学	123,200	11,216,128.00	1.33
21	002142	宁波银行	290,765	10,275,635.10	1.22
22	600048	保利地产	617,427	9,767,695.14	1.16
23	600438	通威股份	239,300	9,198,692.00	1.09
24	002027	分众传媒	894,593	8,829,632.91	1.04
25	600837	海通证券	666,689	8,573,620.54	1.01
26	300124	汇川技术	90,760	8,467,908.00	1.00
27	601288	农业银行	2,696,131	8,465,851.34	1.00
28	600999	招商证券	347,105	8,101,430.70	0.96
29	002241	歌尔股份	209,082	7,802,940.24	0.92
30	300347	泰格医药	48,100	7,773,441.00	0.92
31	601211	国泰君安	428,607	7,513,480.71	0.89
32	600570	恒生电子	67,465	7,077,078.50	0.84
33	601668	中国建筑	1,407,410	6,994,827.70	0.83
34	600000	浦发银行	679,732	6,579,805.76	0.78
35	000157	中联重科	639,251	6,328,584.90	0.75
36	000776	广发证券	374,512	6,097,055.36	0.72
37	601919	中远海控	498,900	6,091,569.00	0.72
38	300433	蓝思科技	193,141	5,912,046.01	0.70
39	601088	中国神华	319,451	5,753,312.51	0.68

40	600019	宝钢股份	966,262	5,749,258.90	0.68
41	000661	长春高新	12,710	5,705,646.10	0.67
42	601390	中国中铁	1,075,174	5,666,166.98	0.67
43	002493	荣盛石化	202,100	5,579,981.00	0.66
44	300408	三环集团	149,400	5,565,150.00	0.66
45	600346	恒力石化	186,620	5,219,761.40	0.62
46	601225	陕西煤业	474,366	4,430,578.44	0.52
47	600845	宝信软件	63,900	4,407,822.00	0.52
48	688036	传音控股	28,500	4,335,990.00	0.51
49	600998	九州通	232,113	4,215,172.08	0.50
50	600028	中国石化	982,563	3,959,728.89	0.47
51	601117	中国化学	673,452	3,953,163.24	0.47
52	600606	绿地控股	615,959	3,591,040.97	0.42
53	000786	北新建材	87,700	3,512,385.00	0.42
54	002179	中航光电	41,590	3,256,081.10	0.39
55	002714	牧原股份	36,967	2,850,155.70	0.34
56	600690	海尔智家	96,199	2,809,972.79	0.33
57	000100	TCL 科技	366,418	2,594,239.44	0.31
58	601818	光大银行	531,827	2,121,989.73	0.25
59	600958	东方证券	167,366	1,946,466.58	0.23
60	601238	广汽集团	143,600	1,908,444.00	0.23
61	601727	上海电气	268,309	1,448,868.60	0.17
62	600104	上汽集团	44,524	1,088,166.56	0.13
63	603259	药明康德	7,904	1,064,826.88	0.13
64	002841	视源股份	6,500	747,695.00	0.09
65	601100	恒立液压	6,500	734,500.00	0.09
66	601688	华泰证券	24,253	436,796.53	0.05
67	600547	山东黄金	15,713	371,141.06	0.04

68	601377	兴业证券	40,368	350,394.24	0.04
69	600886	国投电力	39,472	341,038.08	0.04
70	600809	山西汾酒	200	75,058.00	0.01
71	600436	片仔癀	200	53,502.00	0.01
72	601328	交通银行	10,913	48,890.24	0.01
73	603288	海天味业	202	40,509.08	0.00
74	002304	洋河股份	163	38,466.37	0.00
75	002007	华兰生物	874	36,917.76	0.00
76	300033	同花顺	293	36,326.14	0.00
77	300601	康泰生物	200	34,900.00	0.00
78	603160	汇顶科技	200	31,110.00	0.00
79	300122	智飞生物	207	30,617.37	0.00
80	002594	比亚迪	155	30,116.50	0.00
81	603658	安图生物	200	29,036.00	0.00
82	300014	亿纬锂能	351	28,606.50	0.00
83	000596	古井贡酒	100	27,200.00	0.00
84	000538	云南白药	239	27,150.40	0.00
85	002916	深南电路	248	26,798.88	0.00
86	300676	华大基因	200	25,712.00	0.00
87	600276	恒瑞医药	209	23,295.14	0.00
88	000895	双汇发展	482	22,625.08	0.00
89	600009	上海机场	274	20,730.84	0.00
90	600745	闻泰科技	200	19,800.00	0.00
91	300413	芒果超媒	270	19,575.00	0.00
92	300015	爱尔眼科	252	18,872.28	0.00
93	002352	顺丰控股	200	17,646.00	0.00
94	601336	新华保险	286	16,579.42	0.00
95	300529	健帆生物	237	16,073.34	0.00

96	600588	用友网络	355	15,573.85	0.00
97	300628	亿联网络	208	15,208.96	0.00
98	600872	中炬高新	217	14,463.05	0.00
99	600585	海螺水泥	239	12,337.18	0.00
100	002415	海康威视	245	11,884.95	0.00
101	601877	正泰电器	271	10,612.36	0.00
102	601633	长城汽车	272	10,284.32	0.00
103	002460	赣锋锂业	100	10,120.00	0.00
104	000651	格力电器	163	10,096.22	0.00
105	002938	鹏鼎控股	200	9,934.00	0.00
106	601628	中国人寿	249	9,559.11	0.00
107	601155	新城控股	257	8,951.31	0.00
108	601601	中国太保	233	8,947.20	0.00
109	600196	复星医药	165	8,908.35	0.00
110	603899	晨光文具	100	8,856.00	0.00
111	000425	徐工机械	1,626	8,731.62	0.00
112	601066	中信建投	200	8,400.00	0.00
113	002601	龙蟠佰利	268	8,246.36	0.00
114	002001	新和成	240	8,083.20	0.00
115	002230	科大讯飞	196	8,010.52	0.00
116	000768	中航西飞	216	7,922.88	0.00
117	002410	广联达	100	7,874.00	0.00
118	600183	生益科技	270	7,603.20	0.00
119	600741	华域汽车	260	7,493.20	0.00
120	600893	航发动力	126	7,478.10	0.00
121	000063	中兴通讯	218	7,335.70	0.00
122	300136	信维通信	200	7,176.00	0.00
123	601021	春秋航空	127	7,039.61	0.00

124	600332	白云山	237	6,932.25	0.00
125	000963	华东医药	260	6,905.60	0.00
126	600660	福耀玻璃	143	6,871.15	0.00
127	002311	海大集团	100	6,550.00	0.00
128	002050	三花智控	260	6,409.00	0.00
129	002555	三七互娱	200	6,246.00	0.00
130	002508	老板电器	152	6,198.56	0.00
131	002624	完美世界	200	5,900.00	0.00
132	002271	东方雨虹	150	5,820.00	0.00
133	000938	紫光股份	274	5,603.30	0.00
134	600118	中国卫星	169	5,438.42	0.00
135	300003	乐普医疗	199	5,408.82	0.00
136	000977	浪潮信息	200	5,376.00	0.00
137	002153	石基信息	166	5,160.94	0.00
138	603156	养元饮品	197	5,090.48	0.00
139	600498	烽火通信	210	5,056.80	0.00
140	601607	上海医药	259	4,972.80	0.00
141	000708	中信特钢	220	4,793.80	0.00
142	600109	国金证券	291	4,734.57	0.00
143	002008	大族激光	107	4,574.25	0.00
144	603019	中科曙光	120	4,107.60	0.00
145	002236	大华股份	206	4,097.34	0.00
146	000338	潍柴动力	258	4,073.82	0.00
147	601138	工业富联	294	4,024.86	0.00
148	601231	环旭电子	200	3,868.00	0.00
149	300142	沃森生物	100	3,856.00	0.00
150	300498	温氏股份	208	3,791.84	0.00
151	002463	沪电股份	200	3,758.00	0.00

152	601788	光大证券	200	3,704.00	0.00
153	600085	同仁堂	148	3,537.20	0.00
154	600926	杭州银行	222	3,312.24	0.00
155	002736	国信证券	242	3,300.88	0.00
156	000625	长安汽车	147	3,216.36	0.00
157	001979	招商蛇口	242	3,216.18	0.00
158	300144	宋城演艺	180	3,189.60	0.00
159	600340	华夏幸福	240	3,103.20	0.00
160	600352	浙江龙盛	225	3,064.50	0.00
161	600406	国电南瑞	115	3,055.55	0.00
162	601881	中国银河	233	2,914.83	0.00
163	600703	三安光电	102	2,755.02	0.00
164	603799	华友钴业	34	2,696.20	0.00
165	002456	欧菲光	197	2,596.46	0.00
166	000703	恒逸石化	200	2,560.00	0.00
167	601808	中海油服	200	2,554.00	0.00
168	601555	东吴证券	247	2,435.42	0.00
169	600383	金地集团	178	2,403.00	0.00
170	600066	宇通客车	142	2,402.64	0.00
171	601901	方正证券	220	2,281.40	0.00
172	000876	新希望	100	2,240.00	0.00
173	600637	东方明珠	245	2,190.30	0.00
174	000728	国元证券	242	2,168.32	0.00
175	601009	南京银行	263	2,125.04	0.00
176	600362	江西铜业	104	2,074.80	0.00
177	600061	国投资本	150	2,074.50	0.00
178	600522	中天科技	191	2,070.44	0.00
179	601229	上海银行	261	2,046.24	0.00

180	000069	华侨城 A	285	2,020.65	0.00
181	601186	中国铁建	251	1,982.90	0.00
182	600271	航天信息	156	1,965.60	0.00
183	600487	亨通光电	140	1,958.60	0.00
184	600111	北方稀土	148	1,937.32	0.00
185	002602	世纪华通	269	1,912.59	0.00
186	002202	金风科技	129	1,838.25	0.00
187	600482	中国动力	100	1,792.00	0.00
188	600655	豫园股份	200	1,778.00	0.00
189	002558	巨人网络	100	1,743.00	0.00
190	600015	华夏银行	278	1,737.50	0.00
191	600177	雅戈尔	240	1,725.60	0.00
192	601319	中国人保	261	1,714.77	0.00
193	000725	京东方 A	264	1,584.00	0.00
194	601360	三六零	100	1,571.00	0.00
195	601111	中国国航	200	1,498.00	0.00
196	600016	民生银行	285	1,482.00	0.00
197	600068	葛洲坝	224	1,473.92	0.00
198	601006	大秦铁路	228	1,472.88	0.00
199	000656	金科股份	200	1,418.00	0.00
200	002044	美年健康	120	1,359.60	0.00
201	601198	东兴证券	100	1,332.00	0.00
202	601939	建设银行	209	1,312.52	0.00
203	601766	中国中车	247	1,311.57	0.00
204	603993	洛阳钼业	207	1,293.75	0.00
205	002146	荣盛发展	198	1,292.94	0.00
206	600489	中金黄金	145	1,277.45	0.00
207	000166	申万宏源	218	1,151.04	0.00

208	600299	安迪苏	100	1,151.00	0.00
209	600233	圆通速递	100	1,150.00	0.00
210	000783	长江证券	136	1,142.40	0.00
211	601872	招商轮船	200	1,130.00	0.00
212	600018	上港集团	246	1,124.22	0.00
213	601857	中国石油	266	1,103.90	0.00
214	601169	北京银行	219	1,059.96	0.00
215	002673	西部证券	103	1,044.42	0.00
216	601985	中国核电	200	984.00	0.00
217	601577	长沙银行	100	952.00	0.00
218	002024	苏宁易购	117	902.07	0.00
219	000961	中南建设	100	883.00	0.00
220	600029	南方航空	148	882.08	0.00
221	600390	五矿资本	120	837.60	0.00
222	601800	中国交建	111	805.86	0.00
223	601989	中国重工	183	766.77	0.00
224	601933	永辉超市	100	718.00	0.00
225	600027	华电国际	200	680.00	0.00
226	600705	中航资本	154	674.52	0.00
227	000671	阳光城	100	652.00	0.00
228	600369	西南证券	118	634.84	0.00
229	601669	中国电建	162	628.56	0.00
230	600208	新湖中宝	186	576.60	0.00
231	601618	中国中冶	202	551.46	0.00
232	601998	中信银行	105	536.55	0.00
233	601216	君正集团	106	524.70	0.00
234	601600	中国铝业	140	508.20	0.00
235	601988	中国银行	158	502.44	0.00

236	000627	天茂集团	100	487.00	0.00
237	600115	东方航空	101	472.68	0.00
238	600011	华能国际	100	448.00	0.00
239	600795	国电电力	182	409.50	0.00
240	600297	广汇汽车	110	314.60	0.00
241	600919	江苏银行	52	283.92	0.00
242	600010	包钢股份	173	202.41	0.00

### 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	300760	迈瑞医疗	25,715	10,954,590.00	1.30
2	002080	中材科技	252,300	6,100,614.00	0.72
3	300207	欣旺达	179,300	5,506,303.00	0.65
4	300775	三角防务	139,200	5,487,264.00	0.65
5	300639	凯普生物	137,000	5,148,460.00	0.61
6	603882	金域医学	34,800	4,458,576.00	0.53
7	002641	永高股份	672,800	4,292,464.00	0.51
8	300476	胜宏科技	198,503	4,281,709.71	0.51
9	603043	广州酒家	108,000	4,182,840.00	0.49
10	300759	康龙化成	34,700	4,177,880.00	0.49
11	300244	迪安诊断	120,306	4,124,089.68	0.49
12	600862	中航高科	135,600	4,081,560.00	0.48
13	600143	金发科技	238,000	4,079,320.00	0.48
14	000951	中国重汽	119,336	3,754,310.56	0.44
15	600507	方大特钢	540,189	3,748,911.66	0.44
16	000581	威孚高科	161,500	3,745,185.00	0.44

17	002223	鱼跃医疗	131,500	3,709,615.00	0.44
18	601799	星宇股份	17,500	3,508,750.00	0.41
19	000513	丽珠集团	86,012	3,483,486.00	0.41
20	603233	大参林	42,300	3,314,205.00	0.39
21	601966	玲珑轮胎	90,700	3,189,919.00	0.38
22	603877	太平鸟	95,200	2,856,000.00	0.34
23	603939	益丰药房	28,500	2,570,415.00	0.30
24	600521	华海药业	75,100	2,539,131.00	0.30
25	603218	日月股份	81,160	2,455,090.00	0.29
26	002293	罗莱生活	196,800	2,450,160.00	0.29
27	603866	桃李面包	41,300	2,440,830.00	0.29
28	002281	光迅科技	83,000	2,410,320.00	0.29
29	002603	以岭药业	93,800	2,391,900.00	0.28
30	603806	福斯特	26,980	2,304,092.00	0.27
31	601098	中南传媒	235,500	2,244,315.00	0.27
32	603267	鸿远电子	17,000	2,188,920.00	0.26
33	600153	建发股份	221,392	1,817,628.32	0.21
34	300463	迈克生物	28,800	1,342,080.00	0.16
35	600563	法拉电子	12,200	1,312,110.00	0.16
36	600195	中牧股份	101,100	1,295,091.00	0.15
37	002372	伟星新材	68,400	1,279,080.00	0.15
38	600377	宁沪高速	136,111	1,253,582.31	0.15
39	600461	洪城水业	184,674	1,248,396.24	0.15
40	688521	芯原股份	13,200	1,029,468.00	0.12
41	002139	拓邦股份	125,400	1,016,994.00	0.12
42	000028	国药一致	17,700	810,660.00	0.10
43	688520	神州细胞	12,351	562,588.05	0.07
44	000885	城发环境	39,600	461,736.00	0.05

45	000921	海信家电	17,600	253,616.00	0.03
46	601952	苏垦农发	16,100	226,366.00	0.03
47	300896	爱美客	313	188,851.68	0.02
48	000932	华菱钢铁	33,500	160,130.00	0.02
49	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.02
50	688379	华光新材	4,950	116,968.50	0.01
51	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.01
52	300750	宁德时代	200	70,222.00	0.01
53	300454	深信服	200	49,602.00	0.01
54	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.01
55	603444	吉比特	100	42,600.00	0.01
56	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
57	603338	浙江鼎力	280	28,333.20	0.00
58	600486	扬农化工	212	27,984.00	0.00
59	600132	重庆啤酒	200	23,798.00	0.00
60	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
61	600779	水井坊	250	20,755.00	0.00
62	300770	新媒股份	280	19,684.00	0.00
63	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
64	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
65	300482	万孚生物	200	17,842.00	0.00
66	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
67	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
68	300308	中际旭创	297	15,105.42	0.00
69	603638	艾迪精密	200	13,788.00	0.00
70	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
71	600754	锦江酒店	200	10,306.00	0.00
72	600298	安琪酵母	200	10,214.00	0.00

73	002466	天齐锂业	246	9,660.42	0.00
74	002353	杰瑞股份	265	9,275.00	0.00
75	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
76	002705	新宝股份	211	8,914.75	0.00
77	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
78	300450	先导智能	100	8,399.00	0.00
79	002439	启明星辰	284	8,295.64	0.00
80	601689	拓普集团	200	7,686.00	0.00
81	300571	平治信息	200	7,616.00	0.00
82	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
83	603456	九洲药业	200	7,160.00	0.00
84	600729	重庆百货	236	6,820.40	0.00
85	600038	中直股份	106	6,647.26	0.00
86	603568	伟明环保	351	6,644.43	0.00
87	603858	步长制药	282	6,505.74	0.00
88	002242	九阳股份	200	6,408.00	0.00
89	002706	良信股份	200	6,128.00	0.00
90	603515	欧普照明	200	6,042.00	0.00
91	603228	景旺电子	200	6,030.00	0.00
92	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
93	600566	济川药业	283	5,725.09	0.00
94	603989	艾华集团	212	5,681.60	0.00
95	002294	信立泰	196	5,552.68	0.00
96	000547	航天发展	200	5,500.00	0.00
97	002299	圣农发展	200	5,308.00	0.00
98	603708	家家悦	249	5,303.70	0.00
99	000423	东阿阿胶	134	5,187.14	0.00
100	002572	索菲亚	200	5,180.00	0.00

101	300188	美亚柏科	239	5,148.06	0.00
102	000739	普洛药业	220	5,121.60	0.00
103	600323	瀚蓝环境	200	4,962.00	0.00
104	600372	中航电子	251	4,932.15	0.00
105	603260	合盛硅业	140	4,681.60	0.00
106	600612	老凤祥	101	4,578.33	0.00
107	000034	神州数码	208	4,463.68	0.00
108	603579	荣泰健康	144	4,344.48	0.00
109	002258	利尔化学	200	4,180.00	0.00
110	002511	中顺洁柔	200	4,174.00	0.00
111	002595	豪迈科技	139	4,121.35	0.00
112	601233	桐昆股份	195	4,015.05	0.00
113	300418	昆仑万维	200	3,990.00	0.00
114	000672	上峰水泥	200	3,902.00	0.00
115	600801	华新水泥	186	3,837.18	0.00
116	601615	明阳智能	200	3,796.00	0.00
117	300212	易华录	120	3,678.00	0.00
118	601636	旗滨集团	286	3,660.80	0.00
119	002368	太极股份	140	3,655.40	0.00
120	601677	明泰铝业	249	3,520.86	0.00
121	300383	光环新网	200	3,434.00	0.00
122	300294	博雅生物	100	3,354.00	0.00
123	600674	川投能源	298	2,994.90	0.00
124	601965	中国汽研	200	2,962.00	0.00
125	000987	越秀金控	200	2,912.00	0.00
126	603556	海兴电力	210	2,887.50	0.00
127	002078	太阳纸业	200	2,886.00	0.00
128	000789	万年青	210	2,793.00	0.00

129	600380	健康元	200	2,782.00	0.00
130	600720	祁连山	200	2,716.00	0.00
131	600449	宁夏建材	200	2,652.00	0.00
132	603609	禾丰牧业	221	2,612.22	0.00
133	000997	新大陆	170	2,597.60	0.00
134	600535	天士力	175	2,588.25	0.00
135	603368	柳药股份	120	2,584.80	0.00
136	002233	塔牌集团	200	2,548.00	0.00
137	002734	利民股份	200	2,542.00	0.00
138	000975	银泰黄金	280	2,410.80	0.00
139	300271	华宇软件	100	2,387.00	0.00
140	600977	中国电影	190	2,367.40	0.00
141	601137	博威合金	200	2,296.00	0.00
142	600188	兖州煤业	227	2,285.89	0.00
143	002065	东华软件	270	2,241.00	0.00
144	000501	鄂武商 A	190	2,213.50	0.00
145	002128	露天煤业	200	2,188.00	0.00
146	002318	久立特材	200	2,180.00	0.00
147	600598	北大荒	113	2,175.25	0.00
148	300024	机器人	176	2,164.80	0.00
149	002100	天康生物	200	2,118.00	0.00
150	600338	西藏珠峰	200	2,096.00	0.00
151	600483	福能股份	261	2,069.73	0.00
152	002064	华峰氨纶	200	2,018.00	0.00
153	601997	贵阳银行	246	1,955.70	0.00
154	002468	申通快递	189	1,905.12	0.00
155	600089	特变电工	184	1,867.60	0.00
156	600350	山东高速	272	1,680.96	0.00

157	000810	创维数字	200	1,598.00	0.00
158	603328	依顿电子	200	1,590.00	0.00
159	002737	葵花药业	100	1,467.00	0.00
160	600266	城建发展	288	1,463.04	0.00
161	601139	深圳燃气	200	1,448.00	0.00
162	002815	崇达技术	100	1,444.00	0.00
163	300251	光线传媒	116	1,400.12	0.00
164	600466	蓝光发展	299	1,384.37	0.00
165	002110	三钢闽光	203	1,366.19	0.00
166	600510	黑牡丹	200	1,358.00	0.00
167	300017	网宿科技	194	1,336.66	0.00
168	601717	郑煤机	122	1,333.46	0.00
169	600373	中文传媒	128	1,291.52	0.00
170	601298	青岛港	200	1,286.00	0.00
171	000402	金融街	193	1,244.85	0.00
172	002429	兆驰股份	200	1,240.00	0.00
173	000553	安道麦 A	158	1,235.56	0.00
174	600548	深高速	139	1,234.32	0.00
175	600100	同方股份	198	1,227.60	0.00
176	002698	博实股份	100	1,212.00	0.00
177	600398	海澜之家	188	1,206.96	0.00
178	000060	中金岭南	250	1,205.00	0.00
179	300070	碧水源	155	1,185.75	0.00
180	600167	联美控股	100	1,135.00	0.00
181	001965	招商公路	164	1,129.96	0.00
182	600901	江苏租赁	200	1,102.00	0.00
183	601058	赛轮轮胎	181	1,093.24	0.00
184	002081	金螳螂	115	1,079.85	0.00

185	000828	东莞控股	106	1,067.42	0.00
186	000598	兴蓉环境	200	960.00	0.00
187	002244	滨江集团	200	918.00	0.00
188	000059	华锦股份	164	905.28	0.00
189	601958	金钼股份	143	888.03	0.00
190	600023	浙能电力	239	867.57	0.00
191	600546	山煤国际	100	851.00	0.00
192	600415	小商品城	148	815.48	0.00
193	600970	中材国际	115	791.20	0.00
194	600395	盘江股份	100	787.00	0.00
195	601018	宁波港	193	756.56	0.00
196	603660	苏州科达	102	744.60	0.00
197	600026	中远海能	100	668.00	0.00
198	002697	红旗连锁	100	661.00	0.00
199	600185	格力地产	100	646.00	0.00
200	000488	晨鸣纸业	100	642.00	0.00
201	600987	航民股份	111	636.03	0.00
202	002531	天顺风能	74	623.08	0.00
203	600339	中油工程	200	616.00	0.00
204	601666	平煤股份	100	593.00	0.00
205	600170	上海建工	194	583.94	0.00
206	600704	物产中大	132	576.84	0.00
207	600578	京能电力	189	570.78	0.00
208	600583	海油工程	119	534.31	0.00
209	600782	新钢股份	116	532.44	0.00
210	600033	福建高速	200	526.00	0.00
211	002540	亚太科技	100	520.00	0.00
212	000413	东旭光电	198	506.88	0.00

213	600477	杭萧钢构	128	480.00	0.00
214	601898	中煤能源	100	445.00	0.00
215	600761	安徽合力	30	426.00	0.00
216	600219	南山铝业	130	410.80	0.00
217	000898	鞍钢股份	130	395.20	0.00
218	000630	铜陵有色	144	370.08	0.00
219	600282	南钢股份	111	346.32	0.00
220	600688	上海石化	100	344.00	0.00
221	600567	山鹰国际	112	338.24	0.00
222	601228	广州港	100	336.00	0.00
223	601992	金隅集团	100	297.00	0.00
224	601212	白银有色	100	296.00	0.00
225	000709	河钢股份	113	253.12	0.00
226	000415	渤海租赁	100	240.00	0.00
227	600968	海油发展	100	239.00	0.00
228	000429	粤高速 A	21	127.05	0.00

## 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	000858	五粮液	56,280,790.72	5.39
2	601318	中国平安	52,131,752.71	4.99
3	600887	伊利股份	45,449,207.17	4.35
4	600519	贵州茅台	42,698,157.63	4.09
5	600900	长江电力	41,508,897.00	3.97
6	600030	中信证券	34,341,928.42	3.29

7	600837	海通证券	34,049,348.00	3.26
8	600276	恒瑞医药	31,078,010.40	2.97
9	000001	平安银行	30,871,942.60	2.95
10	000333	美的集团	30,618,018.14	2.93
11	000568	泸州老窖	27,886,646.54	2.67
12	601012	隆基股份	27,075,303.63	2.59
13	002415	海康威视	26,735,568.06	2.56
14	603288	海天味业	26,700,453.66	2.56
15	300059	东方财富	26,519,121.16	2.54
16	600438	通威股份	26,298,691.29	2.52
17	600036	招商银行	26,218,688.93	2.51
18	000002	万科 A	25,392,998.00	2.43
19	600048	保利地产	25,288,519.71	2.42
20	000895	双汇发展	22,889,756.07	2.19
21	002714	牧原股份	22,451,002.00	2.15
22	601166	兴业银行	22,079,225.52	2.11
23	600570	恒生电子	21,771,331.77	2.08
24	000538	云南白药	21,573,169.81	2.06
25	002241	歌尔股份	21,569,516.00	2.06
26	600016	民生银行	21,500,010.20	2.06

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	601318	中国平安	84,297,107.09	8.07
2	000858	五粮液	81,998,667.86	7.85
3	600519	贵州茅台	60,596,859.88	5.80

4	000333	美的集团	54,436,921.78	5.21
5	600276	恒瑞医药	45,705,787.83	4.37
6	600837	海通证券	42,572,788.98	4.07
7	600030	中信证券	42,139,046.80	4.03
8	002415	海康威视	41,729,044.16	3.99
9	600036	招商银行	41,593,354.95	3.98
10	600000	浦发银行	36,662,032.04	3.51
11	601166	兴业银行	36,222,603.99	3.47
12	600585	海螺水泥	35,652,510.29	3.41
13	601012	隆基股份	35,292,630.50	3.38
14	600900	长江电力	32,345,450.59	3.10
15	000002	万科 A	32,094,203.96	3.07
16	603288	海天味业	29,948,847.30	2.87
17	601601	中国太保	29,912,494.15	2.86
18	300498	温氏股份	28,360,349.77	2.71
19	600570	恒生电子	27,759,674.01	2.66
20	000895	双汇发展	27,537,227.46	2.64
21	600031	三一重工	26,881,139.88	2.57
22	601818	光大银行	26,693,653.61	2.55
23	600016	民生银行	25,815,313.00	2.47
24	600809	山西汾酒	25,280,271.74	2.42
25	601668	中国建筑	24,618,564.00	2.36
26	603259	药明康德	24,153,169.56	2.31
27	000538	云南白药	23,419,017.00	2.24
28	601688	华泰证券	22,995,793.72	2.20
29	000568	泸州老窖	22,978,080.39	2.20
30	600887	伊利股份	22,775,541.63	2.18
31	000661	长春高新	22,560,391.17	2.16

32	600690	海尔智家	22,088,371.63	2.11
33	600438	通威股份	21,826,207.00	2.09
34	600919	江苏银行	21,332,815.07	2.04
35	002475	立讯精密	21,311,797.74	2.04
36	300122	智飞生物	20,964,683.77	2.01

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	2,967,237,258.37
卖出股票收入（成交）总额	3,397,767,281.65

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	13,958.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,958.20	0.00

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113611	福 20 转债	90	12,958.20	0.00
2	113044	大秦转债	10	1,000.00	0.00
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货，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，期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

本报告期本基金投资的前十名证券除兴业银行外，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。

根据福建银保监局公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保，于 2020 年 8 月 31 日被福建银保监局处以罚款。

根据中国人民银行福州中心支行公布的行政处罚信息公示表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等案由，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行处以罚款。

本基金经理分析认为，长城久泰基金是一只采取指数复制策略为主的增强指数基金，复制标的指数的成分股及其权重、控制跟踪误差是本基金运作的主要目标，上述事项不影响本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度对兴业银行进行投资。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 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	175,096.45
2	应收证券清算款	1,664,116.95
3	应收股利	-
4	应收利息	6,009.14
5	应收申购款	128,991.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,974,213.70
---	----	--------------

#### 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：本基金本报告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：本基金本报告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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 泰 沪 深 300 指 数 A	24,050	12,888.58	58,786,709.41	18.97%	251,183,535.68	81.03%
长 城 久 泰 沪 深 300 指 数 C	2,955	10,954.18	29,282,576.87	90.46%	3,087,016.39	9.54%
合计	27,005	12,676.91	88,069,286.28	25.73%	254,270,552.07	74.27%

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长城久泰	431,602.41	0.1392%
	沪深 300 指数 A		
	长城久泰	76.62	0.0002%

	沪深 300 指数 C		
	合计	431,679.03	0.1261%

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	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	长城久泰沪深 300 指 数 A	0
	长城久泰沪深 300 指 数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长城久泰沪深 300 指 数 A	0
	长城久泰沪深 300 指 数 C	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。

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2004 年 5 月 21 日）基金 份额总额	1,512,020,891.32	-
本报告期期初基金份额总额	469,450,594.08	100,632,764.84
本报告期基金总申购份额	101,888,839.36	32,018,983.03
减：本报告期基金总赎回份额	261,369,188.35	100,282,154.61
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-” 填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	309,970,245.09	32,369,593.26

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生不再担任长城基金管理有限公司总经理，由董事长王军先生代为履职。

自 2020 年 6 月 19 日起，彭洪波先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生、金树良先生、杨玉成先生、杨超先生不再担任公司董事，由张文栋先生、朱静女士、韩飞先生担任公司董事。

自 2020 年 6 月 19 日起，鄢维民先生不再担任公司独立董事。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任长城基金管理有限公司总经理，董事长王军先生不再代任。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任公司董事。

自 2020 年 8 月 24 日起，温子健先生担任公司董事。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 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九万元。

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

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本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

### 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	2	6,341,527,236.29	100.00%	1,466,787.47	100.00%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 0 个专用交易单元，截止本报告期末共计 7 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，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。

### 11.7.2 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	13,633,338.57	100.00%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	长城基金关于旗下基金 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告	本基金管理人网站	2020 年 1 月 31 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(闻泰科技)	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	2020 年 3 月 17 日
3	长城基金管理有限公司关于延期披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
4	关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改长城久泰基金合同及托管协	中国证券报及本基金管理人网站	2020 年 3 月 31 日

	议的公告		
5	长城基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理有限公司网站	2020 年 5 月 27 日
6	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有限公司网站	2020 年 7 月 1 日
7	长城基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并更新、完善身份信息以免影响业务办理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理有限公司网站	2020 年 7 月 3 日
8	长城基金关于旗下部分开放式基金参与建设银行开展的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有限公司网站	2020 年 10 月 12 日
9	长城基金管理有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理有限公司网站	2020 年 10 月 30 日
10	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有限公司网站	2020 年 12 月 31 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城久泰沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- (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

### 13.2 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

### 13.3 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)