

长城久泰沪深 300 指数 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期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 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	12
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	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
8.3 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	68
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74

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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

§ 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	530,217,367.68 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
报告期末下属分级基金的份额总额	305,177,034.84 份	225,040,332.84 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	（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%。（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。（3）债券投资策略：本基金债券投资部分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	$95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。
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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	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 40、41 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

基金级别	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	82,696,514.73	12,211,766.84
本期利润	31,362,117.15	7,724,178.03
加权平均基金份额本期利润	0.1031	0.1349
本期加权平均净值利润率	4.05%	6.22%
本期基金份额净值增长率	4.00%	3.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	303,573,416.16	243,642,185.33
期末可供分配基金份额利润	0.9947	1.0827
期末基金资产净值	794,581,850.18	477,898,980.24
期末基金份额净值	2.6037	2.1236
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	573.62%	83.27%

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

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	1.08%	0.92%	-1.91%	0.76%	2.99%	0.16%
过去三个月	6.05%	0.97%	3.32%	0.93%	2.73%	0.04%
过去六个月	4.00%	1.29%	0.29%	1.25%	3.71%	0.04%
过去一年	31.89%	1.26%	24.20%	1.27%	7.69%	-0.01%
过去三年	70.13%	1.28%	46.48%	1.30%	23.65%	-0.02%
自基金合同生效起至今	573.62%	1.58%	354.38%	1.58%	219.24%	0.00%

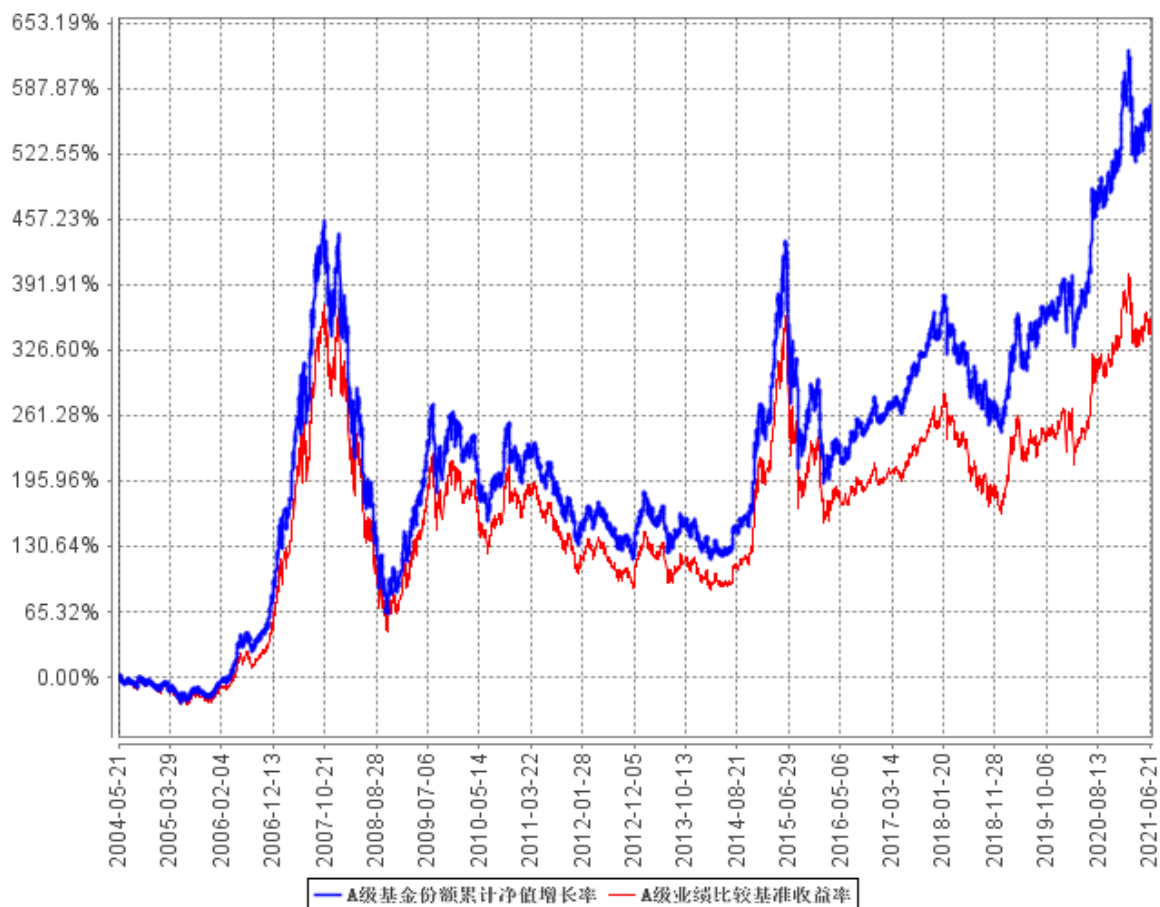
长城久泰沪深 300 指数 C

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
过去一个月	1.11%	0.92%	-1.91%	0.76%	3.02%	0.16%
过去三个月	6.01%	0.97%	3.32%	0.93%	2.69%	0.04%
过去六个月	3.89%	1.29%	0.29%	1.25%	3.60%	0.04%
过去一年	31.55%	1.26%	24.20%	1.27%	7.35%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	83.27%	1.26%	64.15%	1.27%	19.12%	-0.01%

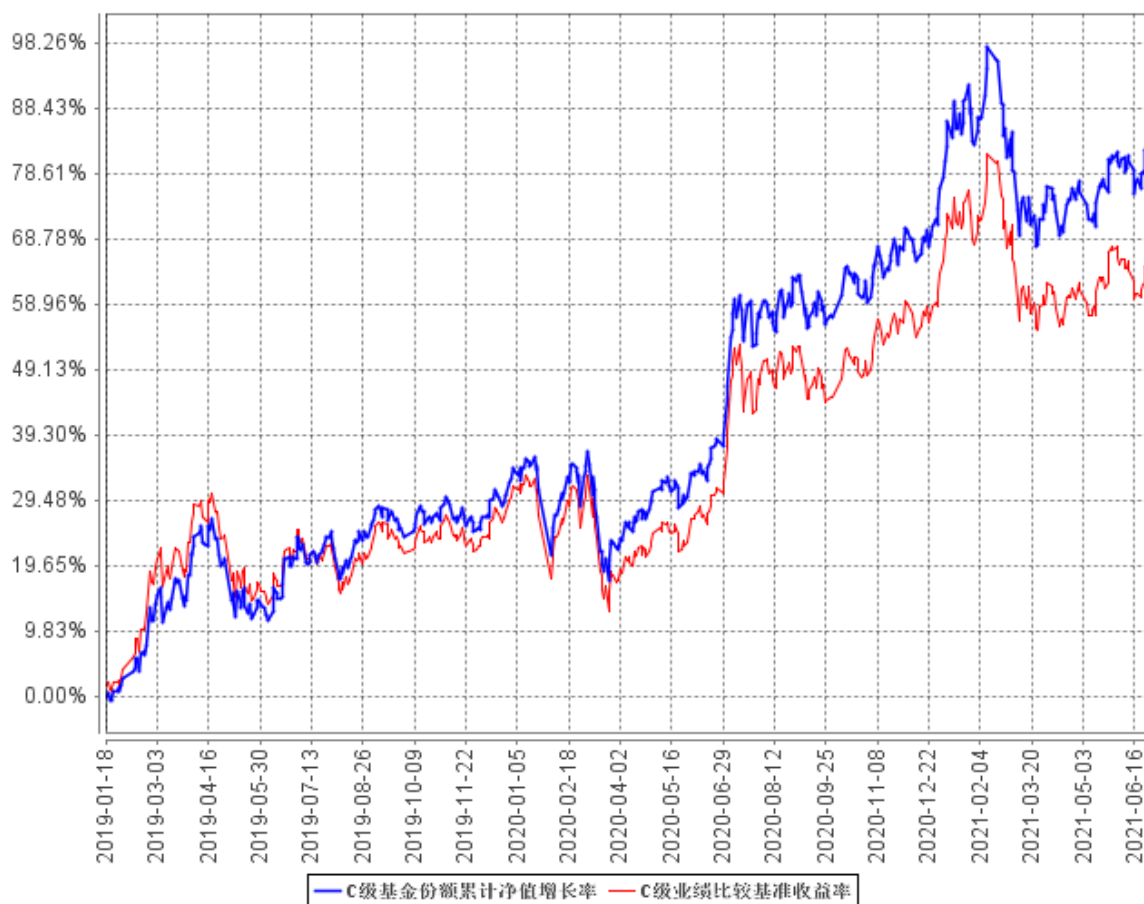
注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

§ 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，公司管理的基金包括：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、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城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、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、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、长城创新驱动混合型证券投资基金、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、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金。

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、投资总监、权益投资部总经理，长城久泰沪深 300 指数、长城品牌优选混合、长城核心优势混合、长城价值优选混合、长城消费 30 股票的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	21 年	男，中国籍，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	公司总经理助理、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、长城中国智造混合的基金经理，兼任长城量化 1 号投资经理	2018 年 11 月 30 日	-	13 年	男，中国籍，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。
----	--	------------------	---	------	--

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
雷俊	公募基金	7	3,140,850,402.16	2014-12-23
	私募资产管理计划	1	30,240,411.58	2021-04-07
	其他组合	0	0.00	-

	合计	8	3,171,090,813.74	-
--	----	---	------------------	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰沪深 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

上半年的行情市场风格切换明显，核心资产的波动率显著放大，由前期的“大盘动量成长”风格切换到“中小盘价值”风格，报告期内动量成长因子表现出较大波动，创业板指数上半年领跑 A 股主要宽基指数，沪深 300 大盘指数受核心资产影响表现不佳。本基金产品运作坚持指数增强的投资思路，均衡各个风险因子，上半年小幅跑赢业绩基准。

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

截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额净值为 2.6037 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.00%;截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额净值为 2.1236 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.89%;同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看,当前 A 股市场的估值处在近年来偏中枢位置,当前估值较春节高点已经回落明显,处在相对合理的区间,估值波动带来的下行空间预计较为有限;从上半年的上市公司整理盈利来看,盈利增长对估值消化显著,各个大型指数一致预期今年同比增幅较高,基本面数据依然强劲,下半年成长性驱动股价有望更为显著;从全球横向比较来看,中国股市估值不贵,长周期配置逻辑没有改变,预期权益市场仍旧是最有吸引力的资产配置方向,沪深 300 指数作为 A 股基本盘,看好其稳步向上空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的,则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及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专业从业经验,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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，按基金合同规定，本基金进行了 1 次收益分配，C 类基金共分配金额为 23,601,268.22 元。

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

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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	35,609,588.07	44,302,934.69
结算备付金		6,813,492.34	1,605,409.96
存出保证金		153,525.65	175,096.45
交易性金融资产	6.4.7.2	1,233,054,348.71	801,164,843.11
其中：股票投资		1,203,802,086.31	801,150,884.91
基金投资		-	-
债券投资		29,252,262.40	13,958.20
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		175,268.21	1,664,116.95
应收利息	6.4.7.5	518,046.70	6,009.14
应收股利		-	-
应收申购款		852,840.07	128,991.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,277,177,109.75	849,047,401.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	-
应付赎回款		2,626,000.24	2,152,445.95
应付管理人报酬		980,404.87	707,774.47
应付托管费		200,082.64	144,443.78
应付销售服务费		105,794.93	17,017.17
应付交易费用	6.4.7.7	685,570.96	243,933.09
应交税费		0.68	0.93

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,425.01	217,588.53
负债合计		4,696,279.33	3,483,203.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	530,217,367.68	342,339,838.35
未分配利润	6.4.7.10	742,263,462.74	503,224,359.19
所有者权益合计		1,272,480,830.42	845,564,197.54
负债和所有者权益总计		1,277,177,109.75	849,047,401.46

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长城久泰沪深 300 指数基金份额净值为 2.3999 元，其中基金份额净值 A 级 2.6037，C 级 2.1236；基金总份额为 530,217,367.68 份，其中基金份额 A 级 305,177,034.84 份，C 级 225,040,332.84 份。

6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		47,592,989.85	52,668,912.41
1.利息收入		456,521.80	323,331.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	66,252.00	119,122.95
债券利息收入		390,269.80	204,208.34
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）		102,766,894.38	93,144,054.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	93,687,821.37	83,058,740.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	346,211.93	271,643.53
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	8,732,861.08	9,813,670.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-55,821,986.39	-41,179,692.28
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	191,560.06	381,219.01
减：二、费用		8,506,694.67	8,195,873.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,375,692.28	3,976,763.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	892,998.41	811,584.42
3. 销售服务费		182,496.27	124,046.46
4. 交易费用	6.4.7.19	2,965,397.13	3,174,886.04
5. 利息支出		2,111.27	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,111.27	-
6. 税金及附加		0.46	0.86
7. 其他费用	6.4.7.20	87,998.85	108,592.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,086,295.18	44,473,038.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,086,295.18	44,473,038.86

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	342,339,838.35	503,224,359.19	845,564,197.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,086,295.18	39,086,295.18
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）	187,877,529.33	223,554,076.59	411,431,605.92
其中：1.基金申购款	283,415,471.76	356,678,329.13	640,093,800.89
2. 基金赎回款	-95,537,942.43	-133,124,252.54	-228,662,194.97
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	-	-23,601,268.22	-23,601,268.22

少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	530,217,367.68	742,263,462.74	1,272,480,830.42
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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)	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)	-	44,473,038.86	44,473,038.86
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)	-144,964,067.63	-118,443,716.47	-263,407,784.10
其中: 1.基金申购款	77,228,209.59	59,117,086.11	136,345,295.70
2.基金赎回款	-222,192,277.22	-177,560,802.58	-399,753,079.80
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)	425,119,291.29	400,729,500.25	825,848,791.54

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:

_____ 王军	_____ 邱春杨	_____ 赵永强
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”）。

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的优化调整。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 $+5\% \times$ 银行同业存款利率。

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《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 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。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金于本期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

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. 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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	35,609,588.07
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：	35,609,588.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,143,939,225.88	1,203,802,086.31	59,862,860.43
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	29,327,225.60	29,252,262.40	-74,963.20
	银行间市场	—	—	—
	合计	29,327,225.60	29,252,262.40	-74,963.20
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,173,266,451.48	1,233,054,348.71	59,787,897.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,531.38
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	3,066.10
应收债券利息	511,380.12
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	69.10
合计	518,046.70

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	685,570.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	685,570.96

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 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	14,122.45
应付证券出借违约金	—

预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	98,425.01

6.4.7.9 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,970,245.09	309,970,245.09
本期申购	52,978,301.41	52,978,301.41
本期赎回(以“-”号填列)	-57,771,511.66	-57,771,511.66
— 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	305,177,034.84	305,177,034.84

金额单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,369,593.26	32,369,593.26
本期申购	230,437,170.35	230,437,170.35
本期赎回(以“-”号填列)	-37,766,430.77	-37,766,430.77
— 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	225,040,332.84	225,040,332.84

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。

6.4.7.10 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	224,739,368.83	241,290,017.91	466,029,386.74

本期利润	82,696,514.73	-51,334,397.58	31,362,117.15
本期基金份额交易产生的变动数	-3,862,467.40	-4,124,221.15	-7,986,688.55
其中：基金申购款	43,502,952.00	38,356,452.97	81,859,404.97
基金赎回款	-47,365,419.40	-42,480,674.12	-89,846,093.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	303,573,416.16	185,831,399.18	489,404,815.34

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	31,118,666.59	6,076,305.86	37,194,972.45
本期利润	12,211,766.84	-4,487,588.81	7,724,178.03
本期基金份额交易产生的变动数	223,913,020.12	7,627,745.02	231,540,765.14
其中：基金申购款	264,132,350.37	10,686,573.79	274,818,924.16
基金赎回款	-40,219,330.25	-3,058,828.77	-43,278,159.02
本期已分配利润	-23,601,268.22	-	-23,601,268.22
本期末	243,642,185.33	9,216,462.07	252,858,647.40

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,689.61
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	19,405.97
其他	1,156.42
合计	66,252.00

注：其他包括交易所结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,729,661,014.70
减：卖出股票成本总额	1,635,973,193.33
买卖股票差价收入	93,687,821.37

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,507,691.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,147,971.00
减：应收利息总额	13,508.97
买卖债券差价收入	346,211.93

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金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：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,732,861.08
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,732,861.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-55,821,986.39

——股票投资	-55,743,064.99
——债券投资	-78,921.40
——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	-55,821,986.39

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	183,201.05
转出基金补偿收入 A200002	8,337.43
转出基金补偿收入 C006912	21.58
合计	191,560.06

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,965,397.13
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,965,397.13

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	3,696.29
合计	87,998.85

6.4.7.21 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。

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

截至财务报表批准日，本基金于 2021 年 8 月 17 日进行了 1 次收益分配，长城久泰沪深 300 指数 C 分配金额为 36,741,826.39 元，符合基金合同的规定。除上述利润分配事项外，本基金无其他需要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

于本报告期，并无对本基金存在控制关系或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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	3,819,483,760.46	100.00%	3,664,675,351.12	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	32,494,295.53	100.00%	11,353,336.77	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长城证券	17,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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

东方证券	-	-	-	-
长城证券	883,756.92	100.00%	685,570.96	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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
东方证券	-	-	-	-
长城证券	847,633.26	100.00%	427,100.99	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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,375,692.28	3,976,763.69
其中：支付销售机构的客户维护费	982,556.47	701,036.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 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

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	892,998.41	811,584.42

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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
长城基金	-	173,494.08	173,494.08
合计	-	173,494.08	173,494.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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
长城基金	-	117,100.49	117,100.49
合计	-	117,100.49	117,100.49

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%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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 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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本期无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
招商银行	35,609,588.07	45,689.61	35,479,845.08	97,518.00

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。

6.4.10.7 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未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

长城久泰沪深 300 指数 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 6 月 22 日	-	2021 年 6 月 22 日	1.0500	23,540,669.93	60,598.29	23,601,268.22	
合计	-		-	1.0500	23,540,669.93	60,598.29	23,601,268.22	

6.4.12 期末（2021 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
688316	青云科技	2021 年 3 月 5 日	2021 年 9 月 16 日	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688456	有研粉材	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 17 日	新股锁定	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-

688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	C 利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

		日	7 日							
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

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
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项停牌	5.59	2021 年 7 月 6 日	6.15	117	1,271.96	654.03	-

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金于本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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、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。

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。本基金投资于一家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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

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、存出保证金及债券投资等。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 2021 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	35,609,588.07	-	-	-	-	-	35,609,588.07
结算备付金	6,813,492.34	-	-	-	-	-	6,813,492.34
存出保证金	153,525.65	-	-	-	-	-	153,525.65
交易性金融资产	-	-	29,252,262.40	-	-	1,203,802,086.31	1,233,054,348.71
应收证券清算款	-	-	-	-	-	175,268.21	175,268.21
应收利息	-	-	-	-	-	518,046.70	518,046.70
应收申购款	-	-	-	-	-	852,840.07	852,840.07
资产总计	42,576,606.06	-	29,252,262.40	-	-	1,205,348,241.29	1,277,177,109.75
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,626,000.24	2,626,000.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	980,404.87	980,404.87
应付托管费	-	-	-	-	-	200,082.64	200,082.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	105,794.93	105,794.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	685,570.96	685,570.96
应交税费	-	-	-	-	-	0.68	0.68
其他负债	-	-	-	-	-	98,425.01	98,425.01
负债总计	-	-	-	-	-	4,696,279.33	4,696,279.33

利率敏感 度缺口	42,576,606.06		-29,252,262.40				
上年度末 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		

6.4.13.4.1.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）

	利率上升 25 个基点	-27,887.03	0.00
	利率下降 25 个基点	27,940.91	0.00

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动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。

6.4.13.4.2 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：

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,203,802,086.31	94.60	801,150,884.91	94.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	29,252,262.40	2.30	13,958.20	0.00
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	1,233,054,348.71	96.90	801,164,843.11	94.75

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	76,086,310.87	39,412,617.78
	沪深 300 指数下降 5%	-76,086,310.87	-39,412,617.78

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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 2021 年 06 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 1,231,882,190.3 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,172,158.41 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。

§ 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	1,203,802,086.31	94.25
	其中：股票	1,203,802,086.31	94.25
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	29,252,262.40	2.29
	其中：债券	29,252,262.40	2.29
	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	42,423,080.41	3.32
8	其他各项资产	1,699,680.63	0.13
9	合计	1,277,177,109.75	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	11,121,736.44	0.87
B	采矿业	18,980,114.34	1.49
C	制造业	528,648,631.44	41.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,413,482.34	1.21
E	建筑业	1,496,873.37	0.12
F	批发和零售业	1,049,703.70	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	20,558,157.42	1.62
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,325,442.45	0.58
J	金融业	285,834,719.40	22.46
K	房地产业	16,202,672.56	1.27
L	租赁和商务服务业	56,143,480.53	4.41

M	科学研究和技术服务业	23,720.00	0.00
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	46,855,510.66	3.68
R	文化、体育和娱乐业	14,686.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,009,668,930.65	79.35

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	6,466.48	0.00
B	采矿业	18,642.66	0.00
C	制造业	168,904,624.52	13.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,885.46	0.00
E	建筑业	325,438.87	0.03
F	批发和零售业	6,932,311.44	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	12,135.43	0.00
H	住宿和餐饮业	11,390.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,478,252.12	0.98
J	金融业	43,929.72	0.00
K	房地产业	13,529.04	0.00
L	租赁和商务服务业	2,254.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	69,209.70	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	35,484.98	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38.30	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,249,562.74	0.41
S	综合	-	-
	合计	194,133,155.66	15.26

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	600519	贵州茅台	32,906	67,677,770.20	5.32
2	601318	中国平安	886,593	56,990,198.04	4.48
3	000858	五粮液	151,309	45,073,438.01	3.54
4	600036	招商银行	708,878	38,414,098.82	3.02
5	300059	东方财富	1,073,966	35,215,345.14	2.77
6	601888	中国中免	114,004	34,212,600.40	2.69
7	000725	京东方 A	4,704,964	29,358,975.36	2.31
8	600809	山西汾酒	59,800	26,790,400.00	2.11
9	300124	汇川技术	348,090	25,849,163.40	2.03
10	002142	宁波银行	648,365	25,266,784.05	1.99
11	600763	通策医疗	59,000	24,249,000.00	1.91
12	000100	TCL 科技	3,042,218	23,272,967.70	1.83
13	603882	金域医学	141,100	22,543,547.00	1.77
14	002027	分众传媒	2,330,593	21,930,880.13	1.72
15	002179	中航光电	259,111	20,474,951.22	1.61
16	603659	璞泰来	149,340	20,399,844.00	1.60
17	600426	华鲁恒升	652,968	20,209,359.60	1.59
18	000333	美的集团	276,621	19,742,440.77	1.55
19	601225	陕西煤业	1,597,483	18,930,173.55	1.49
20	603501	韦尔股份	58,300	18,772,600.00	1.48
21	601838	成都银行	1,343,800	16,985,632.00	1.33
22	601601	中国太保	559,733	16,215,465.01	1.27
23	601919	中远海控	486,800	14,866,872.00	1.17
24	601398	工商银行	2,718,124	14,052,701.08	1.10
25	002415	海康威视	213,675	13,782,037.50	1.08
26	601211	国泰君安	662,207	11,350,227.98	0.89
27	600741	华域汽车	430,960	11,321,319.20	0.89
28	600919	江苏银行	1,584,568	11,250,432.80	0.88
29	002714	牧原股份	182,814	11,118,747.48	0.87
30	600132	重庆啤酒	56,100	11,104,995.00	0.87
31	601799	星宇股份	49,100	11,082,852.00	0.87
32	300529	健帆生物	126,137	10,893,191.32	0.86
33	601658	邮储银行	2,082,300	10,453,146.00	0.82

34	002001	新 和 成	359,248	10,303,232.64	0.81
35	600019	宝钢股份	1,347,662	10,296,137.68	0.81
36	000776	广发证券	669,112	10,130,355.68	0.80
37	000661	长春高新	25,210	9,756,270.00	0.77
38	601155	新城控股	233,657	9,720,131.20	0.76
39	000786	北新建材	245,200	9,624,100.00	0.76
40	002821	凯莱英	25,500	9,501,300.00	0.75
41	603392	万泰生物	36,266	9,399,421.88	0.74
42	601633	长城汽车	214,372	9,344,475.48	0.73
43	000001	平安银行	401,753	9,087,652.86	0.71
44	300595	欧普康视	84,900	8,791,395.00	0.69
45	600030	中信证券	350,932	8,752,244.08	0.69
46	002311	海大集团	106,600	8,698,560.00	0.68
47	688036	传音控股	40,210	8,423,995.00	0.66
48	002032	苏 泊 尔	128,400	8,190,636.00	0.64
49	300408	三环集团	187,500	7,953,750.00	0.63
50	603806	福斯特	74,636	7,846,482.68	0.62
51	600795	国电电力	3,011,582	7,318,144.26	0.58
52	600845	宝信软件	142,240	7,240,016.00	0.57
53	600031	三一重工	248,791	7,232,354.37	0.57
54	601288	农业银行	2,365,231	7,166,649.93	0.56
55	601985	中国核电	1,408,700	7,128,022.00	0.56
56	000002	万 科 A	271,781	6,471,105.61	0.51
57	300122	智飞生物	34,207	6,387,473.11	0.50
58	601006	大秦铁路	858,828	5,651,088.24	0.44
59	601336	新华保险	115,486	5,301,962.26	0.42
60	600309	万华化学	47,500	5,168,950.00	0.41
61	600061	国投资本	576,228	4,892,175.72	0.38
62	601166	兴业银行	202,120	4,153,566.00	0.33
63	000063	中兴通讯	123,318	4,097,857.14	0.32
64	603799	华友钴业	31,534	3,601,182.80	0.28
65	601012	隆基股份	29,981	2,663,512.04	0.21
66	002493	荣盛石化	107,850	1,862,569.50	0.15
67	601100	恒立液压	20,500	1,761,360.00	0.14
68	601618	中国中冶	500,202	1,490,601.96	0.12
69	601607	上海医药	48,259	1,019,712.67	0.08
70	600900	长江电力	46,719	964,280.16	0.08
71	002049	紫光国微	6,200	955,978.00	0.08
72	000568	泸州老窖	235	55,445.90	0.00

73	601328	交通银行	10,313	50,533.70	0.00
74	000596	古井贡酒	200	47,900.00	0.00
75	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.00
76	603288	海天味业	343	44,229.85	0.00
77	002594	比亚迪	155	38,905.00	0.00
78	300347	泰格医药	200	38,660.00	0.00
79	600547	山东黄金	1,813	34,845.86	0.00
80	002304	洋河股份	163	33,773.60	0.00
81	300033	同花顺	293	33,044.54	0.00
82	000538	云南白药	280	32,401.60	0.00
83	603833	欧派家居	213	30,237.48	0.00
84	300601	康泰生物	200	29,800.00	0.00
85	300558	贝达药业	256	27,709.44	0.00
86	002916	深南电路	248	27,560.24	0.00
87	300014	亿纬锂能	251	26,086.43	0.00
88	603160	汇顶科技	200	25,926.00	0.00
89	002841	视源股份	200	24,858.00	0.00
90	600570	恒生电子	265	24,711.25	0.00
91	300676	华大基因	200	23,720.00	0.00
92	300015	爱尔眼科	327	23,210.46	0.00
93	600600	青岛啤酒	200	23,130.00	0.00
94	603658	安图生物	260	19,700.20	0.00
95	600745	闻泰科技	200	19,380.00	0.00
96	300450	先导智能	320	19,244.80	0.00
97	002007	华兰生物	474	17,386.32	0.00
98	600760	中航沈飞	280	16,884.00	0.00
99	603338	浙江鼎力	280	16,433.20	0.00
100	000895	双汇发展	482	15,327.60	0.00
101	603939	益丰药房	260	14,583.40	0.00
102	002271	东方雨虹	250	13,830.00	0.00
103	600660	福耀玻璃	243	13,571.55	0.00
104	002352	顺丰控股	200	13,540.00	0.00
105	002230	科大讯飞	196	13,245.68	0.00
106	600009	上海机场	274	13,187.62	0.00
107	002460	赣锋锂业	100	12,109.00	0.00
108	002241	歌尔股份	282	12,052.68	0.00
109	000963	华东医药	260	11,962.60	0.00
110	600196	复星医药	165	11,901.45	0.00
111	600588	用友网络	355	11,807.30	0.00

112	300413	芒果超媒	170	11,662.00	0.00
113	002475	立讯精密	229	10,534.00	0.00
114	000425	徐工机械	1,626	10,357.62	0.00
115	600585	海螺水泥	239	9,810.95	0.00
116	002601	龙蟒佰利	268	9,267.44	0.00
117	600872	中炬高新	217	9,118.34	0.00
118	601877	正泰电器	271	9,045.98	0.00
119	600438	通威股份	200	8,654.00	0.00
120	000651	格力电器	163	8,492.30	0.00
121	603899	晨光文具	100	8,456.00	0.00
122	601628	中国人寿	249	8,438.61	0.00
123	600332	白云山	237	8,022.45	0.00
124	600690	海尔智家	299	7,747.09	0.00
125	002129	中环股份	200	7,720.00	0.00
126	601021	春秋航空	127	7,226.30	0.00
127	002938	鹏鼎控股	200	7,176.00	0.00
128	300433	蓝思科技	241	7,087.81	0.00
129	002508	老板电器	152	7,068.00	0.00
130	002410	广联达	100	6,820.00	0.00
131	600893	航发动力	126	6,701.94	0.00
132	300003	乐普医疗	199	6,391.88	0.00
133	688111	金山办公	16	6,316.80	0.00
134	601066	中信建投	200	6,286.00	0.00
135	002050	三花智控	260	6,234.80	0.00
136	300136	信维通信	200	6,176.00	0.00
137	300142	沃森生物	100	6,170.00	0.00
138	600085	同仁堂	148	6,045.80	0.00
139	000938	紫光股份	274	5,995.12	0.00
140	000768	中航西飞	216	5,676.48	0.00
141	000977	浪潮信息	200	5,626.00	0.00
142	002153	石基信息	232	5,454.32	0.00
143	600887	伊利股份	136	5,008.88	0.00
144	600118	中国卫星	169	4,944.94	0.00
145	600104	上汽集团	224	4,921.28	0.00
146	601088	中国神华	251	4,899.52	0.00
147	002555	三七互娱	200	4,804.00	0.00
148	002624	完美世界	200	4,782.00	0.00
149	000338	潍柴动力	258	4,610.46	0.00
150	000708	中信特钢	220	4,584.80	0.00

151	002236	大华股份	206	4,346.60	0.00
152	002008	大族激光	107	4,321.73	0.00
153	600521	华海药业	200	4,176.00	0.00
154	600143	金发科技	200	4,172.00	0.00
155	601688	华泰证券	253	3,997.40	0.00
156	600999	招商证券	205	3,899.10	0.00
157	000625	长安汽车	147	3,863.16	0.00
158	600109	国金证券	291	3,692.79	0.00
159	601138	工业富联	294	3,648.54	0.00
160	601788	光大证券	200	3,578.00	0.00
161	601238	广汽集团	270	3,496.50	0.00
162	601231	环旭电子	200	3,362.00	0.00
163	600837	海通证券	289	3,323.50	0.00
164	603019	中科曙光	120	3,313.20	0.00
165	600926	杭州银行	222	3,274.50	0.00
166	600703	三安光电	102	3,269.10	0.00
167	600406	国电南瑞	138	3,207.12	0.00
168	002463	沪电股份	200	3,094.00	0.00
169	600352	浙江龙盛	225	3,091.50	0.00
170	600111	北方稀土	148	3,063.60	0.00
171	300144	宋城演艺	180	3,024.00	0.00
172	300498	温氏股份	208	2,988.96	0.00
173	601808	中海油服	200	2,872.00	0.00
174	601009	南京银行	263	2,766.76	0.00
175	600048	保利地产	227	2,733.08	0.00
176	600958	东方证券	266	2,657.34	0.00
177	600886	国投电力	272	2,613.92	0.00
178	002736	国信证券	242	2,601.50	0.00
179	601377	兴业证券	268	2,588.88	0.00
180	601881	中国银河	233	2,511.74	0.00
181	601899	紫金矿业	253	2,451.57	0.00
182	600522	中天科技	240	2,400.00	0.00
183	000703	恒逸石化	200	2,390.00	0.00
184	600362	江西铜业	104	2,327.52	0.00
185	600000	浦发银行	232	2,320.00	0.00
186	000157	中联重科	251	2,319.24	0.00
187	600655	豫园股份	200	2,318.00	0.00
188	001979	招商蛇口	200	2,190.00	0.00
189	601229	上海银行	261	2,140.20	0.00

190	000069	华侨城 A	285	2,120.40	0.00
191	601555	东吴证券	247	2,059.98	0.00
192	601901	方正证券	220	2,059.20	0.00
193	000728	国元证券	242	1,928.74	0.00
194	601186	中国铁建	251	1,864.93	0.00
195	600383	金地集团	178	1,822.72	0.00
196	002456	欧菲光	197	1,749.36	0.00
197	600482	中国动力	100	1,742.00	0.00
198	000783	长江证券	236	1,727.52	0.00
199	002602	世纪华通	269	1,726.98	0.00
200	600015	华夏银行	278	1,720.82	0.00
201	600183	生益科技	70	1,638.70	0.00
202	002202	金风科技	129	1,568.64	0.00
203	601111	中国国航	200	1,556.00	0.00
204	601766	中国中车	247	1,501.76	0.00
205	000876	新 希 望	100	1,467.00	0.00
206	601390	中国中铁	274	1,435.76	0.00
207	600606	绿地控股	259	1,411.55	0.00
208	601857	中国石油	266	1,407.14	0.00
209	601939	建设银行	209	1,389.85	0.00
210	601800	中国交建	211	1,367.28	0.00
211	002558	巨人网络	100	1,330.00	0.00
212	600016	民生银行	285	1,256.85	0.00
213	600489	中金黄金	145	1,249.90	0.00
214	601360	三六零	100	1,221.00	0.00
215	600299	安迪苏	100	1,196.00	0.00
216	600018	上港集团	246	1,173.42	0.00
217	000656	金科股份	200	1,158.00	0.00
218	600028	中国石化	263	1,146.68	0.00
219	601872	招商轮船	240	1,108.80	0.00
220	002044	美年健康	120	1,093.20	0.00
221	603993	洛阳钼业	207	1,068.12	0.00
222	601169	北京银行	219	1,066.53	0.00
223	601998	中信银行	205	1,045.50	0.00
224	000166	申万宏源	218	1,020.24	0.00
225	600233	圆通速递	100	1,001.00	0.00
226	601668	中国建筑	210	976.50	0.00
227	600176	中国巨石	61	946.11	0.00
228	600029	南方航空	148	890.96	0.00

229	601727	上海电气	209	886.16	0.00
230	601818	光大银行	227	858.06	0.00
231	002673	西部证券	103	849.75	0.00
232	601989	中国重工	183	753.96	0.00
233	600276	恒瑞医药	11	747.67	0.00
234	601600	中国铝业	140	742.00	0.00
235	300628	亿联网络	8	670.40	0.00
236	002024	苏宁易购	117	654.03	0.00
237	601669	中国电建	162	626.94	0.00
238	600705	中航资本	154	595.98	0.00
239	601216	君正集团	106	539.54	0.00
240	600115	中国东航	101	513.08	0.00
241	601988	中国银行	158	486.64	0.00
242	601933	永辉超市	100	473.00	0.00
243	600011	华能国际	100	422.00	0.00
244	601319	中国人保	61	361.73	0.00
245	600010	宝钢股份	173	268.15	0.00

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	603260	合盛硅业	271,040	20,845,686.40	1.64
2	603486	科沃斯	80,700	18,406,056.00	1.45
3	300782	卓胜微	18,929	10,174,337.50	0.80
4	300750	宁德时代	19,000	10,161,200.00	0.80
5	300760	迈瑞医疗	19,078	9,158,393.90	0.72
6	600779	水井坊	72,450	9,154,057.50	0.72
7	601636	旗滨集团	485,126	9,003,938.56	0.71
8	000799	酒鬼酒	34,403	8,793,406.80	0.69
9	000933	神火股份	773,700	7,311,465.00	0.57
10	002648	卫星石化	185,180	7,257,204.20	0.57
11	300316	晶盛机电	138,800	7,009,400.00	0.55
12	600885	宏发股份	111,000	6,959,700.00	0.55
13	600563	法拉电子	43,500	6,888,660.00	0.54
14	600739	辽宁成大	327,800	6,821,518.00	0.54
15	600038	中直股份	120,806	6,371,308.44	0.50
16	000807	云铝股份	534,000	6,354,600.00	0.50

17	688099	晶晨股份	55,269	6,201,181.80	0.49
18	002064	华峰化学	436,100	6,192,620.00	0.49
19	601928	凤凰传媒	734,300	5,242,902.00	0.41
20	002920	德赛西威	44,500	4,898,560.00	0.38
21	603225	新凤鸣	235,820	4,787,146.00	0.38
22	688188	柏楚电子	9,174	3,999,864.00	0.31
23	603355	莱克电气	59,900	3,727,577.00	0.29
24	603678	火炬电子	45,700	3,084,750.00	0.24
25	603444	吉比特	3,900	2,067,000.00	0.16
26	002709	天赐材料	8,800	937,904.00	0.07
27	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.01
28	600039	四川路桥	21,300	133,551.00	0.01
29	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
30	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.01
31	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
32	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
33	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
34	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01
35	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
36	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
37	300454	深信服	200	51,896.00	0.00
38	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
39	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
40	300759	康龙化成	200	43,398.00	0.00
41	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
42	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
43	603267	鸿远电子	200	25,584.00	0.00
44	688208	道通科技	290	25,227.10	0.00
45	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
46	600486	扬农化工	212	23,695.24	0.00
47	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
48	688202	美迪西	43	22,355.70	0.00
49	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
50	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
51	300482	万孚生物	260	16,819.40	0.00
52	002466	天齐锂业	246	15,256.92	0.00
53	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
54	002511	中顺洁柔	500	13,775.00	0.00
55	300770	新媒股份	280	13,636.00	0.00

56	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
57	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
58	002925	盈趣科技	340	13,229.40	0.00
59	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
60	603877	太平鸟	230	12,277.40	0.00
61	603638	艾迪精密	280	12,003.60	0.00
62	002353	杰瑞股份	265	11,845.50	0.00
63	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
64	300308	中际旭创	297	11,440.44	0.00
65	600754	锦江酒店	200	11,390.00	0.00
66	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
67	600298	安琪酵母	200	10,876.00	0.00
68	000513	丽珠集团	212	10,604.24	0.00
69	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
70	603456	九洲药业	200	9,716.00	0.00
71	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
72	603866	桃李面包	280	8,736.00	0.00
73	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
74	002557	洽洽食品	200	8,620.00	0.00
75	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
76	603156	养元饮品	297	8,488.26	0.00
77	300463	迈克生物	200	8,418.00	0.00
78	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
79	002439	启明星辰	284	8,238.84	0.00
80	603858	步长制药	365	8,208.85	0.00
81	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
82	603568	伟明环保	351	8,013.33	0.00
83	002727	一心堂	240	7,946.40	0.00
84	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
85	002138	顺络电子	200	7,754.00	0.00
86	300775	三角防务	200	7,640.00	0.00
87	002223	鱼跃医疗	200	7,626.00	0.00
88	300705	九典制药	200	7,610.00	0.00
89	000028	国药一致	200	7,568.00	0.00
90	601689	拓普集团	200	7,486.00	0.00
91	603043	广州酒家	280	7,201.60	0.00
92	300571	平治信息	200	7,060.00	0.00
93	603218	日月股份	260	7,040.80	0.00
94	603989	艾华集团	212	6,909.08	0.00

95	301004	C 嘉益	312	6,845.28	0.00
96	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
97	300207	欣旺达	200	6,512.00	0.00
98	002242	九阳股份	200	6,498.00	0.00
99	600729	重庆百货	236	6,478.20	0.00
100	000739	普洛药业	220	6,468.00	0.00
101	002294	信立泰	196	6,448.40	0.00
102	000951	中国重汽	236	6,386.16	0.00
103	600862	中航高科	200	6,156.00	0.00
104	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
105	603579	荣泰健康	144	5,915.52	0.00
106	002706	良信股份	260	5,860.40	0.00
107	002603	以岭药业	200	5,832.00	0.00
108	002705	新宝股份	211	5,538.75	0.00
109	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
110	600612	老凤祥	101	5,349.97	0.00
111	603228	景旺电子	200	5,240.00	0.00
112	002080	中材科技	200	5,234.00	0.00
113	002258	利尔化学	200	5,160.00	0.00
114	603515	欧普照明	200	5,134.00	0.00
115	600566	济川药业	283	5,065.70	0.00
116	002281	光迅科技	200	4,920.00	0.00
117	601677	明泰铝业	249	4,867.95	0.00
118	002572	索菲亚	200	4,840.00	0.00
119	000423	东阿阿胶	134	4,811.94	0.00
120	002402	和而泰	200	4,794.00	0.00
121	002299	圣农发展	200	4,776.00	0.00
122	601233	桐昆股份	195	4,697.55	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
124	000034	神州数码	208	4,544.80	0.00
125	600803	新奥股份	275	4,540.25	0.00
126	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
127	300476	胜宏科技	203	4,435.55	0.00
128	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
129	600323	瀚蓝环境	200	4,358.00	0.00
130	603708	家家悦	249	4,325.13	0.00
131	000581	威孚高科	200	4,166.00	0.00
132	300188	美亚柏科	239	4,158.60	0.00
133	600372	中航电子	251	4,154.05	0.00

134	002372	伟星新材	200	4,134.00	0.00
135	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
136	600498	烽火通信	210	3,912.30	0.00
137	000547	航天发展	200	3,774.00	0.00
138	002595	豪迈科技	139	3,711.30	0.00
139	600674	川投能源	298	3,674.34	0.00
140	300294	博雅生物	100	3,615.00	0.00
141	002139	拓邦股份	200	3,598.00	0.00
142	000672	上峰水泥	200	3,496.00	0.00
143	600188	兖州煤业	227	3,486.72	0.00
144	601965	中国汽研	200	3,456.00	0.00
145	300418	昆仑万维	200	3,276.00	0.00
146	600998	九州通	213	3,273.81	0.00
147	600801	华新水泥	186	3,268.02	0.00
148	601615	明阳智能	200	3,238.00	0.00
149	300212	易华录	120	3,229.20	0.00
150	000902	新洋丰	200	3,126.00	0.00
151	600663	陆家嘴	228	3,036.96	0.00
152	600597	光明乳业	200	2,882.00	0.00
153	300383	光环新网	200	2,878.00	0.00
154	000921	海信家电	200	2,874.00	0.00
155	000050	深天马 A	200	2,836.00	0.00
156	600338	西藏珠峰	200	2,834.00	0.00
157	000997	新大陆	170	2,820.30	0.00
158	002368	太极股份	140	2,808.40	0.00
159	600380	健康元	200	2,746.00	0.00
160	600483	福能股份	261	2,737.89	0.00
161	600487	亨通光电	240	2,736.00	0.00
162	002293	罗莱生活	200	2,678.00	0.00
163	002078	太阳纸业	200	2,670.00	0.00
164	000975	银泰黄金	280	2,662.80	0.00
165	600933	爱柯迪	200	2,608.00	0.00
166	600535	天士力	175	2,591.75	0.00
167	000987	越秀金控	200	2,532.00	0.00
168	000401	冀东水泥	200	2,470.00	0.00
169	603556	海兴电力	210	2,461.20	0.00
170	600985	淮北矿业	200	2,442.00	0.00
171	600056	中国医药	200	2,430.00	0.00
172	002318	久立特材	200	2,404.00	0.00

173	000789	万年青	210	2,402.40	0.00
174	600195	中牧股份	200	2,392.00	0.00
175	600977	中国电影	190	2,380.70	0.00
176	603368	柳药股份	120	2,368.80	0.00
177	600153	建发股份	292	2,365.20	0.00
178	600089	特变电工	184	2,364.40	0.00
179	002734	利民股份	200	2,356.00	0.00
180	603609	禾丰股份	221	2,302.82	0.00
181	601137	博威合金	200	2,294.00	0.00
182	600449	宁夏建材	200	2,272.00	0.00
183	000501	鄂武商 A	190	2,223.00	0.00
184	601117	中国化学	252	2,207.52	0.00
185	002065	东华软件	270	2,141.10	0.00
186	600720	祁连山	200	2,108.00	0.00
187	600398	海澜之家	288	2,085.12	0.00
188	002128	露天煤业	200	2,082.00	0.00
189	601952	苏垦农发	200	2,076.00	0.00
190	002233	塔牌集团	200	2,056.00	0.00
191	600271	航天信息	156	2,032.68	0.00
192	600637	东方明珠	245	2,006.55	0.00
193	000402	金 融 街	293	1,977.75	0.00
194	600507	方大特钢	289	1,959.42	0.00
195	300271	华宇软件	100	1,925.00	0.00
196	000885	城发环境	200	1,912.00	0.00
197	300024	机器人	176	1,877.92	0.00
198	601058	赛轮轮胎	181	1,808.19	0.00
199	002100	天康生物	200	1,782.00	0.00
200	600066	宇通客车	142	1,773.58	0.00
201	601098	中南传媒	200	1,764.00	0.00
202	601997	贵阳银行	246	1,761.36	0.00
203	000810	创维数字	200	1,702.00	0.00
204	600598	北大荒	113	1,690.48	0.00
205	002146	荣盛发展	298	1,680.72	0.00
206	600068	葛洲坝	224	1,677.76	0.00
207	002737	葵花药业	100	1,632.00	0.00
208	600177	雅戈尔	240	1,581.60	0.00
209	603328	依顿电子	200	1,490.00	0.00
210	000553	安道麦 A	158	1,464.66	0.00
211	002468	申通快递	189	1,440.18	0.00

212	600395	盘江股份	200	1,420.00	0.00
213	601717	郑煤机	122	1,418.86	0.00
214	600350	山东高速	229	1,408.35	0.00
215	002641	永高股份	200	1,380.00	0.00
216	002110	三钢闽光	203	1,368.22	0.00
217	600266	城建发展	288	1,365.12	0.00
218	000059	华锦股份	164	1,338.24	0.00
219	600510	黑牡丹	200	1,334.00	0.00
220	000932	华菱钢铁	200	1,320.00	0.00
221	601139	深圳燃气	200	1,312.00	0.00
222	600901	江苏租赁	245	1,274.00	0.00
223	002698	博实股份	100	1,273.00	0.00
224	000828	东莞控股	106	1,262.46	0.00
225	600373	中文传媒	128	1,262.08	0.00
226	300251	光线传媒	116	1,253.96	0.00
227	600057	厦门象屿	200	1,250.00	0.00
228	002815	崇达技术	100	1,248.00	0.00
229	601298	青岛港	200	1,236.00	0.00
230	002429	兆驰股份	200	1,214.00	0.00
231	600548	深高速	139	1,212.08	0.00
232	600100	同方股份	198	1,209.78	0.00
233	001965	招商公路	164	1,184.08	0.00
234	601003	柳钢股份	200	1,180.00	0.00
235	300017	网宿科技	194	1,134.90	0.00
236	300070	碧水源	155	1,133.05	0.00
237	000060	中金岭南	250	1,130.00	0.00
238	601198	东兴证券	100	1,093.00	0.00
239	600970	中材国际	115	1,054.55	0.00
240	000598	兴蓉环境	200	1,042.00	0.00
241	600170	上海建工	377	1,040.52	0.00
242	600704	物产中大	132	1,038.84	0.00
243	601958	金钼股份	143	926.64	0.00
244	002081	金螳螂	115	910.80	0.00
245	601577	长沙银行	100	894.00	0.00
246	600167	联美控股	100	893.00	0.00
247	600466	蓝光发展	299	882.05	0.00
248	600023	浙能电力	239	877.13	0.00
249	002244	滨江集团	200	838.00	0.00
250	601018	宁波港	193	762.35	0.00

251	600415	小商品城	148	762.20	0.00
252	600185	格力地产	100	737.00	0.00
253	600567	山鹰国际	212	731.40	0.00
254	600546	山煤国际	100	718.00	0.00
255	600390	五矿资本	120	717.60	0.00
256	601898	中煤能源	100	715.00	0.00
257	601666	平煤股份	100	711.00	0.00
258	603660	苏州科达	102	709.92	0.00
259	600027	华电国际	200	688.00	0.00
260	600782	新钢股份	116	647.28	0.00
261	002531	天顺风能	74	640.10	0.00
262	600026	中远海能	100	616.00	0.00
263	000961	中南建设	100	592.00	0.00
264	600987	航民股份	111	582.75	0.00
265	000898	鞍钢股份	130	578.50	0.00
266	600369	西南证券	118	574.66	0.00
267	600339	中油工程	200	568.00	0.00
268	600208	新湖中宝	186	565.44	0.00
269	600578	京能电力	189	563.22	0.00
270	600461	洪城环境	74	537.24	0.00
271	600583	海油工程	119	535.50	0.00
272	600033	福建高速	200	526.00	0.00
273	000671	阳光城	100	520.00	0.00
274	002697	红旗连锁	100	514.00	0.00
275	002540	亚太科技	100	487.00	0.00
276	600219	南山铝业	130	468.00	0.00
277	600477	杭萧钢构	128	456.96	0.00
278	000413	东旭光电	198	411.84	0.00
279	600282	南钢股份	111	395.16	0.00
280	000630	铜陵有色	144	391.68	0.00
281	600688	上海石化	100	376.00	0.00
282	000627	天茂集团	100	362.00	0.00
283	600761	安徽合力	30	331.80	0.00
284	601228	广州港	100	318.00	0.00
285	600297	广汇汽车	110	316.80	0.00
286	000709	河钢股份	113	277.98	0.00
287	601992	金隅集团	100	269.00	0.00
288	601212	白银有色	100	261.00	0.00
289	600968	海油发展	100	259.00	0.00

290	000415	渤海租赁	100	242.00	0.00
291	000429	粤高速 A	21	150.57	0.00
292	600377	宁沪高速	11	107.36	0.00
293	300244	迪安诊断	1	38.30	0.00

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	000858	五 粮 液	51,656,116.53	6.11
2	000333	美的集团	50,129,874.22	5.93
3	601318	中国平安	46,736,125.87	5.53
4	600519	贵州茅台	45,661,604.75	5.40
5	601888	中国中免	34,191,407.25	4.04
6	002415	海康威视	32,850,949.97	3.89
7	000725	京东方 A	31,443,135.00	3.72
8	601601	中国太保	31,174,274.00	3.69
9	600036	招商银行	28,292,559.14	3.35
10	000100	TCL 科技	27,304,105.93	3.23
11	600809	山西汾酒	26,946,784.00	3.19
12	002179	中航光电	25,222,954.62	2.98
13	002714	牧原股份	24,184,860.40	2.86
14	600919	江苏银行	24,143,049.26	2.86
15	000661	长春高新	22,765,502.04	2.69
16	300529	健帆生物	22,203,044.20	2.63
17	300750	宁德时代	21,753,041.00	2.57
18	600763	通策医疗	21,516,884.60	2.54
19	601225	陕西煤业	21,457,632.64	2.54
20	601100	恒立液压	21,207,071.48	2.51
21	600426	华鲁恒升	20,861,995.50	2.47
22	601838	成都银行	20,805,773.00	2.46
23	603260	合盛硅业	20,662,493.00	2.44
24	000776	广发证券	20,589,074.70	2.43
25	000002	万 科 A	20,279,544.00	2.40

26	601636	旗滨集团	20,159,599.13	2.38
27	601658	邮储银行	20,044,902.23	2.37
28	600741	华域汽车	19,879,665.00	2.35
29	600030	中信证券	19,481,884.00	2.30
30	300124	汇川技术	19,376,664.22	2.29
31	603501	韦尔股份	19,300,876.00	2.28
32	603486	科沃斯	19,136,366.00	2.26
33	600779	水井坊	18,263,739.20	2.16
34	000001	平安银行	18,160,820.00	2.15
35	603659	璞泰来	17,782,696.70	2.10
36	600176	中国巨石	17,612,563.12	2.08
37	603392	万泰生物	17,512,179.14	2.07
38	000807	云铝股份	17,356,321.70	2.05
39	300782	卓胜微	17,145,111.67	2.03

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	000333	美的集团	62,309,812.75	7.37
2	600519	贵州茅台	40,634,098.00	4.81
3	600030	中信证券	27,485,994.00	3.25
4	000002	万科A	26,946,876.48	3.19
5	601166	兴业银行	26,880,967.95	3.18
6	600887	伊利股份	25,662,100.44	3.03
7	000001	平安银行	22,853,438.78	2.70
8	601012	隆基股份	22,210,409.00	2.63
9	600031	三一重工	22,132,172.00	2.62
10	601899	紫金矿业	21,887,855.58	2.59
11	002415	海康威视	19,155,174.95	2.27
12	601100	恒立液压	19,119,928.00	2.26
13	601318	中国平安	18,873,001.00	2.23
14	600309	万华化学	18,809,147.00	2.22
15	601919	中远海控	18,569,817.00	2.20
16	000858	五粮液	18,094,966.95	2.14
17	300760	迈瑞医疗	17,835,675.72	2.11

18	000776	广发证券	16,516,391.00	1.95
19	600176	中国巨石	16,364,378.25	1.94
20	600900	长江电力	16,352,832.75	1.93

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	2,094,367,459.72
卖出股票收入（成交）总额	1,729,661,014.70

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

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	28,924,262.40	2.27
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）	328,000.00	0.03
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	29,252,262.40	2.30

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

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	019645	20 国债 15	288,320	28,924,262.40	2.27
2	123117	健帆转债	2,850	285,000.00	0.02
3	127038	国微转债	420	42,000.00	0.00
4	113050	南银转债	10	1,000.00	0.00

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宁波银行和招商银行发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据宁波银保监局公布的行政处罚信息公开表：

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位案由，于 2020 年 10 月 16 日被宁波银保监局处以罚款。

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因代理销售保险不规范案由，于 2021 年 6 月 10 日被宁波银保监局处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

招商银行股份有限公司（简称招商银行）因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等相关违法违规行为，于 2021 年 5 月 17 日被中国银保监会处以罚款。

本基金管理小组分析认为，相关违规事项已经调查完毕，行政处罚决定也已经开出。考虑到此次处罚金额相对上一年的经营利润占比较小，对于公司的未来财务并无重大影响。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对宁波银行和招商银行进行了投资。

7.12.2 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。

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	153,525.65
2	应收证券清算款	175,268.21
3	应收股利	—
4	应收利息	518,046.70
5	应收申购款	852,840.07
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,699,680.63

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

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。

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 泰 沪 深 300 指 数 A	23,773	12,837.13	79,654,756.60	26.10%	225,522,278.24	73.90%
长 城 久 泰 沪 深 300 指 数 C	4,254	52,900.88	221,109,888.00	98.25%	3,930,444.84	1.75%
合计	28,027	18,918.09	300,764,644.60	56.72%	229,452,723.08	43.28%

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）。

8.2 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 沪深 300 指数 A	32,528.71	0.0107%
	长城久泰 沪深 300 指数 C	981.88	0.0004%
	合计	33,510.59	0.0063%

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）。

8.3 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	长城久泰沪深 300 指 数 A	0

有本开放式基金	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 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	309, 970, 245. 09	32, 369, 593. 26
本报告期基金总申购份额	52, 978, 301. 41	230, 437, 170. 35
减：本报告期基金总赎回份额	57, 771, 511. 66	37, 766, 430. 77
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	305, 177, 034. 84	225, 040, 332. 84

§ 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

自 2021 年 4 月 13 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
长城证券	2	3,819,483,760.46	100.00%	883,756.92	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交易单元的变更情况：

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 7 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，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
长城证券	32,494,295.53	100.00%	17,000,000.00	100.00%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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参加宁波银行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	2021 年 1 月 27 日
2	关于终止包商银行股份有限公司	本基金管理人网站	2021 年 2 月 8 日

	公司办理本公司旗下基金销售业务的公告		
3	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(盛达资源)	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	2021 年 2 月 23 日
4	关于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	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	2021 年 4 月 27 日
6	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金收益分配公告	中国证券报及本基金管理人网站	2021 年 6 月 18 日
7	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定投业务的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2021 年 6 月 18 日
8	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定投业务的公告	中国证券报及本基金管理人网站	2021 年 6 月 19 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	20210527-20210603	-	91,074,681.24	-	91,074,681.24	17.1769%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20% 的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

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) 中国证监会批准长城久泰沪深 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

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

公司网址：<http://www.ccfund.com.cn>