

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57

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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
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情况 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录 .....	64
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 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	786,307,610.87 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	310,325,269.76 份	475,982,341.11 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%×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	张姗
	联系电话	0755-29279005	0755-83077987
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-8868-666	95555
传真	0755-29279000	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518046	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	基金管理人及基金托管人住所

## 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	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
本期已实现收益	-14,056,748.28	-12,973,855.60
本期利润	-30,880,417.69	-25,982,879.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0992	-0.0520
本期加权平均净值利润率	-5.15%	-4.96%
本期基金份额净值增长率	-5.19%	-5.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	139,466,005.31	-2,268,430.52

润		
期末可供分配基金份额利润	0.4494	-0.0048
期末基金资产净值	568,105,557.56	473,713,910.59
期末基金份额净值	1.8307	0.9952
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	373.63%	27.71%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	1.87%	0.93%	1.10%	0.83%	0.77%	0.10%
过去三个月	-5.37%	0.83%	-4.88%	0.79%	-0.49%	0.04%
过去六个月	-5.19%	0.77%	-0.69%	0.80%	-4.50%	-0.03%
过去一年	-19.46%	0.86%	-13.60%	0.94%	-5.86%	-0.08%
过去三年	-7.26%	1.14%	-7.06%	1.14%	-0.20%	0.00%
自基金合同生效起至今	373.63%	1.53%	240.00%	1.53%	133.63%	0.00%

长城久泰沪深 300 指数 C

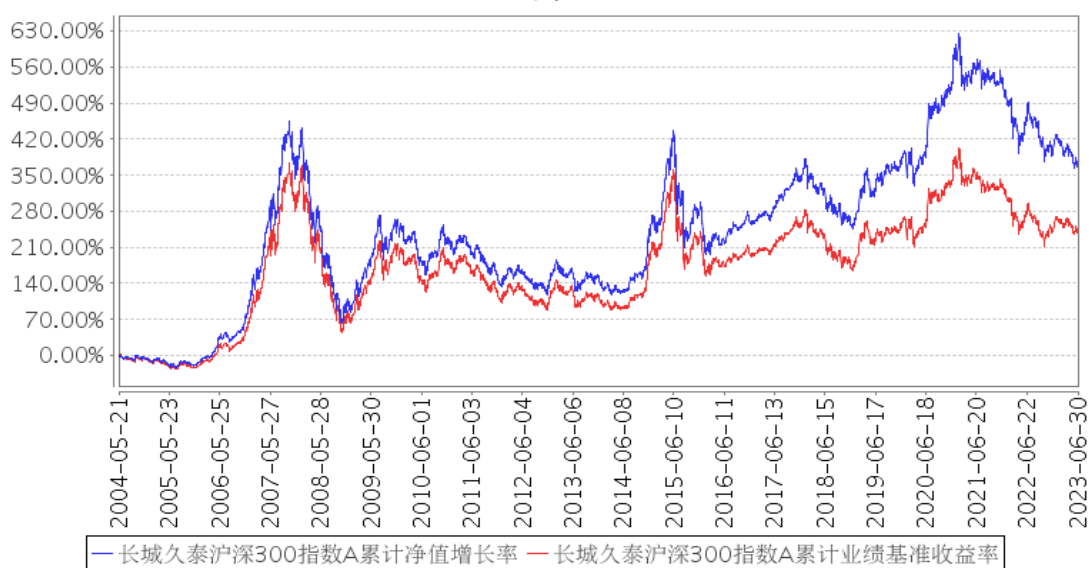
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.84%	0.93%	1.10%	0.83%	0.74%	0.10%

过去三个月	-5.44%	0.83%	-4.88%	0.79%	-0.56%	0.04%
过去六个月	-5.34%	0.77%	-0.69%	0.80%	-4.65%	-0.03%
过去一年	-19.75%	0.86%	-13.60%	0.94%	-6.15%	-0.08%
过去三年	-8.33%	1.14%	-7.06%	1.14%	-1.27%	0.00%
自基金合同生效起 至今	27.71%	1.18%	22.83%	1.19%	4.88%	-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%。

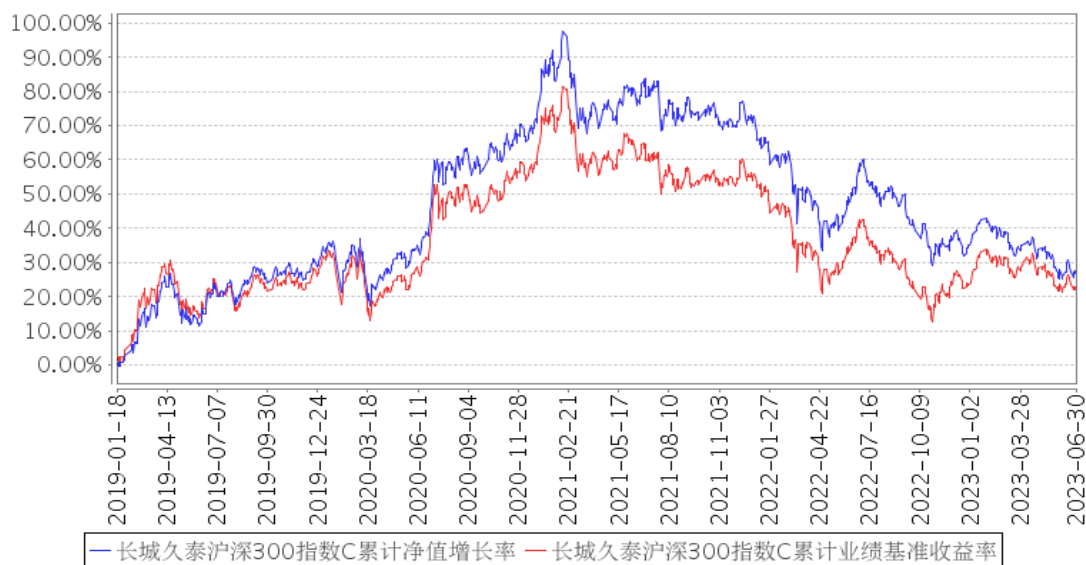
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长城久泰沪深300指数A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





长城久泰沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：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。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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、长城悦享增利债券型证券投资基金、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（FOF）、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、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、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、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证

券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）、长城创新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、投资总监、权益投资部总经理、本基金的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	23 年	男，中国籍，硕士，注册会计师（CPA）。1991 年 7 月-1996 年 8 月曾就职于大庆石油管理局，1998 年 6 月-1999 年 10 月曾就职于华为技术有限公司，1999 年 10 月-2000 年 5 月曾就职于深圳市和君创业投资公司，2000 年 5 月-2001 年 9 月曾就职于长城证券有限责任公司投资银行部。2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自 2007 年 9 月至 2009 年 1 月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2011 年 1 月至 2013 年 6 月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自 2009 年 9 月至 2016 年 9 月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”基金经理，自 2017 年 6 月至 2018 年 8 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理，自 2018 年 8 月至 2018 年 11 月任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 8 月至 2019 年 2 月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 4 月至 2022 年 10 月

					任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 4 月至今任“长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 2 月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理。
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理、兼任投资经理	2018 年 11 月 30 日	-	15 年	男，中国籍，硕士。2008 年 7 月-2017 年 11 月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、基金经理兼投资经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2019 年 1 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城基金-量化 1 号单一资产管理计划”投资经理，自 2022 年 6 月至今任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”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从业人员的相关规定。

#### 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	3,488,796,006.93	2014 年 12 月 23 日

私募资产管理计划	1	191,503,516.90	2021 年 4 月 7 日
其他组合	-	-	-
合计	8	3,680,299,523.83	-

## 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》、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相关法律法规和公司制度的规定，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，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，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

上半年市场先扬后抑，多数大型宽基指数表现不佳，中证 500、中证 1000 为代表的中小指数略有正收益。风格上看，二季度一定程度上延续了一季度的整体趋势，低波动、低估值标的有较为显著的超额收益，但主要集中于较小市值的标的，盈利能力强的个股延续弱势。市场行业主题投资波动很大，以人工智能为代表的 TMT 产业链较受市场关注，基础算力、光模块、软件传媒等相关个股波动率很高；资金面看，外资一季度后无明显增量净流入，内资存量博弈性较强，市场总体缺乏赚钱效应；消费板块受经济复苏动能较弱影响，普遍表现不佳。

报告期内，本基金在风格控制相对较为严格。行业上，消费、新能源板块等盈利能力较好的标的持续承压，通信板块的标的个股配置与市场炒作热点有一定偏差；总体看，上半年的 A 股以存量博弈为主，缺乏持续的增量资金，在少部分缺乏基本面支撑的个股上资金比较聚集，使得增

强指数的超额收益因子较往年变化巨大，估值的波动远远大于业绩波动，虽然个股权重约束较为严格，但区间内相关个股相对劣势明显，因此区间内跑输业绩基准。

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 的基金份额净值为 1.8307 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%；截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 0.9952 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.34%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股总体估值仍然处在过去十年中枢以下位置，下行风险预计较小，从大类资产比较的角度，权益市场已经进入价值区间；宏观上看，经济复苏偏弱带来的问题已经充分反映在股价上，进一步的利空事件较为有限，当前的政策环境积极正面，随着下半年一系列企业、民生政策落地，经济有望进一步好转。

市场总体预计仍然以中小市值股票的广度行情为主，深度学习与人工智能等新的算法对于中小市值选股因子仍有较大的潜力空间，有利于在均衡行业配置的基础上在抓住阶段性的价差投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，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。

#### 4.8 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	51,099,556.43	37,471,555.02
结算备付金		3,314,379.47	1,260,474.10
存出保证金		177,353.59	263,283.69
交易性金融资产	6.4.7.2	985,522,419.44	1,126,140,781.87
其中: 股票投资		982,084,003.05	1,101,565,423.85
基金投资		-	-
债券投资		3,438,416.39	24,575,358.02
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,974,754.72	124,371.41
应收股利		-	-
应收申购款		179,618.60	199,492.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,047,268,082.25	1,165,459,958.43
<b>负债和净资产</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>附注号</b>	<b>2023 年 6 月 30 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,285,802.14	-
应付赎回款		325,211.99	483,004.27
应付管理人报酬		836,446.50	987,377.17
应付托管费		170,703.36	201,505.55
应付销售服务费		116,462.77	147,470.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-



其他负债	6.4.7.9	713,987.34	640,929.98
负债合计		5,448,614.10	2,460,287.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	786,307,610.87	843,056,718.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	255,511,857.28	319,942,952.06
净资产合计		1,041,819,468.15	1,162,999,670.87
负债和净资产总计		1,047,268,082.25	1,165,459,958.43

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 786,307,610.87 份，其中长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额总额 310,325,269.76 份，基金份额净值 1.8307 元；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额总额 475,982,341.11 份，基金份额净值 0.9952 元。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-49,400,665.96	-143,794,299.24
1. 利息收入		113,829.70	136,182.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	113,829.70	136,182.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,714,929.67	-186,862,561.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-33,528,981.84	-198,676,058.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	189,420.03	842,623.84
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	13,624,632.14	10,970,873.42
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-29,832,693.25	42,904,905.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	33,127.26	27,174.35
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,462,631.17</b>	<b>7,596,180.55</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,472,290.70	5,588,579.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,116,794.05	1,140,526.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	781,608.90	774,829.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.41	0.81
8. 其他费用	6.4.7.23	91,937.11	92,244.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-56,863,297.13</b>	<b>-151,390,479.79</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-56,863,297.13</b>	<b>-151,390,479.79</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-56,863,297.13</b>	<b>-151,390,479.79</b>

### 6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	843,056,718.81	-	319,942,952.06	1,162,999,670.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	843,056,718.81	-	319,942,952.06	1,162,999,670.87
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-56,749,107.94	-	-64,431,094.78	-121,180,202.72
(一)、 综合收 益总额	-	-	-56,863,297.13	-56,863,297.13
(二)、 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)	-56,749,107.94	-	-7,567,797.65	-64,316,905.59
其中:1. 基金申 购款	19,614,507.15	-	8,757,386.54	28,371,893.69
2 .基金 赎回 款	-76,363,615.09	-	-16,325,184.19	-92,688,799.28
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	786,307,610.87	-	255,511,857.28	1,041,819,468.15
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	709,464,394.68	-	687,713,353.87	1,397,177,748.55
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净 资产(基 金净值)	709,464,394.68	-	687,713,353.87	1,397,177,748.55
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-256,064,039.60	-	-233,276,937.36	-489,340,976.96
(一)、 综合收 益总额	-	-	-151,390,479.79	-151,390,479.79
(二)、 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)	-256,064,039.60	-	-56,864,456.02	-312,928,495.62

其中:1. 基金申购款	155,950,445.62	-	81,153,723.32	237,104,168.94
2. 基金赎回款	-412,014,485.22	-	-138,018,179.34	-550,032,664.56
(三)、 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)	-	-	-25,022,001.55	-25,022,001.55
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产(基金 净值)	453,400,355.08	-	454,436,416.51	907,836,771.59

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”）。

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。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。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

##### 6.4.6.2 增值税

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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

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。



#### 6.4.6.5 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

#### 6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	51,099,556.43
等于：本金	51,093,951.58
加：应计利息	5,604.85
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	51,099,556.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,051,199,418.27	-	982,084,003.05	-69,115,415.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,393,114.00	37,856.39	3,438,416.39	7,446.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,393,114.00	37,856.39	3,438,416.39	7,446.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,054,592,532.27	37,856.39	985,522,419.44	-69,107,969.22	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 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：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	965.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	623,762.16
其中：交易所市场	623,762.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	713,987.34

## 6.4.7.10 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	314,502,553.20	314,502,553.20
本期申购	8,830,497.09	8,830,497.09
本期赎回（以“-”号填列）	-13,007,780.53	-13,007,780.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	310,325,269.76	310,325,269.76

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	528,554,165.61	528,554,165.61
本期申购	10,784,010.06	10,784,010.06
本期赎回（以“-”号填列）	-63,355,834.56	-63,355,834.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	475,982,341.11	475,982,341.11

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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 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	155,556,972.57	137,246,751.78	292,803,724.35
本期利润	-14,056,748.28	-16,823,669.41	-30,880,417.69
本期基金份额交易产生的变动数	-2,034,218.98	-2,108,799.88	-4,143,018.86
其中：基金申购款	4,173,369.64	4,012,215.16	8,185,584.80
基金赎回款	-6,207,588.62	-6,121,015.04	-12,328,603.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	139,466,005.31	118,314,282.49	257,780,287.80

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	83,818,664.74	-56,679,437.03	27,139,227.71
本期利润	-12,973,855.60	-13,009,023.84	-25,982,879.44
本期基金份额交易产生的变动数	-7,811,956.81	4,387,178.02	-3,424,778.79
其中：基金申购款	1,576,466.52	-1,004,664.78	571,801.74
基金赎回款	-9,388,423.33	5,391,842.80	-3,996,580.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,032,852.33	-65,301,282.85	-2,268,430.52

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	85,720.86
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	26,228.80
其他	1,880.04
合计	113,829.70

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-33,528,981.84
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-33,528,981.84

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	2,594,169,754.14
减：卖出股票成本总额	2,623,513,798.01
减：交易费用	4,184,937.97
买卖股票差价收入	-33,528,981.84

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	117,482.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	71,937.41
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	189,420.03

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,207,339.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,652,979.00
减：应计利息总额	482,402.14
减：交易费用	21.01
买卖债券差价收入	71,937.41

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	13,624,632.14
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	13,624,632.14

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-29,832,693.25
股票投资	-29,864,358.25
债券投资	31,665.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-29,832,693.25

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33,127.26
合计	33,127.26

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,676.96
合计	91,937.11

#### 6.4.7.24 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，本基金无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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司(“长城基金”)	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(“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”)	基金管理人的股东、基金销售机构、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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	5,123,895,367.16	100.00	4,374,884,683.44	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	3,918,173.56	100.00	20,033,094.40	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 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 2023年1月1日至2023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 (%)
长城证券	1,185,182.46	100.00	623,762.16	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)
长城证券	1,011,901.86	100.00	645,263.50	100.00

注：(1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,472,290.70	5,588,579.60
其中：支付销售机构的客户维护费	981,947.56	806,714.77

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,116,794.05	1,140,526.46

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
长城基金管理有限公司	-	506,238.67	506,238.67
招商银行	-	442.59	442.59
合计	-	506,681.26	506,681.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
长城基金管理有限公司	-	751,362.70	751,362.70
招商银行	-	585.64	585.64
合计	-	751,948.34	751,948.34

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：无。

#### 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：无。

**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：无。

**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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	51,099,556.43	85,720.86	34,481,188.28	107,215.77

注：本基金的活期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：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金于本期末未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况, 请参阅本财务报表

**6.4.8.2 资产负债表日后事项。**

**6.4.12 期末（2023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	受限期	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
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

301202	C 朗威	2023 年 6 月 28 日	1-6 个 月 (含)	新股未 上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301292	C 海科	2023 年 6 月 29 日	1-6 个 月 (含)	新股未 上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301307	美利 信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁 定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士 顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301358	湖南 裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股锁 定	23.77	42.89	1,809	42,999.93	77,588.01	-
601133	柏诚 股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
688146	中船 特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688429	时创 能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙 高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔 金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	37.88	29.49	2,071	78,449.48	61,073.79	-
688472	阿特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定	11.10	17.04	4,939	54,822.90	84,160.56	-
688479	友车 科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688570	天玛 智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688623	双元 科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688631	莱斯 信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

		日								
--	--	---	--	--	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 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 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 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：无。

#### 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证券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的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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、债券投资及买入返售金融资产等。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	51,099,556.43	-	-	-	-	-	51,099,556.43
结算备付金	3,314,379.47	-	-	-	-	-	3,314,379.47
存出保证金	177,353.59	-	-	-	-	-	177,353.59
交易性金融 资产	-	-	3,438,416.39	-	-	982,084,003.05	985,522,419.44
应收申购款	-	-	-	-	-	179,618.60	179,618.60
应收清算款	-	-	-	-	-	6,974,754.72	6,974,754.72
资产总计	54,591,289.49	-	3,438,416.39	-	-	989,238,376.37	1,047,268,082.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	325,211.99	325,211.99
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	836,446.50	836,446.50
应付托管费	-	-	-	-	-	170,703.36	170,703.36
应付清算款	-	-	-	-	-	3,285,802.14	3,285,802.14
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	116,462.77	116,462.77
其他负债	-	-	-	-	-	713,987.34	713,987.34
负债总计	-	-	-	-	-	5,448,614.10	5,448,614.10
利率敏感度 缺口	54,591,289.49	-	3,438,416.39	-	-	-	-
上年度末 2022 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	37,471,555.02	-	-	-	-	-	37,471,555.02
结算备付金	1,260,474.10	-	-	-	-	-	1,260,474.10
存出保证金	263,283.69	-	-	-	-	-	263,283.69
交易性金融 资产	8,162,476.71	-	16,412,881.31	-	-	1,101,565,423.85	1,126,140,781.87
应收申购款	-	-	-	-	-	199,492.34	199,492.34
应收清算款	-	-	-	-	-	124,371.41	124,371.41
资产总计	47,157,789.52	-	16,412,881.31	-	-	1,101,889,287.60	1,165,459,958.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	483,004.27	483,004.27
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	987,377.17	987,377.17
应付托管费	-	-	-	-	-	201,505.55	201,505.55
应付销售服	-	-	-	-	-	147,470.59	147,470.59



务费							
其他负债	-	-	-	-	-	640,929.98	640,929.98
负债总计	-	-	-	-	-	2,460,287.56	2,460,287.56
利率敏感度缺口	47,157,789.52	-16,412,881.31	-	-	-	-	-

#### 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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-2,962.97	-13,758.02
	市场利率下降 25 个基点	2,968.30	13,778.67

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	982,084,003.05	94.27	1,101,565,423.85	94.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,438,416.39	0.33	24,575,358.02	2.11
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	985,522,419.44	94.60	1,126,140,781.87	96.83

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

#### 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		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	56,499,292.70	55,012,177.27
	沪深 300 指数下降 5%	-56,499,292.70	-55,012,177.27

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	981,503,779.60	1,101,365,354.49
第二层次	3,633,847.35	24,575,358.02
第三层次	384,792.49	200,069.36
合计	985,522,419.44	1,126,140,781.87

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## § 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	982,084,003.05	93.78
	其中：股票	982,084,003.05	93.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,438,416.39	0.33
	其中：债券	3,438,416.39	0.33
	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	54,413,935.90	5.20
8	其他各项资产	7,331,726.91	0.70
9	合计	1,047,268,082.25	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,951.90	-
B	采矿业	32,505,188.75	3.12
C	制造业	511,031,145.04	49.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,144,707.00	0.49
E	建筑业	42,759,119.85	4.10
F	批发和零售业	11,102.72	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,923,348.55	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,327,719.89	1.76
J	金融业	197,192,426.46	18.93
K	房地产业	13,917,533.80	1.34
L	租赁和商务服务业	5,549,681.45	0.53
M	科学研究和技术服务业	9,302,976.97	0.89
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	13,655.70	-
R	文化、体育和娱乐业	2,394.70	-
S	综合	-	-
	合计	837,685,952.78	80.41

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	5,014,176.59	0.48
C	制造业	95,346,981.78	9.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,107,509.10	0.49
E	建筑业	719,676.64	0.07
F	批发和零售业	15,422.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,790,829.00	0.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,125,756.58	1.45
J	金融业	2,715,489.05	0.26
K	房地产业	8,102,176.68	0.78
L	租赁和商务服务业	4,440,940.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	8,036.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,072.00	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	9,984.85	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	144,398,050.27	13.86

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	25,022	42,312,202.00	4.06
2	601318	中国平安	885,493	41,086,875.20	3.94
3	000568	泸州老窖	131,807	27,622,792.99	2.65
4	000858	五粮液	164,574	26,919,369.18	2.58
5	601601	中国太保	929,834	24,157,087.32	2.32
6	600036	招商银行	668,442	21,898,159.92	2.10
7	002142	宁波银行	795,600	20,128,680.00	1.93

8	600030	中信证券	1,002,408	19,827,630.24	1.90
9	600031	三一重工	1,188,791	19,769,594.33	1.90
10	300122	智飞生物	399,831	17,672,530.20	1.70
11	002271	东方雨虹	641,550	17,488,653.00	1.68
12	002594	比亚迪	67,700	17,484,879.00	1.68
13	601600	中国铝业	3,114,840	17,100,471.60	1.64
14	300896	爱美客	38,100	16,952,595.00	1.63
15	300750	宁德时代	73,620	16,843,519.80	1.62
16	002129	TCL 中环	498,162	16,538,978.40	1.59
17	603986	兆易创新	147,000	15,618,750.00	1.50
18	000625	长安汽车	1,196,848	15,475,244.64	1.49
19	002050	三花智控	503,800	15,244,988.00	1.46
20	002049	紫光国微	158,740	14,802,505.00	1.42
21	000333	美的集团	249,021	14,672,317.32	1.41
22	600438	通威股份	425,900	14,612,629.00	1.40
23	600028	中国石化	2,287,600	14,549,136.00	1.40
24	601838	成都银行	1,190,434	14,535,199.14	1.40
25	603288	海天味业	290,640	13,616,484.00	1.31
26	300014	亿纬锂能	217,800	13,176,900.00	1.26
27	601668	中国建筑	2,282,875	13,103,702.50	1.26
28	002812	恩捷股份	129,500	12,477,325.00	1.20
29	603185	弘元绿能	162,500	12,114,375.00	1.16
30	000776	广发证券	795,912	11,707,865.52	1.12
31	300207	欣旺达	714,902	11,667,200.64	1.12
32	601800	中国交建	995,211	10,857,752.01	1.04
33	603369	今世缘	205,136	10,831,180.80	1.04
34	601012	隆基绿能	365,253	10,471,803.51	1.01
35	600188	兖矿能源	343,800	10,286,496.00	0.99
36	603833	欧派家居	106,421	10,195,131.80	0.98
37	601939	建设银行	1,616,461	10,119,045.86	0.97
38	601669	中国电建	1,755,662	10,077,499.88	0.97
39	600875	东方电气	534,600	9,970,290.00	0.96
40	601155	新城控股	688,257	9,917,783.37	0.95
41	000938	紫光股份	304,774	9,707,051.90	0.93
42	300347	泰格医药	143,818	9,282,013.72	0.89
43	002916	深南电路	112,600	8,486,662.00	0.81
44	688012	中微公司	54,003	8,448,769.35	0.81
45	600050	中国联通	1,671,300	8,022,240.00	0.77
46	300763	锦浪科技	76,300	7,942,830.00	0.76
47	601878	浙商证券	772,200	7,629,336.00	0.73
48	601899	紫金矿业	664,446	7,554,751.02	0.73
49	600406	国电南瑞	311,875	7,204,312.50	0.69
50	601117	中国化学	820,052	6,790,030.56	0.65

51	000786	北新建材	269,780	6,612,307.80	0.63
52	600015	华夏银行	1,189,979	6,437,786.39	0.62
53	601288	农业银行	1,729,931	6,106,656.43	0.59
54	601888	中国中免	50,204	5,549,048.12	0.53
55	601985	中国核电	726,800	5,123,940.00	0.49
56	688981	中芯国际	97,978	4,949,848.56	0.48
57	601688	华泰证券	354,753	4,884,948.81	0.47
58	300661	圣邦股份	58,816	4,830,558.08	0.46
59	688363	华熙生物	50,720	4,522,195.20	0.43
60	000001	平安银行	363,300	4,079,859.00	0.39
61	000002	万科 A	285,181	3,998,237.62	0.38
62	603799	华友钴业	75,260	3,455,186.60	0.33
63	300408	三环集团	106,115	3,114,475.25	0.30
64	601728	中国电信	534,900	3,011,487.00	0.29
65	600089	特变电工	124,277	2,770,134.33	0.27
66	601615	明阳智能	163,232	2,755,356.16	0.26
67	600309	万华化学	31,343	2,753,169.12	0.26
68	600919	江苏银行	308,461	2,267,188.35	0.22
69	600276	恒瑞医药	45,466	2,177,821.40	0.21
70	601390	中国中铁	254,074	1,925,880.92	0.18
71	601872	招商轮船	329,167	1,905,876.93	0.18
72	601319	中国人保	291,383	1,701,676.72	0.16
73	002304	洋河股份	12,215	1,604,440.25	0.15
74	300316	晶盛机电	18,400	1,304,560.00	0.13
75	300124	汇川技术	18,140	1,164,769.40	0.11
76	601100	恒立液压	15,332	986,307.56	0.09
77	300142	沃森生物	27,000	714,150.00	0.07
78	300059	东方财富	31,195	442,969.00	0.04
79	600893	航发动力	3,526	149,008.76	0.01
80	601336	新华保险	3,665	134,762.05	0.01
81	601225	陕西煤业	5,799	105,483.81	0.01
82	300760	迈瑞医疗	268	80,346.40	0.01
83	300751	迈为股份	346	58,605.48	0.01
84	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.00
85	600436	片仔癀	150	42,954.00	0.00
86	002371	北方华创	100	31,765.00	0.00
87	002821	凯莱英	266	31,350.76	0.00
88	002920	德赛西威	200	31,162.00	0.00
89	605117	德业股份	180	26,919.00	0.00
90	300454	深信服	200	22,650.00	0.00
91	600809	山西汾酒	120	22,208.40	0.00
92	000733	振华科技	200	19,170.00	0.00
93	688036	传音控股	129	18,963.00	0.00

94	600941	中国移动	200	18,660.00	0.00
95	002459	晶澳科技	445	18,556.50	0.00
96	600760	中航沈飞	392	17,640.00	0.00
97	300769	德方纳米	160	17,636.80	0.00
98	300033	同花顺	100	17,528.00	0.00
99	688065	凯赛生物	280	17,432.80	0.00
100	605499	东鹏饮料	100	17,290.00	0.00
101	603259	药明康德	275	17,135.25	0.00
102	601689	拓普集团	200	16,140.00	0.00
103	603486	科沃斯	200	15,554.00	0.00
104	000661	长春高新	110	14,993.00	0.00
105	300957	贝泰妮	150	13,332.00	0.00
106	601799	星宇股份	100	12,360.00	0.00
107	600845	宝信软件	238	12,092.78	0.00
108	300919	中伟股份	200	12,050.00	0.00
109	300274	阳光电源	100	11,663.00	0.00
110	603260	合盛硅业	162	11,343.24	0.00
111	000963	华东医药	256	11,102.72	0.00
112	603806	福斯特	290	10,785.10	0.00
113	603501	韦尔股份	110	10,784.40	0.00
114	600600	青岛啤酒	100	10,363.00	0.00
115	688561	奇安信	200	10,362.00	0.00
116	300979	华利集团	200	9,748.00	0.00
117	600763	通策医疗	100	9,686.00	0.00
118	688005	容百科技	175	9,453.50	0.00
119	603899	晨光股份	200	8,928.00	0.00
120	000596	古井贡酒	36	8,905.68	0.00
121	300223	北京君正	100	8,831.00	0.00
122	600570	恒生电子	192	8,503.68	0.00
123	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.00
124	002756	永兴材料	130	8,139.30	0.00
125	688396	华润微	155	8,123.55	0.00
126	600009	上海机场	174	7,903.08	0.00
127	600085	同仁堂	136	7,828.16	0.00
128	601865	福莱特	200	7,702.00	0.00
129	002648	卫星化学	499	7,465.04	0.00
130	000651	格力电器	200	7,302.00	0.00
131	002230	科大讯飞	100	6,796.00	0.00
132	002415	海康威视	204	6,754.44	0.00
133	688599	天合光能	158	6,732.38	0.00
134	002475	立讯精密	200	6,490.00	0.00
135	600332	白云山	200	6,376.00	0.00
136	600460	士兰微	200	6,054.00	0.00



137	600111	北方稀土	248	5,947.04	0.00
138	002466	天齐锂业	85	5,942.35	0.00
139	002074	国轩高科	200	5,524.00	0.00
140	000538	云南白药	100	5,248.00	0.00
141	600660	福耀玻璃	143	5,126.55	0.00
142	603019	中科曙光	100	5,090.00	0.00
143	600745	闻泰科技	100	4,890.00	0.00
144	002460	赣锋锂业	80	4,876.80	0.00
145	000977	浪潮信息	100	4,850.00	0.00
146	600900	长江电力	219	4,831.14	0.00
147	002714	牧原股份	114	4,805.10	0.00
148	600585	海螺水泥	200	4,748.00	0.00
149	601877	正泰电器	171	4,728.15	0.00
150	300628	亿联网络	134	4,699.38	0.00
151	002311	海大集团	100	4,684.00	0.00
152	600690	海尔智家	199	4,672.52	0.00
153	002352	顺丰控股	100	4,509.00	0.00
154	001289	龙源电力	200	4,500.00	0.00
155	603392	万泰生物	67	4,473.59	0.00
156	300999	金龙鱼	100	3,999.00	0.00
157	300015	爱尔眼科	214	3,969.70	0.00
158	600887	伊利股份	136	3,851.52	0.00
159	601166	兴业银行	246	3,849.90	0.00
160	000792	盐湖股份	200	3,834.00	0.00
160	600183	生益科技	270	3,834.00	0.00
161	300759	康龙化成	100	3,828.00	0.00
162	300450	先导智能	100	3,617.00	0.00
163	601995	中金公司	100	3,552.00	0.00
164	600674	川投能源	236	3,551.80	0.00
165	002601	龙佰集团	200	3,300.00	0.00
166	600150	中国船舶	100	3,291.00	0.00
167	600886	国投电力	260	3,289.00	0.00
168	600584	长电科技	104	3,241.68	0.00
169	600196	复星医药	100	3,090.00	0.00
170	002410	广联达	95	3,086.55	0.00
171	601088	中国神华	100	3,075.00	0.00
172	600741	华域汽车	146	2,695.16	0.00
173	000768	中航西飞	100	2,675.00	0.00
174	002202	金风科技	229	2,431.98	0.00
175	002938	鹏鼎控股	100	2,429.00	0.00
176	601066	中信建投	100	2,420.00	0.00
177	600588	用友网络	117	2,398.50	0.00
178	300413	芒果超媒	70	2,394.70	0.00

179	601138	工业富联	94	2,368.80	0.00
180	002007	华兰生物	100	2,241.00	0.00
181	600999	招商证券	164	2,225.48	0.00
182	600346	恒力石化	154	2,206.82	0.00
183	601006	大秦铁路	295	2,191.85	0.00
184	000301	东方盛虹	182	2,151.24	0.00
185	002236	大华股份	106	2,093.50	0.00
186	002064	华峰化学	300	2,058.00	0.00
187	002414	高德红外	260	2,020.20	0.00
188	601698	中国卫通	100	1,988.00	0.00
189	600803	新奥股份	100	1,898.00	0.00
190	688111	金山办公	4	1,888.88	0.00
191	601857	中国石油	244	1,822.68	0.00
192	601633	长城汽车	72	1,812.24	0.00
193	600547	山东黄金	76	1,784.48	0.00
194	601699	潞安环能	109	1,778.88	0.00
195	002241	歌尔股份	100	1,775.00	0.00
196	002493	荣盛石化	150	1,746.00	0.00
196	002736	国信证券	200	1,746.00	0.00
197	300433	蓝思科技	141	1,658.16	0.00
198	601788	光大证券	100	1,589.00	0.00
199	601021	春秋航空	27	1,551.69	0.00
200	600884	杉杉股份	100	1,514.00	0.00
201	002252	上海莱士	200	1,502.00	0.00
202	601211	国泰君安	107	1,496.93	0.00
203	601186	中国铁建	151	1,487.35	0.00
204	600019	宝钢股份	262	1,472.44	0.00
205	600061	国投资本	204	1,452.48	0.00
206	600926	杭州银行	122	1,433.50	0.00
207	000708	中信特钢	90	1,425.60	0.00
208	600039	四川路桥	140	1,373.40	0.00
209	601919	中远海控	140	1,316.00	0.00
210	600176	中国巨石	92	1,302.72	0.00
211	601360	三六零	100	1,254.00	0.00
212	601998	中信银行	205	1,225.90	0.00
213	002001	新和成	78	1,201.20	0.00
214	600219	南山铝业	396	1,195.92	0.00
215	000725	京东方 A	264	1,079.76	0.00
216	600905	三峡能源	200	1,074.00	0.00
217	601169	北京银行	219	1,013.97	0.00
218	600011	华能国际	100	926.00	0.00
219	600837	海通证券	100	922.00	0.00
220	300601	康泰生物	34	863.26	0.00

221	688008	澜起科技	15	861.30	0.00
222	601898	中煤能源	102	860.88	0.00
223	000425	徐工机械	126	853.02	0.00
224	000800	一汽解放	100	837.00	0.00
225	002180	纳思达	24	822.00	0.00
226	000877	天山股份	100	814.00	0.00
227	000723	美锦能源	100	754.00	0.00
228	601236	红塔证券	100	745.00	0.00
229	600383	金地集团	100	721.00	0.00
230	601238	广汽集团	69	718.98	0.00
231	601868	中国能建	306	716.04	0.00
232	600795	国电电力	182	697.06	0.00
233	600016	民生银行	185	693.75	0.00
234	600918	中泰证券	100	691.00	0.00
235	000157	中联重科	100	675.00	0.00
236	601009	南京银行	81	648.00	0.00
237	002027	分众传媒	93	633.33	0.00
238	600426	华鲁恒升	20	612.60	0.00
239	300782	卓胜微	6	579.78	0.00
240	601229	上海银行	100	575.00	0.00
241	600958	东方证券	56	543.20	0.00
242	000100	TCL 科技	130	512.20	0.00
243	601628	中国人寿	14	489.44	0.00
244	601989	中国重工	100	482.00	0.00
245	000069	华侨城 A	100	440.00	0.00
246	601216	君正集团	106	434.60	0.00
247	601377	兴业证券	69	422.28	0.00
248	601618	中国中冶	102	404.94	0.00
249	002841	视源股份	6	401.04	0.00
250	601818	光大银行	127	389.89	0.00
251	601881	中国银河	33	383.13	0.00
252	600048	保利发展	27	351.81	0.00
253	600104	上汽集团	24	340.08	0.00
254	600606	绿地控股	99	272.25	0.00
255	600000	浦发银行	32	231.68	0.00
256	601988	中国银行	58	226.78	0.00
257	600010	包钢股份	100	179.00	0.00
258	300498	温氏股份	8	146.80	0.00
259	601901	方正证券	20	130.80	0.00
260	601328	交通银行	13	75.40	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（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	603589	口子窖	116,700	5,759,145.00	0.55
2	002402	和而泰	313,600	5,324,928.00	0.51
3	688707	振华新材	166,653	5,131,245.87	0.49
4	600163	中闽能源	914,900	5,105,142.00	0.49
5	600985	淮北矿业	435,000	5,011,200.00	0.48
6	601636	旗滨集团	578,000	4,982,360.00	0.48
7	300428	立中集团	214,500	4,946,370.00	0.47
8	601717	郑煤机	395,200	4,920,240.00	0.47
9	002508	老板电器	194,400	4,916,376.00	0.47
10	603613	国联股份	132,836	4,905,633.48	0.47
11	002283	天润工业	763,700	4,902,954.00	0.47
12	000933	神火股份	376,700	4,897,100.00	0.47
13	603989	艾华集团	231,900	4,883,814.00	0.47
14	000799	酒鬼酒	54,100	4,877,115.00	0.47
15	600035	楚天高速	1,180,400	4,816,032.00	0.46
16	002268	电科网安	172,800	4,815,936.00	0.46
17	688188	柏楚电子	25,017	4,717,205.52	0.45
18	002314	南山控股	1,416,300	4,673,790.00	0.45
19	600702	舍得酒业	37,000	4,586,150.00	0.44
20	000785	居然之家	1,165,400	4,440,174.00	0.43
21	300735	光弘科技	414,500	4,435,150.00	0.43
22	002020	京新药业	340,300	4,362,646.00	0.42
23	601222	林洋能源	474,445	3,885,704.55	0.37
24	002106	莱宝高科	383,900	3,263,150.00	0.31
25	000718	苏宁环球	1,115,096	3,044,212.08	0.29
26	000582	北部湾港	391,200	2,973,120.00	0.29
27	688425	铁建重工	570,993	2,746,476.33	0.26
28	601577	长沙银行	349,300	2,710,568.00	0.26
29	000683	远兴能源	355,300	2,554,607.00	0.25
30	603118	共进股份	176,000	2,339,040.00	0.22
31	688696	极米科技	16,728	2,331,715.92	0.22
32	000030	富奥股份	426,100	2,147,544.00	0.21
33	002176	江特电机	118,400	1,411,328.00	0.14
34	002138	顺络电子	54,000	1,291,140.00	0.12
35	000810	创维数字	70,800	1,144,836.00	0.11
36	002056	横店东磁	62,100	1,130,841.00	0.11
37	600277	亿利洁能	225,630	731,041.20	0.07
38	600284	浦东建设	116,060	710,287.20	0.07
39	002611	东方精工	95,600	548,744.00	0.05
40	600850	电科数字	17,500	412,825.00	0.04
41	000517	荣安地产	122,200	372,710.00	0.04
42	000555	神州信息	14,300	175,890.00	0.02
43	301292	C海科	5,824	116,421.76	0.01

44	688472	阿特斯	4,939	84,160.56	0.01
45	301202	C 朗威	3,060	79,009.20	0.01
46	301358	湖南裕能	1,809	77,588.01	0.01
47	688443	智翔金泰	2,071	61,073.79	0.01
48	688777	中控技术	815	51,165.70	0.00
49	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
50	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
51	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
52	688200	华峰测控	121	18,513.00	0.00
53	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
54	688686	奥普特	91	14,967.68	0.00
55	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
56	603267	鸿远电子	200	13,060.00	0.00
57	300438	鹏辉能源	269	12,922.76	0.00
58	603198	迎驾贡酒	200	12,760.00	0.00
59	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
60	688536	思瑞浦	52	11,336.00	0.00
61	605369	拱东医疗	200	11,208.00	0.00
62	300294	博雅生物	282	10,230.96	0.00
63	300073	当升科技	200	10,066.00	0.00
64	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
65	603688	石英股份	87	9,904.08	0.00
66	300395	菲利华	200	9,840.00	0.00
67	603489	八方股份	140	9,816.80	0.00
68	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
69	300777	中简科技	200	9,452.00	0.00
70	603605	珀莱雅	84	9,441.60	0.00
71	688819	天能股份	255	9,394.20	0.00
72	601869	长飞光纤	245	9,067.45	0.00
73	300726	宏达电子	200	8,944.00	0.00
74	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
75	000036	华联控股	2,120	8,734.40	0.00
76	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
77	603236	移远通信	140	8,079.40	0.00
78	600511	国药股份	200	7,770.00	0.00
79	603345	安井食品	52	7,633.60	0.00
80	603882	金域医学	100	7,550.00	0.00
81	002851	麦格米特	200	7,294.00	0.00
82	688202	美迪西	84	7,161.00	0.00
83	688122	西部超导	125	6,966.25	0.00
84	000869	张裕 A	200	6,132.00	0.00
85	300595	欧普康视	200	6,038.00	0.00
86	603733	仙鹤股份	279	5,817.15	0.00

87	603043	广州酒家	202	5,708.52	0.00
88	300529	健帆生物	237	5,493.66	0.00
89	300638	广和通	240	5,443.20	0.00
90	300894	火星号	200	5,108.00	0.00
91	002032	苏泊尔	100	5,000.00	0.00
92	300003	乐普医疗	220	4,974.20	0.00
93	000738	航发控制	200	4,880.00	0.00
94	002287	奇正藏药	200	4,780.00	0.00
95	600750	江中药业	200	4,386.00	0.00
96	605589	圣泉集团	200	4,348.00	0.00
97	603915	国茂股份	200	4,236.00	0.00
98	603212	赛伍技术	200	4,162.00	0.00
99	603939	益丰药房	106	3,922.00	0.00
100	601231	环旭电子	262	3,919.52	0.00
101	300415	伊之密	200	3,840.00	0.00
102	688099	晶晨股份	43	3,625.76	0.00
103	000739	普洛药业	200	3,548.00	0.00
104	688185	康希诺	41	3,341.50	0.00
105	000807	云铝股份	254	3,233.42	0.00
106	600285	羚锐制药	200	3,212.00	0.00
107	600230	沧州大化	200	2,936.00	0.00
108	600580	卧龙电驱	200	2,922.00	0.00
109	300806	斯迪克	155	2,901.60	0.00
110	002759	天际股份	200	2,796.00	0.00
111	600639	浦东金桥	220	2,730.20	0.00
112	002048	宁波华翔	200	2,680.00	0.00
113	002008	大族激光	100	2,620.00	0.00
114	603228	景旺电子	102	2,616.30	0.00
115	300244	迪安诊断	95	2,434.85	0.00
116	601966	玲珑轮胎	100	2,222.00	0.00
117	600153	建发股份	200	2,182.00	0.00
118	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
119	002465	海格通信	200	2,068.00	0.00
120	600256	广汇能源	299	2,051.14	0.00
121	600967	内蒙一机	200	2,020.00	0.00
122	002461	珠江啤酒	225	1,982.25	0.00
123	000823	超声电子	200	1,896.00	0.00
124	002294	信立泰	56	1,746.64	0.00
125	000528	柳工	216	1,706.40	0.00
126	600879	航天电子	200	1,698.00	0.00
127	002966	苏州银行	250	1,637.50	0.00
128	600755	厦门国贸	200	1,548.00	0.00
129	600906	财达证券	200	1,440.00	0.00

130	600901	江苏租赁	335	1,383.55	0.00
131	002600	领益智造	200	1,382.00	0.00
132	600236	桂冠电力	230	1,281.10	0.00
133	603868	飞科电器	20	1,261.80	0.00
134	000657	中钨高新	130	1,259.70	0.00
135	002061	浙江交科	280	1,248.80	0.00
136	300088	长信科技	200	1,206.00	0.00
137	002372	伟星新材	58	1,191.32	0.00
138	002080	中材科技	58	1,190.16	0.00
139	000559	万向钱潮	200	1,090.00	0.00
140	000598	兴蓉环境	200	1,086.00	0.00
141	300070	碧水源	200	1,072.00	0.00
142	600063	皖维高新	200	1,010.00	0.00
143	600368	五洲交通	275	1,001.00	0.00
144	300009	安科生物	100	1,000.00	0.00
145	000932	华菱钢铁	200	954.00	0.00
146	601958	金钼股份	83	925.45	0.00
147	603018	华设集团	100	875.00	0.00
148	002127	南极电商	200	766.00	0.00
149	002602	世纪华通	100	759.00	0.00
150	600782	新钢股份	200	742.00	0.00
151	601326	秦港股份	200	676.00	0.00
152	002936	郑州银行	200	460.00	0.00
153	600933	爱柯迪	10	232.90	0.00
154	688009	中国通号	4	23.20	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	601318	中国平安	60,000,257.68	5.16
2	601899	紫金矿业	38,743,524.49	3.33
3	600036	招商银行	35,748,888.40	3.07
4	600031	三一重工	33,980,081.00	2.92
5	002271	东方雨虹	32,482,174.00	2.79
6	000568	泸州老窖	31,045,820.66	2.67
7	603259	药明康德	27,183,397.00	2.34
8	603799	华友钴业	25,598,030.00	2.20
9	600028	中国石化	24,099,539.00	2.07
10	300015	爱尔眼科	23,992,348.00	2.06
11	300059	东方财富	23,426,049.98	2.01
12	002475	立讯精密	23,193,155.00	1.99
13	601100	恒立液压	23,088,850.00	1.99

14	300661	圣邦股份	22,935,359.70	1.97
15	600030	中信证券	22,258,189.35	1.91
16	600276	恒瑞医药	22,169,754.60	1.91
17	688777	中控技术	21,550,963.28	1.85
18	000651	格力电器	21,043,837.00	1.81
19	002142	宁波银行	21,037,036.50	1.81
20	600309	万华化学	21,012,817.00	1.81

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	600519	贵州茅台	45,852,886.00	3.94
2	601318	中国平安	42,449,043.00	3.65
3	300760	迈瑞医疗	42,226,105.00	3.63
4	300750	宁德时代	39,811,204.83	3.42
5	600845	宝信软件	34,265,378.55	2.95
6	601899	紫金矿业	32,775,017.00	2.82
7	000963	华东医药	31,561,833.00	2.71
8	002594	比亚迪	30,688,736.00	2.64
9	601628	中国人寿	28,140,689.00	2.42
10	600256	广汇能源	27,542,515.00	2.37
11	603259	药明康德	27,224,719.23	2.34
12	601319	中国人保	25,865,359.00	2.22
13	601857	中国石油	25,432,205.00	2.19
14	603369	今世缘	24,408,944.00	2.10
15	300059	东方财富	24,161,303.48	2.08
16	002049	紫光国微	23,624,957.00	2.03
17	002821	凯莱英	23,531,925.60	2.02
18	300015	爱尔眼科	23,191,697.00	1.99
19	600039	四川路桥	23,159,751.00	1.99
20	603501	韦尔股份	22,916,615.25	1.97

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	2,533,896,735.46
卖出股票收入（成交）总额	2,594,169,754.14

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	3,438,416.39	0.33
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,438,416.39	0.33

## 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	019688	22 国债 23	30,000	3,034,177.81	0.29
2	019694	23 国债 01	4,000	404,238.58	0.04

## 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：无。

## 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：无。

## 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：无。

## 7.10 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 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期本基金投资的前十名证券除招商银行、宁波银行和中信证券的发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）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）因个人经营贷款挪用至房地产市场等案由，于 2022 年 9 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国人民银行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）因违反账户管理规定等案由，于 2022 年 8 月 31 日被中国人民银行处以罚款。

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）因柜面业务内控管理不到位案由，于 2022 年 9 月 8 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）因违规开展异地互联网贷款业务等案由，于 2023 年 1 月 9 日被宁波银保监局处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

中信证券股份有限公司（简称中信证券）因未按规定履行客户身份识别义务等案由，于 2023 年 2 月 6 日被中国人民银行处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	177,353.59
2	应收清算款	6,974,754.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	179,618.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,331,726.91
---	----	--------------

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：无。

**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：无。

**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：无。

**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	21,661	14,326.45	93,316,685.74	30.07	217,008,584.02	69.93
长城久泰沪深 300 指数 C	3,162	150,532.05	466,733,536.57	98.06	9,248,804.54	1.94
合计	24,823	31,676.57	560,050,222.31	71.23	226,257,388.56	28.77

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	285,026.37	0.0918
	长城久泰沪深 300 指数 C	46,354.61	0.0097
	合计	331,380.98	0.0421

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	10~50
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	10~50
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	314,502,553.20	528,554,165.61
本报告期基金总申购份额	8,830,497.09	10,784,010.06
减：本报告期基金总赎回份额	13,007,780.53	63,355,834.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	310,325,269.76	475,982,341.11

## § 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 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

在本报告期内，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）。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	5,123,895,367.16	100.00	1,185,182.46	100.00	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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 17 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
- (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	3,918,173.56	100.00	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 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提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
3	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 10 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	20230303-20230630	164,264,534.23	-	-	164,264,534.23	20.8906
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

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 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：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn



