

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 08 月 30 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59

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 .....	59
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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 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	621,170,115.99 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	299,054,886.34 份	322,115,229.65 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	祝函
	联系电话	0755-29279006
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn
		张珊
		400-61-95555
		zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-8868-666	400-61-95555
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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	-48,925,932.25	-29,956,751.97
本期利润	-12,481,858.59	-19,897,799.48
加权平均基金份额 本期利润	-0.0376	-0.0597
本期加权平均净 值利润率	-2.35%	-6.86%
本期基金份额净 值增长率	-5.60%	-5.74%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	34,602,866.07	-46,800,282.06
期末可供分配基金份额利润	0.1157	-0.1453
期末基金资产净值	471,582,266.23	275,314,947.59
期末基金份额净值	1.5769	0.8547
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	307.97%	9.68%

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	-2.33%	0.48%	-3.14%	0.46%	0.81%	0.02%
过去三个月	-2.38%	0.82%	-2.03%	0.72%	-0.35%	0.10%
过去六个月	-5.60%	1.12%	0.88%	0.85%	-6.48%	0.27%
过去一年	-13.86%	1.05%	-9.38%	0.83%	-4.48%	0.22%
过去三年	-39.44%	1.06%	-32.19%	0.99%	-7.25%	0.07%
自基金合同生效起至今	307.97%	1.51%	208.10%	1.51%	99.87%	0.00%

长城久泰沪深 300 指数 C

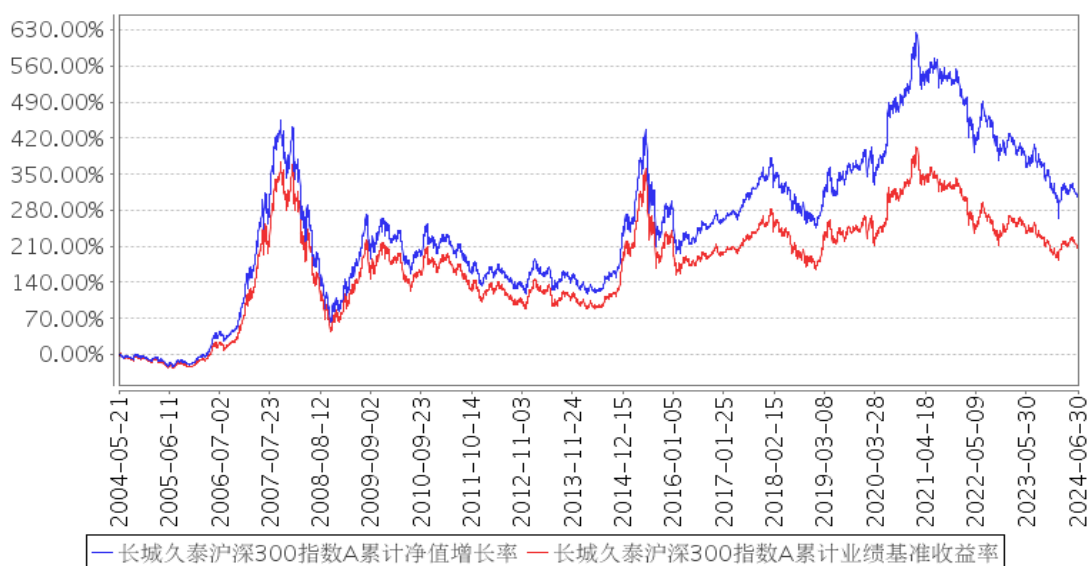
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	-2.35%	0.48%	-3.14%	0.46%	0.79%	0.02%
过去三个月	-2.45%	0.82%	-2.03%	0.72%	-0.42%	0.10%
过去六个月	-5.74%	1.12%	0.88%	0.85%	-6.62%	0.27%
过去一年	-14.12%	1.05%	-9.38%	0.83%	-4.74%	0.22%
过去三年	-40.16%	1.06%	-32.19%	0.99%	-7.97%	0.07%
自基金合同生效起至今	9.68%	1.16%	11.30%	1.13%	-1.62%	0.03%

注：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% 。

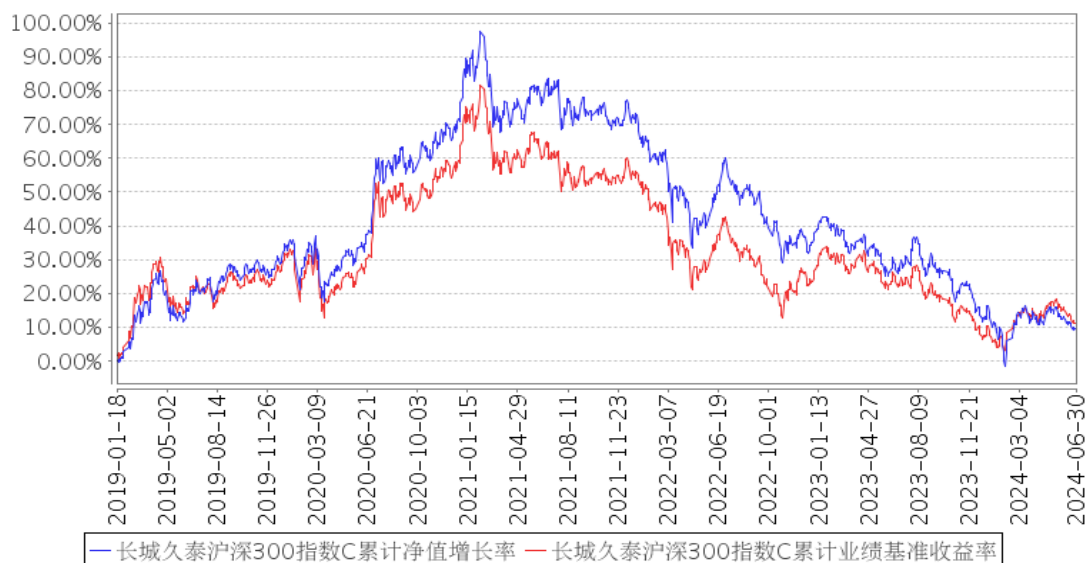
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更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%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2024 年 6 月 30 日，公

司旗下共管理 106 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

#### 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、权益投资一部总经理、本基金的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	24 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、权益投资一部总经理、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	2018 年 11 月 30 日	-	16 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兼基金经理。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 2022 年 6 月至 2023 年 9 月任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至 2023 年 7 月兼任专户投资经理。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 2023 年 12 月至今任“长城智盈添益债券型发起式证券投资基金”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

注：无。

#### 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

上半年权益市场波动较大，债券市场相对表现更好。A 股主要指数有所分化，沪深 300 上涨，中证 500、中证 1000、创业板等小盘成长性指数下跌；风格方面，市场广度效应消失，基于确定性逻辑的“缩圈”行情下，微小市值个股流动性风险凸显，微观交易上出现了不同于过去三年的统计规律甚至是三倍标准差之外的现象，这些尾部风险极大影响了市场参与者的交易结构和交易行为，这对部分交易性数据产生因子为主的量化策略带来了较大负面贡献。风格上看，红利与价值类因子较为抗跌；二季度相比一季度随着个股波动逐渐降低，市场从尾部风险交易回归到常态化的市场参与结构，交易性数据产生的因子有效性逐渐回归。

报告期内，本基金主要通过深度学习等神经网络方法广泛挖掘市场有效因子，并充分利用人工智能等算法进行多因子组合，严格控制行业与风格的相对偏离风险；基于市场对于中小股票的认知变化，模型在股票池的基础构建中优化了价值性的筛选因子，量化算法在因子挖掘中利用了不同风险下数据的学习提高因子稳健性；从策略分散性考虑，结合因子动量、价值、市场资金流向等分析，增加了长期趋势性因子的有效配置。

#### 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 1.5769 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.60%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；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 0.8547 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年以来，由于经济修复长期不达预期，股票市场显著承压，叠加从年初开始，参与者结构显著波动情况，量化因子的表现明显偏弱；随着近期三中全会的成功召开，提纲挈领的规划了

未来深化改革的方向和蓝图，预计下半年货币、财政等相关经济政策会逐步出台，用以应对当前的经济下行压力。

从各行业与指数估值来看，大多数都处于过去 5 年的底部区域，已经较大程度的反映了对于未来经济悲观的预期，大盘指数进一步下跌的空间不大；另一方面，从微观层面看下半年的市场交易结构预计会回归到常态化运行机制，量化多因子的表现有望回归到正常水平。

#### 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、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

托管人声明：

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

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,876,946.91	11,538,661.93
结算备付金		4,313,648.97	2,279,347.83
存出保证金		313,413.11	236,689.54
交易性金融资产	6.4.7.2	737,594,939.36	809,278,261.86
其中：股票投资		704,915,773.88	775,303,129.39
基金投资		-	-
债券投资		32,679,165.48	33,975,132.47
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		-	5,177,927.01
应收股利		-	-
应收申购款		450,953.14	402,963.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		749,549,901.49	828,913,851.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		63,272.28	6,298,497.57
应付赎回款		1,034,707.59	786,195.81
应付管理人报酬		609,738.85	721,384.51
应付托管费		124,436.52	147,221.34
应付销售服务费		68,839.87	101,525.61
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	751,692.56	520,802.12
负债合计		2,652,687.67	8,575,626.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	621,170,115.99	665,246,401.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	125,727,097.83	155,091,823.08
净资产合计		746,897,213.82	820,338,224.32
负债和净资产总计		749,549,901.49	828,913,851.28

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 621,170,115.99 份，其中长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额总额 299,054,886.34 份，基金份额净值 1.5769 元；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额总额 322,115,229.65 份，基金份额净值 0.8547 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-27,008,265.94	-49,400,665.96
1. 利息收入		73,023.75	113,829.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	73,023.75	113,829.70
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-73,925,860.29	-19,714,929.67
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-83,523,906.54	-33,528,981.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	338,259.65	189,420.03
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	9,259,786.60	13,624,632.14
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	46,503,026.15	-29,832,693.25
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	341,544.45	33,127.26
<b>减：二、营业总支出</b>		5,371,392.13	7,462,631.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,029,457.07	5,472,290.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	822,338.19	1,116,794.05
3. 销售服务费		432,310.80	781,608.90
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
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	87, 286. 07	91, 937. 11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-32, 379, 658. 07	-56, 863, 297. 13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-32, 379, 658. 07	-56, 863, 297. 13
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-32, 379, 658. 07	-56, 863, 297. 13

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	665, 246, 401. 24	-	155, 091, 823. 08	820, 338, 224. 32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	665, 246, 401. 24	-	155, 091, 823. 08	820, 338, 224. 32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44, 076, 285. 25	-	-29, 364, 725. 25	-73, 441, 010. 50
（一）、综合收益总额	-	-	-32, 379, 658. 07	-32, 379, 658. 07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-44, 076, 285. 25	-	3, 014, 932. 82	-41, 061, 352. 43
其中：1. 基金申购款	267, 140, 671. 31	-	89, 102, 724. 85	356, 243, 396. 16
2. 基金赎回款	-311, 216, 956. 56	-	-86, 087, 792. 03	-397, 304, 748. 59

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	621,170,115.99	-	125,727,097.83	746,897,213.82
项目	上年度可比期间 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	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、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-

填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	786,307,610.87	-	255,511,857.28	1,041,819,468.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 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 指数 A 类和长城久泰沪深 300 指数 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

### (2) 增值税及附加

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### (3) 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。

#### (4) 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,876,946.91
等于：本金	6,876,235.58
加：应计利息	711.33
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	6,876,946.91

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	724,642,290.38	-	704,915,773.88	-19,726,516.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	502,285.48	32,679,165.48	62,178.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	502,285.48	32,679,165.48	62,178.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	724,642,290.38	502,285.48	737,594,939.36	-19,664,338.50

#### 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 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	909.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	666,247.67
其中：交易所市场	666,247.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	59,672.34



合计	751,692.56
----	------------

### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	284,368,425.63	284,368,425.63
本期申购	180,787,775.01	180,787,775.01
本期赎回（以“-”号填列）	-166,101,314.30	-166,101,314.30
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	299,054,886.34	299,054,886.34

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	380,877,975.61	380,877,975.61
本期申购	86,352,896.30	86,352,896.30
本期赎回（以“-”号填列）	-145,115,642.26	-145,115,642.26
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	322,115,229.65	322,115,229.65

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	77,025,491.04	113,600,892.23	190,626,383.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	77,025,491.04	113,600,892.23	190,626,383.27
本期利润	-48,925,932.25	36,444,073.66	-12,481,858.59
本期基金份额交易产	6,503,307.28	-12,120,452.07	-5,617,144.79

生的变动数			
其中：基金申购款	32,211,526.50	67,432,818.03	99,644,344.53
基金赎回款	-25,708,219.22	-79,553,270.10	-105,261,489.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,602,866.07	137,924,513.82	172,527,379.89

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	12,948,703.55	-48,483,263.74	-35,534,560.19
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	12,948,703.55	-48,483,263.74	-35,534,560.19
本期利润	-29,956,751.97	10,058,952.49	-19,897,799.48
本期基金份额交易产生的变动数	422,420.58	8,209,657.03	8,632,077.61
其中：基金申购款	-3,124,053.35	-7,417,566.33	-10,541,619.68
基金赎回款	3,546,473.93	15,627,223.36	19,173,697.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,585,627.84	-30,214,654.22	-46,800,282.06

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	44,171.74
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	26,532.16
其他	2,319.85
合计	73,023.75

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-83,523,906.54
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	-83,523,906.54

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,479,038,816.81
减：卖出股票成本总额	2,559,797,474.91
减：交易费用	2,765,248.44
买卖股票差价收入	-83,523,906.54

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	339,581.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,322.00
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	338,259.65

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,100,500.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,001,322.00
减：应计利息总额	100,500.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,322.00

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,259,786.60
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	9,259,786.60

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	46,503,026.15
股票投资	46,473,548.15
债券投资	29,478.00
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	46,503,026.15

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	341,544.45
合计	341,544.45

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,750.71
合计	87,286.07

#### 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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	4,921,379,926.06	100.00	5,123,895,367.16	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	3,407,954.00	100.00	3,918,173.56	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 2024年1月1日至2024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	1,210,163.68	100.00	666,247.67	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,029,457.07
其中：应支付销售机构的客户维护 费	980,294.80	981,947.56
应支付基金管理人的净管理费	3,049,162.27	4,490,343.14

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	822,338.19	1,116,794.05

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	64,924.34	64,924.34
招商银行	-	92,051.91	92,051.91
合计	-	156,976.25	156,976.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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 0.30%。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自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用自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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	6,876,946.91	44,171.74	51,099,556.43	85,720.86

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：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 (2024 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
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024 年 6 月 3 日	1 个月	新股锁定-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1-6 个月 (含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603350	安	2024	1-6 个	新股	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-

	乃达	年6月26日	月(含)	未上市						
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

#### 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

截至本报告期末 2024 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 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 2024 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 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 2024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							
货币资金	6,876,946.91	-	-	-	-	-	6,876,946.91
结算备付金	4,313,648.97	-	-	-	-	-	4,313,648.97
存出保证金	313,413.11	-	-	-	-	-	313,413.11
交易性金融资产	5,078,075.34	-27,601,090.14	-	-	-	-704,915,773.88	737,594,939.36
应收申购款	-	-	-	-	-	450,953.14	450,953.14
资产总计	16,582,084.33	-27,601,090.14	-	-	-	-705,366,727.02	749,549,901.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,034,707.59	1,034,707.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	609,738.85	609,738.85
应付托管费	-	-	-	-	-	124,436.52	124,436.52
应付清算款	-	-	-	-	-	63,272.28	63,272.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-	68,839.87	68,839.87
其他负债	-	-	-	-	-	751,692.56	751,692.56
负债总计	-	-	-	-	-	2,652,687.67	2,652,687.67
利率敏感度缺口	16,582,084.33	-27,601,090.14	-	-	-	-	-
上年度末 2023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							
货币资金	11,538,661.93	-	-	-	-	-	11,538,661.93
结算备付金	2,279,347.83	-	-	-	-	-	2,279,347.83

存出保证金	236,689.54	-	-	-	-	236,689.54
交易性金融资产	5,097,645.21	-28,877,487.26	-	-	-775,303,129.39	809,278,261.86
应收申购款	-	-	-	-	402,963.11	402,963.11
应收清算款	-	-	-	-	5,177,927.01	5,177,927.01
资产总计	19,152,344.51	-28,877,487.26	-	-	-780,884,019.51	828,913,851.28
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	786,195.81	786,195.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	721,384.51	721,384.51
应付托管费	-	-	-	-	147,221.34	147,221.34
应付清算款	-	-	-	-	6,298,497.57	6,298,497.57
应付销售服务费	-	-	-	-	101,525.61	101,525.61
其他负债	-	-	-	-	520,802.12	520,802.12
负债总计	-	-	-	-	8,575,626.96	8,575,626.96
利率敏感度缺口	19,152,344.51	-28,877,487.26	-	-		

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	23,351.27	56,107.26
	市场利率上升 25 个基点	-23,314.58	-55,891.77

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

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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，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。本基金于本期末及上年度末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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	704,915,773.88	94.38	775,303,129.39	94.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	32,679,165.48	4.38	33,975,132.47	4.14
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	737,594,939.36	98.75	809,278,261.86	98.65

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	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月）

			31 日 )
	沪深 300 指数上升 5%	31,460,390.99	41,564,000.77
	沪深 300 指数下降 5%	-31,460,390.99	-41,564,000.77

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

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	704,772,636.03	774,808,573.28
第二层次	32,724,776.59	33,976,234.87
第三层次	97,526.74	493,453.71
合计	737,594,939.36	809,278,261.86

###### 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

无。

#### 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	704,915,773.88	94.05
	其中：股票	704,915,773.88	94.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,679,165.48	4.36
	其中：债券	32,679,165.48	4.36
	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	11,190,595.88	1.49
8	其他各项资产	764,366.25	0.10
9	合计	749,549,901.49	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	12,799,882.96	1.71
B	采矿业	55,234,635.54	7.40
C	制造业	344,638,517.60	46.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,342,605.67	2.99
E	建筑业	10,610,435.12	1.42
F	批发和零售业	744,045.36	0.10

G	交通运输、仓储和邮政业	31,584,043.86	4.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,062,947.60	3.89
J	金融业	151,938,983.01	20.34
K	房地产业	2,916,450.85	0.39
L	租赁和商务服务业	2,929,898.54	0.39
M	科学研究和技术服务业	2,668,406.57	0.36
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	2,282,928.48	0.31
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	669,753,781.16	89.67

### 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	2,366.80	0.00
B	采矿业	981,019.33	0.13
C	制造业	25,206,059.47	3.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,145,553.14	0.29
E	建筑业	297,137.51	0.04
F	批发和零售业	137,217.35	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,617,329.63	0.35
H	住宿和餐饮业	142,476.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	165,756.27	0.02
J	金融业	4,166.46	0.00
K	房地产业	454,117.70	0.06
L	租赁和商务服务业	8,005.65	0.00
M	科学研究和技术服务业	156,344.95	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	70,537.46	0.01
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,773,905.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,161,992.72	4.71

### 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	20,422	29,967,038.58	4.01
2	601318	中国平安	567,793	23,483,918.48	3.14
3	300750	宁德时代	101,460	18,265,843.80	2.45
4	000333	美的集团	250,221	16,139,254.50	2.16
5	601919	中远海控	1,025,140	15,879,418.60	2.13
6	601328	交通银行	1,934,413	14,450,065.11	1.93
7	601899	紫金矿业	778,246	13,673,782.22	1.83
8	000651	格力电器	302,600	11,867,972.00	1.59
9	600887	伊利股份	453,236	11,711,618.24	1.57
10	601288	农业银行	2,632,331	11,476,963.16	1.54
11	600036	招商银行	331,388	11,330,155.72	1.52
12	002475	立讯精密	253,600	9,969,016.00	1.33
13	601088	中国神华	218,800	9,708,156.00	1.30
14	000338	潍柴动力	581,000	9,435,440.00	1.26
15	601169	北京银行	1,585,419	9,258,846.96	1.24
16	002415	海康威视	297,304	9,189,666.64	1.23
17	600406	国电南瑞	353,075	8,812,752.00	1.18
18	600795	国电电力	1,388,882	8,319,403.18	1.11
19	601229	上海银行	1,137,500	8,258,250.00	1.11
20	601225	陕西煤业	317,699	8,187,103.23	1.10
21	600019	宝钢股份	1,211,929	8,059,327.85	1.08
22	603993	洛阳钼业	940,600	7,995,100.00	1.07
23	600999	招商证券	548,924	7,635,532.84	1.02
24	600989	宝丰能源	439,300	7,613,069.00	1.02
25	600015	华夏银行	1,136,479	7,273,465.60	0.97
26	002714	牧原股份	160,514	6,998,410.40	0.94
27	002001	新和成	357,578	6,865,497.60	0.92
28	601808	中海油服	396,600	6,821,520.00	0.91

29	605499	东鹏饮料	30,800	6,645,100.00	0.89
30	000999	华润三九	145,330	6,188,151.40	0.83
31	600919	江苏银行	832,561	6,185,928.23	0.83
32	000895	双汇发展	255,100	6,063,727.00	0.81
33	000408	藏格矿业	242,750	5,842,992.50	0.78
34	600588	用友网络	580,517	5,805,170.00	0.78
35	300498	温氏股份	292,708	5,801,472.56	0.78
36	000725	京东方 A	1,405,464	5,748,347.76	0.77
37	003816	中国广核	1,240,200	5,742,126.00	0.77
38	300832	新产业	77,500	5,226,600.00	0.70
39	600089	特变电工	374,480	5,194,037.60	0.70
40	601211	国泰君安	380,807	5,159,934.85	0.69
41	300979	华利集团	76,800	4,673,280.00	0.63
42	002594	比亚迪	18,000	4,504,500.00	0.60
43	300308	中际旭创	32,600	4,494,888.00	0.60
44	002371	北方华创	13,786	4,410,003.54	0.59
45	600346	恒力石化	314,354	4,385,238.30	0.59
46	601138	工业富联	158,994	4,356,435.60	0.58
47	601166	兴业银行	247,046	4,352,950.52	0.58
48	600875	东方电气	233,300	4,304,385.00	0.58
49	300418	昆仑万维	130,790	4,216,669.60	0.56
50	000858	五粮液	32,674	4,183,578.96	0.56
51	300059	东方财富	342,095	3,612,523.20	0.48
52	600219	南山铝业	947,196	3,608,816.76	0.48
53	600030	中信证券	197,208	3,595,101.84	0.48
54	000157	中联重科	447,700	3,438,336.00	0.46
55	600028	中国石化	541,330	3,421,205.60	0.46
56	601601	中国太保	121,334	3,380,365.24	0.45
57	000568	泸州老窖	23,307	3,344,321.43	0.45
58	600690	海尔智家	116,099	3,294,889.62	0.44
59	600809	山西汾酒	15,560	3,281,292.80	0.44
60	601877	正泰电器	168,471	3,211,057.26	0.43
61	600039	四川路桥	402,040	3,172,095.60	0.42
62	600183	生益科技	147,682	3,110,182.92	0.42
63	002252	上海莱士	390,900	3,056,838.00	0.41
64	600276	恒瑞医药	78,266	3,010,110.36	0.40
65	600436	片仔癀	13,650	2,827,870.50	0.38
66	601006	大秦铁路	378,895	2,712,888.20	0.36
67	600309	万华化学	33,243	2,688,028.98	0.36
68	603501	韦尔股份	26,485	2,631,814.45	0.35
69	000625	长安汽车	189,848	2,549,658.64	0.34
70	002050	三花智控	128,900	2,459,412.00	0.33
71	601816	京沪高铁	442,000	2,373,540.00	0.32

72	300015	爱尔眼科	221,214	2,282,928.48	0.31
73	600009	上海机场	69,612	2,244,987.00	0.30
74	600233	圆通速递	141,400	2,212,910.00	0.30
75	300124	汇川技术	41,740	2,141,262.00	0.29
76	600938	中国海油	64,200	2,118,600.00	0.28
77	603288	海天味业	59,740	2,059,237.80	0.28
78	000063	中兴通讯	73,300	2,050,201.00	0.27
79	601668	中国建筑	385,515	2,047,084.65	0.27
80	601985	中国核电	190,100	2,026,466.00	0.27
81	002049	紫光国微	38,062	2,002,061.20	0.27
82	600886	国投电力	106,660	1,945,478.40	0.26
83	601988	中国银行	419,558	1,938,357.96	0.26
84	002493	荣盛石化	199,950	1,931,517.00	0.26
85	601009	南京银行	185,681	1,929,225.59	0.26
86	600000	浦发银行	233,232	1,919,499.36	0.26
87	002027	分众传媒	309,793	1,877,345.58	0.25
88	002812	恩捷股份	56,800	1,797,720.00	0.24
89	601989	中国重工	364,100	1,795,013.00	0.24
90	600332	白云山	59,300	1,739,269.00	0.23
91	603259	药明康德	43,875	1,719,461.25	0.23
92	300274	阳光电源	27,440	1,702,103.20	0.23
93	600150	中国船舶	41,400	1,685,394.00	0.23
94	000001	平安银行	161,500	1,639,225.00	0.22
95	600016	民生银行	429,285	1,626,990.15	0.22
96	000708	中信特钢	114,890	1,559,057.30	0.21
97	002352	顺丰控股	43,400	1,548,946.00	0.21
98	600031	三一重工	93,191	1,537,651.50	0.21
99	000100	TCL 科技	352,730	1,523,793.60	0.20
100	601012	隆基绿能	108,406	1,519,852.12	0.20
101	300433	蓝思科技	83,241	1,519,148.25	0.20
102	300999	金龙鱼	55,500	1,517,925.00	0.20
103	601398	工商银行	265,600	1,513,920.00	0.20
104	601766	中国中车	201,500	1,513,265.00	0.20
105	600941	中国移动	13,900	1,494,250.00	0.20
106	000166	申万宏源	346,500	1,493,415.00	0.20
107	601939	建设银行	200,561	1,484,151.40	0.20
108	002236	大华股份	94,306	1,457,970.76	0.20
109	002142	宁波银行	65,620	1,447,577.20	0.19
110	600660	福耀玻璃	29,543	1,415,109.70	0.19
111	300014	亿纬锂能	35,400	1,413,168.00	0.19
112	688981	中芯国际	30,547	1,408,216.70	0.19
113	600050	中国联通	298,500	1,402,950.00	0.19
114	601319	中国人保	271,483	1,398,137.45	0.19

115	002459	晶澳科技	122,537	1,372,414.40	0.18
116	601872	招商轮船	162,367	1,372,001.15	0.18
117	000792	盐湖股份	78,200	1,364,590.00	0.18
118	601336	新华保险	44,559	1,338,106.77	0.18
119	600837	海通证券	153,500	1,313,960.00	0.18
120	002311	海大集团	27,400	1,289,170.00	0.17
121	600104	上汽集团	89,324	1,238,030.64	0.17
122	688041	海光信息	17,288	1,215,692.16	0.16
123	000938	紫光股份	53,774	1,201,848.90	0.16
124	600893	航发动力	32,626	1,192,480.30	0.16
125	600048	保利发展	131,527	1,152,176.52	0.15
126	601658	邮储银行	221,800	1,124,526.00	0.15
127	601390	中国中铁	171,474	1,118,010.48	0.15
128	600845	宝信软件	34,246	1,093,474.78	0.15
129	600905	三峡能源	248,600	1,083,896.00	0.15
130	601688	华泰证券	87,353	1,082,303.67	0.14
131	603019	中科曙光	26,000	1,079,000.00	0.14
132	688111	金山办公	4,704	1,070,160.00	0.14
133	603986	兆易创新	11,000	1,051,820.00	0.14
134	601600	中国铝业	135,740	1,035,696.20	0.14
135	300316	晶盛机电	35,348	1,015,548.04	0.14
136	002230	科大讯飞	23,600	1,013,620.00	0.14
137	688256	寒武纪	5,100	1,013,217.00	0.14
138	601998	中信银行	146,705	982,923.50	0.13
139	002304	洋河股份	11,815	953,943.10	0.13
140	601628	中国人寿	30,714	953,669.70	0.13
141	300450	先导智能	55,022	915,015.86	0.12
142	688008	澜起科技	15,931	910,615.96	0.12
143	601818	光大银行	284,927	903,218.59	0.12
144	600585	海螺水泥	37,700	889,343.00	0.12
145	002179	中航光电	23,200	882,760.00	0.12
146	000002	万科A	127,081	880,671.33	0.12
147	601117	中国化学	105,152	866,452.48	0.12
148	000425	徐工机械	118,726	848,890.90	0.11
149	688012	中微公司	5,962	842,192.12	0.11
150	600547	山东黄金	30,476	834,432.88	0.11
151	600674	川投能源	44,336	831,300.00	0.11
152	601868	中国能建	386,906	820,240.72	0.11
153	601669	中国电建	145,762	814,809.58	0.11
154	601186	中国铁建	94,251	807,731.07	0.11
155	600926	杭州银行	60,522	789,812.10	0.11
156	600760	中航沈飞	19,008	762,220.80	0.10
157	300408	三环集团	25,800	753,102.00	0.10

158	002241	歌尔股份	38,600	753,086.00	0.10
159	600438	通威股份	39,100	747,201.00	0.10
160	601888	中国中免	11,904	743,880.96	0.10
161	001965	招商公路	59,900	710,414.00	0.10
162	000538	云南白药	13,700	700,755.00	0.09
163	600584	长电科技	21,804	691,404.84	0.09
164	601901	方正证券	87,920	679,621.60	0.09
165	600111	北方稀土	39,448	678,505.60	0.09
166	000768	中航西飞	27,600	663,228.00	0.09
167	600489	中金黄金	44,500	658,600.00	0.09
168	688036	传音控股	8,372	640,792.88	0.09
169	000977	浪潮信息	17,496	636,329.52	0.09
170	300413	芒果超媒	30,370	634,733.00	0.08
171	002601	龙佰集团	34,100	633,237.00	0.08
172	600426	华鲁恒升	23,020	613,252.80	0.08
173	000776	广发证券	49,212	598,910.04	0.08
174	600958	东方证券	76,556	581,825.60	0.08
175	600741	华域汽车	35,446	580,605.48	0.08
176	601838	成都银行	37,934	576,217.46	0.08
177	600023	浙能电力	81,035	576,158.85	0.08
178	601377	兴业证券	112,619	569,852.14	0.08
179	002938	鹏鼎控股	14,300	568,568.00	0.08
180	601800	中国交建	63,411	566,894.34	0.08
181	600011	华能国际	58,500	562,770.00	0.08
182	000596	古井贡酒	2,636	556,380.52	0.07
183	601111	中国国航	73,800	544,644.00	0.07
184	600115	中国东航	135,700	544,157.00	0.07
185	600010	包钢股份	386,700	541,380.00	0.07
186	300759	康龙化成	28,424	528,117.92	0.07
187	600029	南方航空	89,600	527,744.00	0.07
188	601916	浙商银行	189,600	523,296.00	0.07
189	001979	招商蛇口	59,300	521,247.00	0.07
190	603369	今世缘	10,936	505,243.20	0.07
191	600362	江西铜业	21,100	499,648.00	0.07
192	688271	联影医疗	4,538	497,818.60	0.07
193	000807	云铝股份	36,554	493,844.54	0.07
194	600372	中航机载	41,200	493,164.00	0.07
195	300122	智飞生物	17,531	491,393.93	0.07
196	601633	长城汽车	19,300	488,290.00	0.07
197	600188	兖矿能源	21,400	486,422.00	0.07
198	601788	光大证券	33,200	485,384.00	0.06
199	000983	山西焦煤	47,000	484,570.00	0.06
200	002129	TCL 中环	55,987	484,287.55	0.06

201	002648	卫星化学	26,899	483,644.02	0.06
202	000786	北新建材	16,280	482,864.80	0.06
203	600176	中国巨石	43,692	482,796.60	0.06
204	002466	天齐锂业	15,985	478,111.35	0.06
205	002460	赣锋锂业	16,580	475,017.00	0.06
206	601021	春秋航空	8,427	474,692.91	0.06
207	601898	中煤能源	37,932	473,391.36	0.06
208	002180	纳思达	17,824	470,910.08	0.06
209	002736	国信证券	52,800	458,832.00	0.06
210	688223	晶科能源	63,661	451,993.10	0.06
211	601066	中信建投	23,200	446,368.00	0.06
212	601995	中金公司	15,000	444,150.00	0.06
213	601698	中国卫通	31,200	439,608.00	0.06
214	600196	复星医药	19,600	433,944.00	0.06
215	601607	上海医药	22,700	433,797.00	0.06
216	600027	华电国际	62,000	430,280.00	0.06
217	600600	青岛啤酒	5,800	422,066.00	0.06
218	300347	泰格医药	8,659	420,827.40	0.06
219	600085	同仁堂	10,836	414,043.56	0.06
220	300661	圣邦股份	4,916	406,946.48	0.05
221	000661	长春高新	4,410	404,705.70	0.05
222	601881	中国银河	37,233	404,350.38	0.05
223	600900	长江电力	13,947	403,347.24	0.05
224	600161	天坛生物	16,360	399,184.00	0.05
225	601618	中国中冶	128,102	397,116.20	0.05
226	600803	新奥股份	18,600	386,880.00	0.05
227	603799	华友钴业	17,451	386,190.63	0.05
228	300896	爱美客	2,240	385,504.00	0.05
229	002271	东方雨虹	31,150	384,391.00	0.05
230	300033	同花顺	3,700	383,690.00	0.05
231	002916	深南电路	3,600	380,772.00	0.05
232	603392	万泰生物	5,767	379,929.96	0.05
233	600745	闻泰科技	13,440	379,680.00	0.05
234	600026	中远海能	24,300	379,323.00	0.05
235	601360	三六零	49,100	377,088.00	0.05
236	601699	潞安环能	20,309	368,202.17	0.05
237	002920	德赛西威	4,200	365,778.00	0.05
238	600515	海南机场	115,400	362,356.00	0.05
239	601689	拓普集团	6,753	362,028.33	0.05
240	601878	浙商证券	33,475	358,852.00	0.05
241	300782	卓胜微	4,600	357,604.00	0.05
242	002074	国轩高科	18,000	344,700.00	0.05
243	601100	恒立液压	7,332	341,524.56	0.05



244	600570	恒生电子	19,192	338,930.72	0.05
245	605117	德业股份	4,512	335,422.08	0.04
246	300751	迈为股份	2,746	328,092.08	0.04
247	688599	天合光能	18,791	317,943.72	0.04
248	000876	新希望	34,200	312,588.00	0.04
249	688126	沪硅产业	22,582	311,857.42	0.04
250	000963	华东医药	11,156	310,248.36	0.04
251	600415	小商品城	41,600	308,672.00	0.04
252	002709	天赐材料	16,389	287,790.84	0.04
253	601238	广汽集团	36,869	285,366.06	0.04
254	603260	合盛硅业	5,862	273,814.02	0.04
255	300628	亿联网络	7,434	273,348.18	0.04
256	300142	沃森生物	24,000	273,120.00	0.04
257	002555	三七互娱	20,600	268,830.00	0.04
258	688396	华润微	7,022	262,903.68	0.04
259	600918	中泰证券	45,100	255,717.00	0.03
260	000301	东方盛虹	32,082	255,693.54	0.03
261	300496	中科创达	5,500	250,745.00	0.03
262	601865	福莱特	12,200	245,220.00	0.03
263	603195	公牛集团	3,054	235,524.48	0.03
264	000617	中油资本	42,500	234,600.00	0.03
265	601059	信达证券	16,500	234,465.00	0.03
266	600132	重庆啤酒	3,800	230,660.00	0.03
267	000733	振华科技	5,500	228,415.00	0.03
268	688303	大全能源	11,184	228,041.76	0.03
269	600061	国投资本	40,004	226,022.60	0.03
270	601799	星宇股份	2,000	224,080.00	0.03
271	300223	北京君正	4,000	221,760.00	0.03
272	002821	凯莱英	3,366	221,482.80	0.03
273	688187	时代电气	4,400	217,272.00	0.03
274	002007	华兰生物	13,700	216,323.00	0.03
275	002410	广联达	22,275	213,394.50	0.03
276	002841	视源股份	7,106	209,840.18	0.03
277	301269	华大九天	2,700	208,035.00	0.03
278	300442	润泽科技	8,600	205,970.00	0.03
279	300454	深信服	4,000	202,120.00	0.03
280	603806	福斯特	13,506	198,538.20	0.03
281	600460	士兰微	11,200	196,112.00	0.03
282	002603	以岭药业	11,300	173,229.00	0.02
283	300919	中伟股份	5,300	164,247.00	0.02
284	603899	晨光股份	5,100	159,528.00	0.02
285	603833	欧派家居	2,921	156,448.76	0.02
286	688363	华熙生物	2,547	144,083.79	0.02

287	601236	红塔证券	22,400	143,808.00	0.02
288	603659	璞泰来	9,780	138,191.40	0.02
289	600732	爱旭股份	13,300	120,365.00	0.02
290	000800	一汽解放	14,000	109,620.00	0.01
291	300957	贝泰妮	2,250	108,720.00	0.01
292	688082	盛美上海	1,100	92,961.00	0.01
293	603296	华勤技术	1,400	77,322.00	0.01
294	600018	上港集团	10,100	58,378.00	0.01
295	300760	迈瑞医疗	168	48,872.88	0.01
296	001289	龙源电力	2,000	34,500.00	0.00
297	601857	中国石油	344	3,550.08	0.00
298	601728	中国电信	200	1,230.00	0.00
299	688009	中国通号	4	24.00	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	000921	海信家电	91,600	2,953,184.00	0.40
2	600763	通策医疗	51,300	2,772,765.00	0.37
3	300118	东方日升	206,700	2,501,070.00	0.33
4	002028	思源电气	37,200	2,488,680.00	0.33
5	600582	天地科技	310,700	2,140,723.00	0.29
6	600096	云天化	103,100	2,002,202.00	0.27
7	600377	宁沪高速	137,700	1,735,020.00	0.23
8	601991	大唐发电	445,500	1,340,955.00	0.18
9	601231	环旭电子	79,662	1,278,575.10	0.17
10	603198	迎驾贡酒	17,300	994,750.00	0.13
11	000887	中鼎股份	80,900	990,216.00	0.13
12	000958	电投产融	218,600	800,076.00	0.11
13	300207	欣旺达	52,102	790,387.34	0.11
14	000990	诚志股份	94,600	703,824.00	0.09
15	002738	中矿资源	25,100	672,680.00	0.09
16	002463	沪电股份	18,000	657,000.00	0.09
17	000937	冀中能源	95,900	642,530.00	0.09
18	002831	裕同科技	25,100	642,309.00	0.09
19	601018	宁波港	185,000	629,000.00	0.08
20	300735	光弘科技	17,800	384,480.00	0.05
21	300476	胜宏科技	11,500	370,990.00	0.05
22	002625	光启技术	20,200	350,470.00	0.05
23	600315	上海家化	19,400	344,932.00	0.05
24	300502	新易盛	3,200	337,760.00	0.05
25	301301	川宁生物	26,300	336,114.00	0.05
26	002085	万丰奥威	25,000	331,000.00	0.04
27	002202	金风科技	38,629	259,586.88	0.03

28	688166	博瑞医药	6,500	227,500.00	0.03
29	601615	明阳智能	23,732	224,030.08	0.03
30	000628	高新发展	5,000	221,850.00	0.03
31	603530	神马电力	8,200	217,218.00	0.03
32	688578	艾力斯	3,400	216,716.00	0.03
33	300857	协创数据	3,800	216,600.00	0.03
34	000099	中信海直	13,300	215,992.00	0.03
35	300181	佐力药业	14,100	213,192.00	0.03
36	300049	福瑞股份	4,200	211,428.00	0.03
37	300917	特发服务	5,900	203,963.00	0.03
38	300394	天孚通信	2,300	203,366.00	0.03
39	003022	联泓新科	13,500	185,085.00	0.02
40	601918	新集能源	18,800	183,300.00	0.02
41	002035	华帝股份	29,000	180,670.00	0.02
42	603515	欧普照明	8,800	152,592.00	0.02
43	300384	三联虹普	11,300	148,256.00	0.02
44	000069	华侨城 A	70,900	144,636.00	0.02
45	600348	华阳股份	14,400	143,424.00	0.02
46	600754	锦江酒店	6,200	142,476.00	0.02
47	600694	大商股份	7,650	128,596.50	0.02
48	300763	锦浪科技	3,000	124,920.00	0.02
49	300673	佩蒂股份	9,000	118,080.00	0.02
50	603486	科沃斯	2,500	117,950.00	0.02
51	688065	凯赛生物	2,348	106,575.72	0.01
52	601155	新城控股	11,706	103,832.22	0.01
53	603290	斯达半导	1,170	100,748.70	0.01
54	000988	华工科技	2,900	86,797.00	0.01
55	002078	太阳纸业	5,500	76,725.00	0.01
56	000877	天山股份	14,000	75,600.00	0.01
57	600606	绿地控股	51,899	70,063.65	0.01
58	603568	伟明环保	3,300	67,914.00	0.01
59	002130	沃尔核材	4,700	66,364.00	0.01
60	688561	奇安信	2,698	63,726.76	0.01
61	300568	星源材质	6,200	50,840.00	0.01
62	002429	兆驰股份	9,200	44,252.00	0.01
63	300779	惠城环保	900	43,560.00	0.01
64	300905	宝丽迪	1,500	42,615.00	0.01
65	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
66	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
67	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
68	688318	财富趋势	220	17,360.20	0.00
69	688188	柏楚电子	85	15,686.75	0.00
70	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00

71	688696	极米科技	199	15,370.76	0.00
72	002120	韵达股份	1,800	13,932.00	0.00
73	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
74	688200	华峰测控	121	11,101.75	0.00
75	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
76	688356	键凯科技	178	10,462.84	0.00
77	601156	东航物流	500	10,175.00	0.00
78	603605	珀莱雅	84	9,323.16	0.00
79	688003	天准科技	275	9,009.00	0.00
80	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
81	603713	密尔克卫	144	7,706.88	0.00
82	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
83	603236	移远通信	140	6,542.20	0.00
84	000028	国药一致	200	6,446.00	0.00
85	688063	派能科技	160	6,353.60	0.00
86	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
87	688686	奥普特	91	5,826.73	0.00
88	600129	太极集团	200	5,784.00	0.00
89	600702	舍得酒业	100	5,667.00	0.00
90	688385	复旦微电	165	5,177.70	0.00
91	688268	华特气体	100	5,161.00	0.00
92	688536	思瑞浦	52	5,086.12	0.00
93	688122	西部超导	125	4,790.00	0.00
94	688139	海尔生物	128	4,761.60	0.00
95	603613	国联股份	236	4,627.96	0.00
96	300776	帝尔激光	100	4,596.00	0.00
97	688276	百克生物	155	4,397.35	0.00
98	000799	酒鬼酒	100	4,387.00	0.00
99	688711	宏微科技	260	4,175.60	0.00
100	688208	道通科技	169	4,079.66	0.00
101	688005	容百科技	175	4,074.00	0.00
102	603737	三棵树	111	4,025.97	0.00
103	688002	睿创微纳	143	3,999.71	0.00
104	603345	安井食品	52	3,864.12	0.00
105	603688	石英股份	130	3,849.30	0.00
106	002865	钧达股份	100	3,838.00	0.00
107	605168	三人行	145	3,817.85	0.00
108	600779	水井坊	100	3,763.00	0.00
109	000513	丽珠集团	100	3,721.00	0.00
110	688131	皓元医药	183	3,500.79	0.00
111	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
112	002997	瑞鹄模具	100	3,197.00	0.00
113	000762	西藏矿业	175	3,164.00	0.00

114	603197	保隆科技	100	3,150.00	0.00
115	300595	欧普康视	199	3,120.32	0.00
116	688569	铁科轨道	144	2,976.48	0.00
117	002929	润建股份	100	2,911.00	0.00
118	603348	文灿股份	100	2,769.00	0.00
119	300294	博雅生物	82	2,706.00	0.00
120	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
121	688099	晶晨股份	43	2,550.76	0.00
122	300888	稳健医疗	100	2,530.00	0.00
123	002889	东方嘉盛	140	2,338.00	0.00
124	002487	大金重工	100	2,288.00	0.00
125	300726	宏达电子	100	2,280.00	0.00
126	300827	上能电气	100	2,236.00	0.00
127	605598	上海港湾	100	2,209.00	0.00
128	603212	赛伍技术	200	2,208.00	0.00
129	688202	美迪西	84	2,188.20	0.00
130	300777	中简科技	100	2,150.00	0.00
131	000869	张裕 A	100	2,135.00	0.00
132	002128	电投能源	100	2,110.00	0.00
133	002384	东山精密	100	2,070.00	0.00
134	300873	海晨股份	140	2,041.20	0.00
135	603127	昭衍新药	148	1,963.96	0.00
136	300548	博创科技	100	1,949.00	0.00
137	300861	美畅股份	100	1,935.00	0.00
138	600559	老白干酒	100	1,818.00	0.00
139	000819	岳阳兴长	100	1,787.00	0.00
140	603185	弘元绿能	104	1,777.36	0.00
141	603995	甬金股份	100	1,752.00	0.00
142	300952	恒辉安防	100	1,734.00	0.00
143	300623	捷捷微电	100	1,730.00	0.00
144	002541	鸿路钢构	100	1,697.00	0.00
145	300769	德方纳米	60	1,692.00	0.00
146	688185	康希诺	41	1,684.69	0.00
147	002568	百润股份	100	1,683.00	0.00
148	600985	淮北矿业	100	1,674.00	0.00
149	600522	中天科技	100	1,585.00	0.00
150	600487	亨通光电	100	1,577.00	0.00
151	603225	新凤鸣	100	1,559.00	0.00
152	002458	益生股份	180	1,558.80	0.00
153	603517	绝味食品	100	1,540.00	0.00
154	688116	天奈科技	66	1,523.28	0.00
155	002294	信立泰	56	1,491.28	0.00
156	300101	振芯科技	100	1,477.00	0.00

157	002987	京北方	140	1,474.20	0.00
158	002268	电科网安	100	1,423.00	0.00
159	601058	赛轮轮胎	100	1,400.00	0.00
160	603733	仙鹤股份	79	1,388.82	0.00
161	002612	朗姿股份	100	1,382.00	0.00
162	603456	九洲药业	100	1,372.00	0.00
163	600256	广汇能源	199	1,333.30	0.00
164	002484	江海股份	100	1,325.00	0.00
165	601128	常熟银行	175	1,324.75	0.00
166	688819	天能股份	55	1,312.30	0.00
167	300748	金力永磁	100	1,296.00	0.00
168	300894	火星人	100	1,282.00	0.00
169	600368	五洲交通	358	1,278.06	0.00
170	002824	和胜股份	100	1,276.00	0.00
171	002925	盈趣科技	100	1,267.00	0.00
172	300438	鹏辉能源	69	1,265.46	0.00
173	600971	恒源煤电	100	1,194.00	0.00
174	000657	中钨高新	130	1,188.20	0.00
175	600388	龙净环保	100	1,161.00	0.00
176	000681	视觉中国	100	1,150.00	0.00
177	300244	迪安诊断	95	1,140.00	0.00
178	002803	吉宏股份	100	1,113.00	0.00
179	601869	长飞光纤	45	1,094.85	0.00
180	603489	八方股份	40	1,079.20	0.00
181	002756	永兴材料	30	1,073.40	0.00
182	002139	拓邦股份	100	1,062.00	0.00
183	002152	广电运通	100	1,046.00	0.00
184	300529	健帆生物	37	1,006.77	0.00
185	600873	梅花生物	100	1,002.00	0.00
186	300593	新雷能	100	994.00	0.00
187	603053	成都燃气	100	966.00	0.00
188	688707	振华新材	98	954.52	0.00
189	300918	南山智尚	100	954.00	0.00
190	000039	中集集团	100	926.00	0.00
191	601952	苏垦农发	100	902.00	0.00
192	002372	伟星新材	58	894.36	0.00
193	002497	雅化集团	100	892.00	0.00
194	000062	深圳华强	100	890.00	0.00
195	600350	山东高速	100	885.00	0.00
196	603105	芯能科技	100	880.00	0.00
197	601958	金钼股份	83	864.03	0.00
198	600987	航民股份	122	861.32	0.00
199	000009	中国宝安	100	860.00	0.00

200	600035	楚天高速	200	858.00	0.00
201	000823	超声电子	100	851.00	0.00
202	600867	通化东宝	100	837.00	0.00
203	600351	亚宝药业	145	813.45	0.00
204	600884	杉杉股份	100	812.00	0.00
205	002041	登海种业	100	808.00	0.00
206	603889	新澳股份	100	774.00	0.00
207	603868	飞科电器	20	768.00	0.00
208	603686	福龙马	100	762.00	0.00
209	600826	兰生股份	140	753.20	0.00
210	000598	兴蓉环境	100	752.00	0.00
211	002080	中材科技	58	748.20	0.00
212	600271	航天信息	100	736.00	0.00
213	000027	深圳能源	100	730.00	0.00
214	600032	浙江新能	100	728.00	0.00
215	002064	华峰化学	100	717.00	0.00
216	002539	云图控股	100	713.00	0.00
217	600177	雅戈尔	100	712.00	0.00
218	600223	福瑞达	100	707.00	0.00
219	002511	中顺洁柔	100	692.00	0.00
220	300638	广和通	40	684.00	0.00
221	600846	同济科技	100	683.00	0.00
222	600901	江苏金租	135	681.75	0.00
223	600330	天通股份	100	680.00	0.00
224	688057	金达莱	66	647.46	0.00
225	603808	歌力思	100	633.00	0.00
226	300806	斯迪克	55	616.00	0.00
227	600064	南京高科	100	607.00	0.00
228	300382	斯莱克	100	591.00	0.00
229	600667	太极实业	100	571.00	0.00
230	688777	中控技术	15	565.50	0.00
231	000541	佛山照明	110	535.70	0.00
232	600497	驰宏锌锗	100	534.00	0.00
233	300088	长信科技	113	531.10	0.00
234	300601	康泰生物	34	530.74	0.00
235	300390	天华新能	30	515.40	0.00
236	600740	山西焦化	130	509.60	0.00
237	000589	贵州轮胎	100	507.00	0.00
237	603866	桃李面包	100	507.00	0.00
238	601077	渝农商行	100	502.00	0.00
239	000090	天健集团	123	494.46	0.00
240	002400	省广集团	100	485.00	0.00
241	000723	美锦能源	100	476.00	0.00

242	603002	宏昌电子	100	469.00	0.00
243	000035	中国天楹	100	453.00	0.00
244	600839	四川长虹	100	449.00	0.00
245	000932	华菱钢铁	100	443.00	0.00
246	000828	东莞控股	49	441.49	0.00
247	600629	华建集团	100	436.00	0.00
248	600908	无锡银行	73	388.36	0.00
249	002573	清新环境	100	387.00	0.00
250	002966	苏州银行	50	375.00	0.00
251	600266	城建发展	100	374.00	0.00
251	601200	上海环境	44	374.00	0.00
252	600105	永鼎股份	100	372.00	0.00
253	002060	广东建工	100	342.00	0.00
254	600383	金地集团	100	340.00	0.00
255	603300	华铁应急	60	327.60	0.00
256	600284	浦东建设	60	320.40	0.00
257	002392	北京利尔	100	315.00	0.00
258	600339	中油工程	100	312.00	0.00
259	002061	浙江交科	80	292.00	0.00
260	601599	浙文影业	100	288.00	0.00
261	002183	怡亚通	100	284.00	0.00
262	601222	林洋能源	45	282.15	0.00
263	600477	杭萧钢构	100	233.00	0.00
264	600236	桂冠电力	30	230.10	0.00
265	601778	晶科科技	100	228.00	0.00
266	600639	浦东金桥	20	204.20	0.00
267	002461	珠江啤酒	25	185.50	0.00
268	000528	柳工	16	179.04	0.00
269	603939	益丰药房	7	171.85	0.00
270	000718	苏宁环球	96	161.28	0.00
271	600933	爱柯迪	10	147.90	0.00
272	600251	冠农股份	20	144.80	0.00
273	605366	宏柏新材	20	116.20	0.00
274	605399	晨光新材	10	107.50	0.00
275	002444	巨星科技	4	98.80	0.00
276	002936	郑州银行	20	34.60	0.00
277	603043	广州酒家	2	31.94	0.00
278	601216	君正集团	6	22.14	0.00
279	600008	首创环保	3	8.04	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(%)
----	------	------	----------	----------------



	码			
1	000333	美的集团	40,822,104.00	4.98
2	600887	伊利股份	34,883,950.00	4.25
3	002049	紫光国微	31,469,541.10	3.84
4	300750	宁德时代	30,701,073.20	3.74
5	000568	泸州老窖	29,883,492.00	3.64
6	601318	中国平安	28,734,746.00	3.50
7	600519	贵州茅台	26,276,487.00	3.20
8	000938	紫光股份	26,194,764.00	3.19
9	002371	北方华创	24,441,601.80	2.98
10	600183	生益科技	24,066,582.42	2.93
11	002271	东方雨虹	23,223,762.45	2.83
12	601012	隆基绿能	23,124,562.00	2.82
13	601808	中海油服	22,778,973.94	2.78
14	601899	紫金矿业	22,767,278.00	2.78
15	601166	兴业银行	22,112,676.00	2.70
16	603799	华友钴业	21,553,512.38	2.63
17	601138	工业富联	21,125,278.00	2.58
18	600900	长江电力	20,812,776.26	2.54
19	600019	宝钢股份	20,510,213.28	2.50
20	600570	恒生电子	19,256,374.00	2.35
21	000001	平安银行	19,141,189.00	2.33
22	601919	中远海控	18,918,153.59	2.31
23	601077	渝农商行	18,688,237.00	2.28
24	600809	山西汾酒	18,461,062.00	2.25
25	601128	常熟银行	18,230,321.28	2.22
26	688012	中微公司	16,903,368.15	2.06
27	300223	北京君正	16,556,220.00	2.02

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	600519	贵州茅台	49,983,522.00	6.09
2	601138	工业富联	32,578,616.00	3.97
3	603799	华友钴业	32,406,946.95	3.95
4	002049	紫光国微	31,804,157.58	3.88
5	000333	美的集团	30,272,658.00	3.69
6	000938	紫光股份	29,173,303.00	3.56
7	600030	中信证券	28,988,255.00	3.53
8	000568	泸州老窖	28,382,416.00	3.46
9	603290	斯达半导	27,043,771.00	3.30
10	600809	山西汾酒	26,356,404.20	3.21

11	000001	平安银行	26,266,402.00	3.20
12	300750	宁德时代	26,242,441.00	3.20
13	600900	长江电力	25,262,625.00	3.08
14	300450	先导智能	24,286,703.00	2.96
15	600887	伊利股份	22,694,833.00	2.77
16	601888	中国中免	22,650,715.00	2.76
17	601012	XD 隆基绿	22,570,700.00	2.75
18	002371	北方华创	22,123,200.16	2.70
19	000063	中兴通讯	21,979,974.00	2.68
20	601077	渝农商行	21,712,326.00	2.65
21	002271	东方雨虹	21,573,485.00	2.63
22	603259	药明康德	21,251,961.01	2.59
23	600183	生益科技	20,939,061.00	2.55
24	300999	金龙鱼	20,507,606.00	2.50
25	300223	北京君正	20,356,730.00	2.48
26	002142	宁波银行	19,765,953.00	2.41
27	000338	潍柴动力	19,721,694.00	2.40
28	002709	天赐材料	19,628,403.00	2.39
29	601166	兴业银行	19,627,744.00	2.39
30	300347	泰格医药	19,156,365.00	2.34
31	002129	TCL 中环	19,141,029.00	2.33
32	600019	宝钢股份	18,904,739.00	2.30
33	601128	常熟银行	18,409,770.00	2.24
34	600570	恒生电子	18,317,914.00	2.23
35	600132	重庆啤酒	17,273,130.00	2.11
36	300122	智飞生物	17,269,470.00	2.11
37	601881	中国银河	17,207,483.00	2.10
38	601898	中煤能源	17,044,300.00	2.08
39	002180	纳思达	16,804,290.42	2.05
40	601901	方正证券	16,791,567.38	2.05

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	2,442,936,571.25
卖出股票收入（成交）总额	2,479,038,816.81

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	32,679,165.48	4.38

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	32,679,165.48	4.38

### 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	019727	23 国债 24	271,000	27,601,090.14	3.70
2	019709	23 国债 16	50,000	5,078,075.34	0.68

### 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交通银行发行主体外，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。

根据国家金融监督管理总局公布的行政处罚信息公开表：

交通银行股份有限公司（简称交通银行）因安全测试存在薄弱环节等案由，于 2024 年 6 月 3 日被国家金融监督管理总局处以罚款。

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	313,413.11
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	450,953.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	764,366.25

### 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	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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	19,893	15,033.17	84,457,648.90	28.24	214,597,237.44	71.76
长城久泰 沪深 300 指数 C	2,816	114,387.51	303,982,321.57	94.37	18,132,908.08	5.63
合计	22,709	27,353.48	388,439,970.47	62.53	232,730,145.52	37.47

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	297,705.92	0.0995
	长城久泰沪深 300 指数 C	53,604.50	0.0166
	合计	351,310.42	0.0566

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	0~10
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10

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	284,368,425.63	380,877,975.61
本报告期基金总申购 份额	180,787,775.01	86,352,896.30
减：本报告期基金总 赎回份额	166,101,314.30	145,115,642.26
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	299,054,886.34	322,115,229.65

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内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	4,921,379,926.06	100.00	1,210,163.68	100.00	-
第一创业	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	-	-	-	-	-
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：

本报告期内华西证券减少 1 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	3,407,954.00	100.00	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
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终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于关闭网上	中国证监会规定报刊及	2024 年 3 月 2 日



	直销交易平台开户、认申购、转换、赎回及新开通定投业务的公告	网站	
3	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展电子直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 26 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 7 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	20240101-20240630	164,264,534.23	-	-	164,264,534.23	26.4444

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

长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日