

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	77
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	77
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	77
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12 投资组合报告附注	78
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议	81
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 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	297,247,369.92 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	281,459,794.02 份	15,787,575.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>(1) 资产配置策略：本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。</p> <p>(2) 股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。</p> <p>(3) 债券投资策略：本基金债券投资部分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。</p>
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	姓名	祝函	张姗
	联系电话	0755-29279006	400-61-95555

人	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	长城久泰 沪深 300 指数 A	长城久泰 沪深 300 指数 C	长城久泰 沪深 300 指数 A	长城久泰 沪深 300 指数 C	长城久泰 沪深 300 指数 A	长城久泰 沪深 300 指数 C
本期已实现收益	- 10,084,49 4.43	- 33,884,63 9.32	- 64,840,34 2.43	- 55,364,56 6.88	- 141,634,9 30.91	- 116,158,1 97.19
本期利润	27,485,01 5.90	9,515,916 .10	- 73,865,04 4.68	- 73,231,95 3.31	- 153,726,6 16.55	- 145,106,2 25.79
加权平均 基金份额 本期利润	0.0880	0.0365	-0.2459	-0.1540	-0.5114	-0.4347

本期加权平均净值利润率	5.46%	4.24%	-13.24%	-15.23%	-24.36%	-32.74%
本期基金份额净值增长率	2.29%	1.96%	-13.50%	-13.75%	-21.60%	-21.93%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	71,741,861.79	-1,191,178.51	77,025,491.04	-35,534,560.19	155,556,972.57	27,139,227.71
期末可供分配基金份额利润	0.2549	-0.0755	0.2709	-0.0933	0.4946	0.0513
期末基金资产净值	480,912,947.39	14,596,397.39	474,994,808.90	345,343,415.42	607,306,277.55	555,693,393.32
期末基金份额净值	1.7086	0.9245	1.6704	0.9067	1.9310	1.0513
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	342.04%	18.64%	332.16%	16.35%	399.58%	34.91%

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
过去三个月	-3.89%	1.61%	-1.92%	1.65%	-1.97%	-0.04%

过去六个月	8.35%	1.49%	13.05%	1.58%	-4.70%	-0.09%
过去一年	2.29%	1.32%	14.04%	1.27%	-11.75%	0.05%
过去三年	-30.63%	1.15%	-19.20%	1.12%	-11.43%	0.03%
过去五年	-9.06%	1.19%	-3.23%	1.17%	-5.83%	0.02%
自基金合同 生效起至今	342.04%	1.51%	248.30%	1.51%	93.74%	0.00%

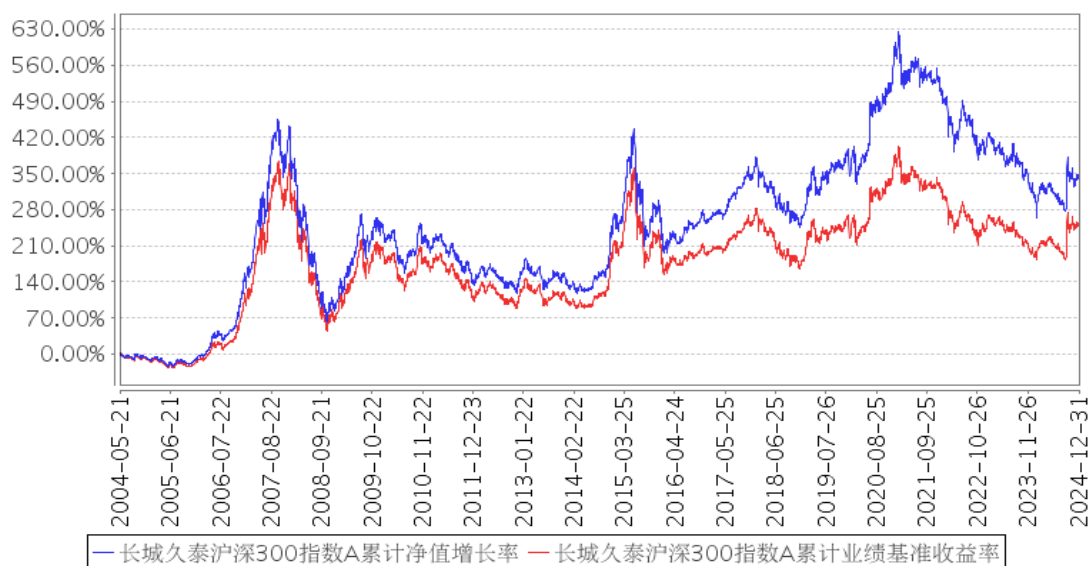
长城久泰沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.98%	1.61%	-1.92%	1.65%	-2.06%	-0.04%
过去六个月	8.17%	1.49%	13.05%	1.58%	-4.88%	-0.09%
过去一年	1.96%	1.32%	14.04%	1.27%	-12.08%	0.05%
过去三年	-31.34%	1.15%	-19.20%	1.12%	-12.14%	0.03%
过去五年	-10.66%	1.19%	-3.23%	1.17%	-7.43%	0.02%
自基金合同 生效起至今	18.64%	1.19%	25.82%	1.17%	-7.18%	0.02%

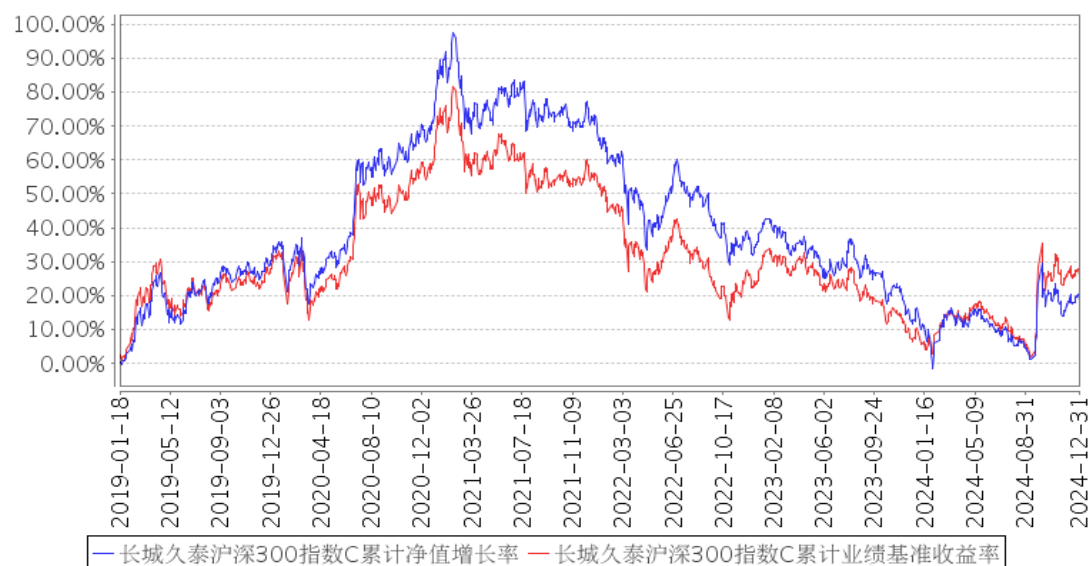
注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

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

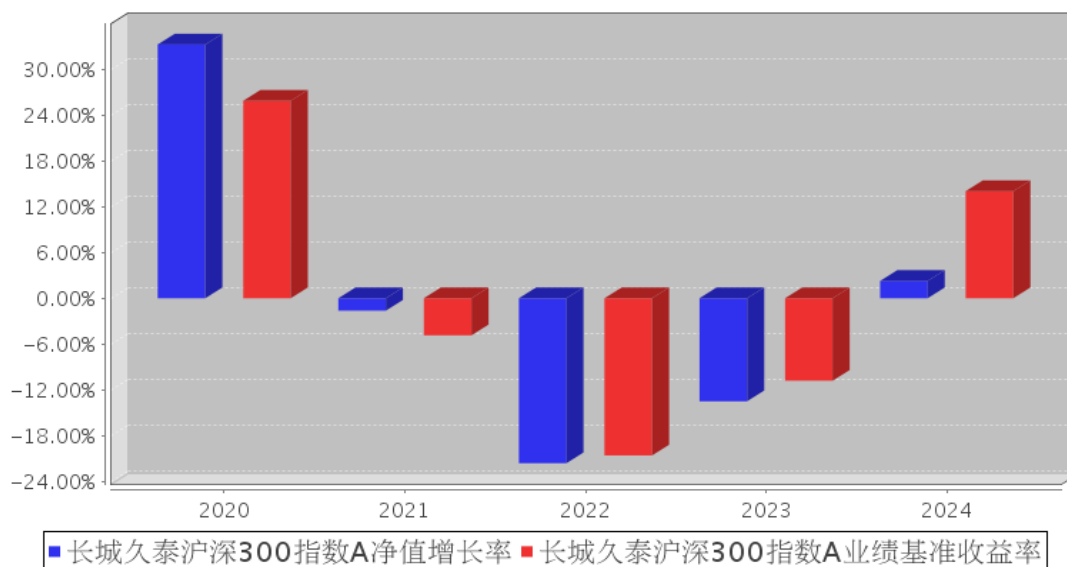


注：①本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的90%~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

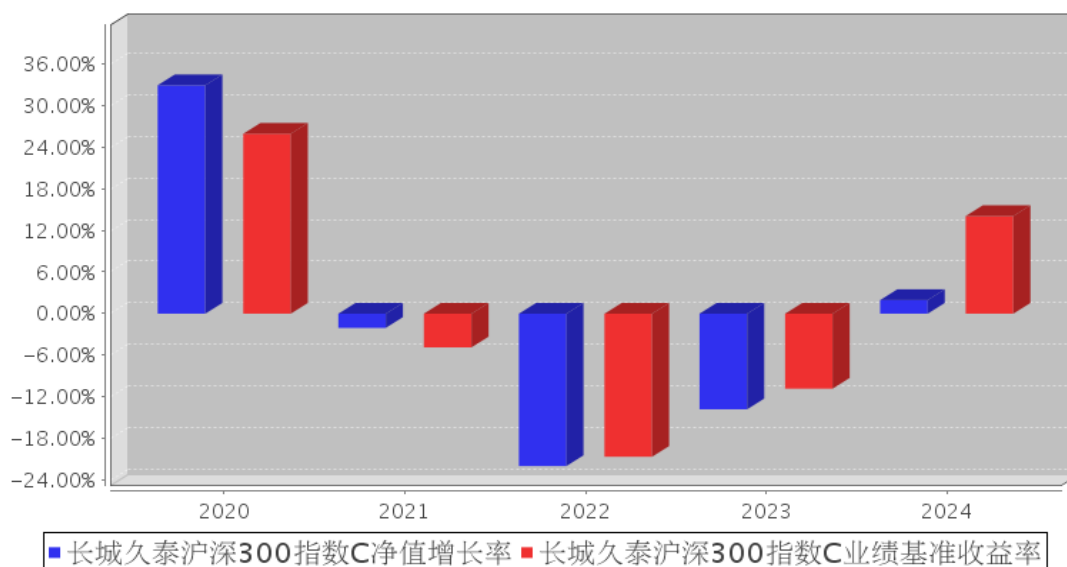
②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城久泰沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城久泰沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	2.3760	80,359,716.24	35,359,592.27	115,719,308.51	-
合计	2.3760	80,359,716.24	35,359,592.27	115,719,308.51	-

§ 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，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，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 12 月 31 日，公司旗下共管理 109 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

					<p>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。</p>
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	<p>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</p>

					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，自 2024 年 11 月至今任“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”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

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3 日内、5 日内、7 日内、9 日内、11 日内、13 日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年权益股票波动率明显放大，债券市场表现更好。A 股主要指数大致分为三个阶段：一是年初市场全面下跌导致微小市值个股流动性风险凸显；二是春节后市场阶段修复到持续走低；三是三季度末政策驱动下显著反弹到年底振荡。风格方面，以沪深 300 为代表的大市值指数显著优于中证 1000 等小盘指数；交易结构看，年度内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，无论是向上还是向下波动率多次出现突然放大，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。

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。全年超额收益延续了股市三阶段影响，第一第三阶段超额回撤较大，第二阶段超额收益有所回归，总体全年未能战胜业绩基准。考虑到个股受政策和交易风格影响，模型做了一些更加细致的风险控制与调整。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，从组合相对基准稳健的角度，增加了多策略配置部分，降低单一策略风险，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 基金份额净值为 1.7086 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.29%，同期业绩比较基准收益率为 14.04%；

截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额净值为 0.9245 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.96%, 同期业绩比较基准收益率为 14.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近年来出台了新“国九条”等一系列的政策,对于资本市场而言,这些政策更多着眼于长期制度建设与高质量发展,需要一定时间消化与吸收。总体来看,A股市场定价效率提升、机构投资者参与度提高大趋势已经形成,作为量化投资策略,从构建层面未来需要综合考虑长期政策与交易结构的变化,引入更多锚定市场长逻辑的有效因子。

另一方面,硬科技与内需将是未来经济发展两个重要支点。人工智能带来的效率提升将逐步渗透到服务业、制造业等细分领域,有望形成一轮新的产业革命;如果市场重心逐渐转向内需后经济复苏提速,与传统经济相关度高的大盘宽基指数也将受益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则,进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程,认真执行了各项管理制度,有效实施了三层风险防范和控制措施,建立了比较完善的内部控制体系。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关基金经理及研究员、基金会计等岗位资深人员组成，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70015735_H03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不

	<p>涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3） 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4） 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对长城久泰沪深 300 指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城久泰沪深 300 指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5） 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国北京	
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	29,429,011.66	11,538,661.93
结算备付金		1,928,476.24	2,279,347.83
存出保证金		326,151.36	236,689.54
交易性金融资产	7.4.7.2	475,146,010.97	809,278,261.86
其中：股票投资		468,982,076.31	775,303,129.39
基金投资		-	-
债券投资		6,163,934.66	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	5,177,927.01
应收股利		-	-
应收申购款		78,079.83	402,963.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		506,907,730.06	828,913,851.28
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,866,142.36	6,298,497.57
应付赎回款		482,287.09	786,195.81
应付管理人报酬		411,820.16	721,384.51
应付托管费		84,044.92	147,221.34
应付销售服务费		4,047.26	101,525.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.03	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	550,043.46	520,802.12
负债合计		11,398,385.28	8,575,626.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	297,247,369.92	665,246,401.24
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	198,261,974.86	155,091,823.08
净资产合计		495,509,344.78	820,338,224.32
负债和净资产总计		506,907,730.06	828,913,851.28

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 297,247,369.92 份，其中长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额总额 281,459,794.02 份，基金份额净值 1.7086 元；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额总额 15,787,575.90 份，基金份额净值 0.9245 元。

7.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		46,531,764.28	-133,151,520.03
1. 利息收入		134,931.43	207,203.39
其中：存款利息收入	7.4.7.13	134,931.43	207,203.39
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）		-35,111,995.79	-106,581,768.22
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-57,307,993.75	-128,084,909.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	555,729.17	350,394.52
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	21,640,268.79	21,152,746.38
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）	7.4.7.20	80,970,065.75	-26,892,088.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	538,762.89	115,133.48
减：二、营业总支出		9,530,832.28	13,945,477.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,200,721.36	10,218,687.51
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,469,534.96	2,085,446.51
3. 销售服务费		684,119.32	1,449,107.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	6,906.71
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,906.71
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.41
8. 其他费用	7.4.7.23	176,456.61	185,329.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,000,932.00	-147,096,997.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,000,932.00	-147,096,997.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37,000,932.00	-147,096,997.99

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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)	-	-	43,170,151.78	-324,828,879.54
(一)、综合收益总额	-	-	37,000,932.00	37,000,932.00
(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)	-	-	6,169,219.78	-361,829,811.54
其中：1. 基金申购款	377,911,917.18	-	133,611,203.66	511,523,120.84
2. 基金赎回款	-	-	-	-873,352,932.38
(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	297,247,369.92	-	198,261,974.86	495,509,344.78
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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)	-	-	-	-342,661,446.55
	177,810,317.57		164,851,128.98	
(一)、综合收益总额	-	-	-	-147,096,997.99
			147,096,997.99	
(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)	-	-	-17,754,130.99	-195,564,448.56
	177,810,317.57			
其中：1. 基金申购款	199,953,990.19	-	8,897,086.52	208,851,076.71
2. 基金赎回款	-	-	-26,651,217.51	-404,415,525.27
	377,764,307.76			
(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	665,246,401.24	-	155,091,823.08	820,338,224.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邱春杨

何小乐

李志朋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

根据 2019 年 1 月 18 日《关于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 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 300A 类和长城久泰沪深 300C 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%×中信标普 300 指数收益率+5%×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%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期

工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量

持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该

部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 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征增值税试点的通知》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附加。

(2) 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[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。

(3) 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，（如有）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，（如有）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。

(4) 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%，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	29,429,011.66	11,538,661.93
等于：本金	29,425,635.94	11,537,240.07
加：应计利息	3,375.72	1,421.86
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	29,429,011.66	11,538,661.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	454,165,440.21	-	468,982,076.31	14,816,636.10
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	6,127,635.00	50,234.66	6,163,934.66	-13,935.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,127,635.00	50,234.66	6,163,934.66	-13,935.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		460,293,075.21	50,234.66	475,146,010.97	14,802,701.10
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		841,503,194.04	-	775,303,129.39	- 66,200,064.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	33,708,070.00	234,362.47	33,975,132.47	32,700.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	33,708,070.00	234,362.47	33,975,132.47	32,700.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		875,211,264.04	234,362.47	809,278,261.86	- 66,167,364.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,872.27	1,356.84
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	497,171.19	459,445.28
其中：交易所市场	497,171.19	459,445.28
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	50,000.00	60,000.00
合计	550,043.46	520,802.12

7.4.7.10 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 12 月 31 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	250,789,150.93	250,789,150.93
本期赎回（以“-”号填列）	-253,697,782.54	-253,697,782.54
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	281,459,794.02	281,459,794.02

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	127,122,766.25	127,122,766.25
本期赎回（以“-”号填列）	-492,213,165.96	-492,213,165.96
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	15,787,575.90	15,787,575.90

注：本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	-10,084,494.43	37,569,510.33	27,485,015.90
本期基金份额交易产生的变动数	4,800,865.18	-23,459,110.98	-18,658,245.80
其中：基金申购款	46,249,072.29	102,416,146.70	148,665,218.99

基金赎回款	-41,448,207.11	-125,875,257.68	-167,323,464.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	71,741,861.79	127,711,291.58	199,453,153.37

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	-	-	-
本期初	12,948,703.55	-48,483,263.74	-35,534,560.19
本期利润	-33,884,639.32	43,400,555.42	9,515,916.10
本期基金份额交易产生的变动数	21,288,647.06	3,538,818.52	24,827,465.58
其中：基金申购款	-5,843,003.72	-9,211,011.61	-15,054,015.33
基金赎回款	27,131,650.78	12,749,830.13	39,881,480.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	352,711.29	-1,543,889.80	-1,191,178.51

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	79,626.54	154,979.08
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	50,656.56	48,652.41
其他	4,648.33	3,571.90
合计	134,931.43	207,203.39

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-57,307,993.75	-128,084,909.12
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	-57,307,993.75	-128,084,909.12

7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	5,526,450,056.45	4,710,358,300.56
减：卖出股票成本总额	5,577,962,506.81	4,831,616,620.57
减：交易费用	5,795,543.39	6,826,589.11
买卖股票差价收入	-57,307,993.75	-128,084,909.12

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
债券投资收益——利息收入	563,398.10	270,843.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,668.93	79,551.34
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	555,729.17	350,394.52

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,294,237.89	28,259,243.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,384,024.00	27,647,169.00
减：应计利息总额	917,879.76	532,502.28
减：交易费用	3.06	21.09
买卖债券差价收入	-7,668.93	79,551.34

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	21,640,268.79	21,152,746.38
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	21,640,268.79	21,152,746.38

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	80,970,065.75	-26,892,088.68
股票投资	81,016,700.75	-26,949,007.68
债券投资	-46,635.00	56,919.00
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	80,970,065.75	-26,892,088.68

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	538,762.89	115,133.48
合计	538,762.89	115,133.48

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	6,456.61	5,329.40
合计	176,456.61	185,329.40

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司（“中原信托”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

注：注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
-------	--	---

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
长城证券	4,921,379,926.06	45.93	9,234,906,860.74	100.00
东方证券	105,660,915.60	0.99	-	-

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
长城证券	3,407,954.00	14.25	37,227,623.71	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
长城证券	-	-	91,850,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	20,699.25	0.88	3,617.47	0.73
长城证券	1,210,163.68	51.60	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	2,179,022.77	100.00	459,445.28	100.00

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）本基金本报告期内 1-6 月佣金协议的服务范围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等（上年度可比期间：同）。

（3）自 2024 年 7 月 1 日起，本基金的股票交易佣金费率不超过中国证券业协会对外通报的市场平均股票交易佣金费率，不通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,200,721.36	10,218,687.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,890,241.25	1,966,732.89
应支付基金管理人的净管理费	5,310,480.11	8,251,954.62

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

$$H = E \times 0.98\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,469,534.96	2,085,446.51

注：注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

关联方名称	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	-	94,181.11	94,181.11
招商银行	-	146,676.60	146,676.60
合计	-	240,857.71	240,857.71
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	850,282.83	850,282.83
招商银行	-	22,754.46	22,754.46
合计	-	873,037.29	873,037.29

注：基金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%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算公式如下：

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	29,429,011.66	79,626.54	11,538,661.93	154,979.08

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股锁定	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股锁定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股锁定	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-

301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股锁定	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	6个月	新股锁定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股锁定	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股锁定	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603091	众鑫股份	2024年9月10日	6个月	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603395	红四方	2024年11月19日	6个月	新股锁定	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688615	合合信息	2024年9月19日	6个月	新股锁定	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	6个月	新股锁定	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-

688710	益诺思	2024年8月27日	6个月	新股锁定	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	6个月	新股锁定	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据证券上市公告书估算的流通日期，最终可流通日期以证券解禁上市流通的公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024年12月20日	重大事项	35.20	2025年01月07日	30.60	128	4,035.02	4,505.60	-
002252	上海莱士	2024年12月20日	重大事项	7.22	2025年01月07日	6.93	100	753.09	722.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，

通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量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货币资金、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账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	29,429,011.66	-	-	-	-	-	29,429,011.66
结算备付金	1,928,476.24	-	-	-	-	-	1,928,476.24
存出保证金	326,151.36	-	-	-	-	-	326,151.36
交易性金融资产	-	-	6,163,934.66	-	-	-468,982,076.31	475,146,010.97
应收申购款	-	-	-	-	-	78,079.83	78,079.83
资产总计	31,683,639.26	-	6,163,934.66	-	-	-469,060,156.14	506,907,730.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	482,287.09	482,287.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	411,820.16	411,820.16
应付托管费	-	-	-	-	-	84,044.92	84,044.92
应付清算款	-	-	-	-	-	9,866,142.36	9,866,142.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,047.26	4,047.26

应交税费	-	-	-	-	-	0.03	0.03
其他负债	-	-	-	-	-	550,043.46	550,043.46
负债总计	-	-	-	-	-	11,398,385.28	11,398,385.28
利率敏感度缺口	31,683,639.26	-	6,163,934.66	-	-		
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	-	-		

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	7,181.68	56,107.26
市场利率上升 25 个基点	-7,161.80	-55,891.77	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	468,982,076.31	94.65	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	6,163,934.66	1.24	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	475,146,010.97	95.89	809,278,261.86	98.65

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	24,295,616.46	41,564,000.77
沪深 300 指数下降 5%	-24,295,616.46	-41,564,000.77	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	468,696,338.03	774,808,573.28
第二层次	6,196,898.76	33,976,234.87
第三层次	252,774.18	493,453.71
合计	475,146,010.97	809,278,261.86

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	493,453.71	493,453.71
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	84,931.97	84,931.97
转出第三层次	-	279,333.19	279,333.19
当期利得或损失总额	-	-46,278.31	-46,278.31
其中：计入损益的利得或损失	-	-46,278.31	-46,278.31
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	252,774.18	252,774.18
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	160,987.40	160,987.40
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	200,069.36	200,069.36
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	433,217.07	433,217.07
转出第三层次	-	404,795.72	404,795.72
当期利得或损失总额	-	264,963.00	264,963.00
其中：计入损益的利得或损失	-	264,963.00	264,963.00

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	493,453.71	493,453.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	115,442.48	115,442.48

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	252,774.18	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3521~4.9648	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	493,453.71	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	468,982,076.31	92.52
	其中：股票	468,982,076.31	92.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,163,934.66	1.22

	其中：债券	6,163,934.66	1.22
	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	31,357,487.90	6.19
8	其他各项资产	404,231.19	0.08
9	合计	506,907,730.06	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	988,544.24	0.20
B	采矿业	15,699,072.26	3.17
C	制造业	230,050,493.68	46.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,589,901.16	1.73
E	建筑业	5,675,799.18	1.15
F	批发和零售业	3,629,997.60	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	16,051,459.66	3.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,850,940.60	0.58
J	金融业	116,207,001.94	23.45
K	房地产业	3,841.28	-
L	租赁和商务服务业	9,666.83	-
M	科学研究和技术服务业	21,503.38	-
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	1,510.50	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	399,779,732.31	80.68
--	----	----------------	-------

8.2.2 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	6,239.80	0.00
B	采矿业	5,644,339.05	1.14
C	制造业	33,956,923.10	6.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,098,858.44	1.03
E	建筑业	12,374.03	0.00
F	批发和零售业	1,761,081.41	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,681,709.67	0.34
H	住宿和餐饮业	4,432,684.48	0.89
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,914,026.37	0.59
J	金融业	6,728,125.79	1.36
K	房地产业	1,556,502.32	0.31
L	租赁和商务服务业	1,503,248.80	0.30
M	科学研究和技术服务业	18,928.08	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,879,475.61	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,827.05	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,202,344.00	13.97

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	300750	宁德时代	85,548	22,755,768.00	4.59
2	601318	中国平安	360,193	18,964,161.45	3.83
3	600519	贵州茅台	10,022	15,273,528.00	3.08
4	600036	招商银行	286,288	11,251,118.40	2.27
5	688981	中芯国际	114,384	10,823,014.08	2.18
6	000333	美的集团	143,521	10,795,649.62	2.18
7	601088	中国神华	237,700	10,335,196.00	2.09
8	601319	中国人保	1,346,183	10,257,914.46	2.07
9	601601	中国太保	299,034	10,191,078.72	2.06
10	601919	中远海控	648,640	10,053,920.00	2.03
11	601398	工商银行	1,227,300	8,492,916.00	1.71
12	300408	三环集团	216,400	8,333,564.00	1.68
13	605499	东鹏饮料	33,480	8,320,449.60	1.68
14	300274	阳光电源	112,640	8,316,211.20	1.68
15	603288	海天味业	180,040	8,263,836.00	1.67
16	601138	工业富联	378,394	8,135,471.00	1.64
17	601628	中国人寿	189,784	7,955,745.28	1.61
18	600019	宝钢股份	1,134,329	7,940,303.00	1.60
19	300433	蓝思科技	361,041	7,906,797.90	1.60
20	688009	中国通号	1,133,004	7,092,605.04	1.43
21	300394	天孚通信	76,500	6,989,040.00	1.41
22	000895	双汇发展	250,200	6,495,192.00	1.31
23	601766	中国中车	744,300	6,237,234.00	1.26
24	600018	上港集团	975,700	5,971,284.00	1.21
25	000538	云南白药	90,300	5,413,485.00	1.09
26	600919	江苏银行	546,461	5,366,247.02	1.08
27	600015	华夏银行	635,079	5,086,982.79	1.03
28	600183	生益科技	209,882	5,047,662.10	1.02
29	600000	浦发银行	488,732	5,029,052.28	1.01
30	600660	福耀玻璃	79,043	4,932,283.20	1.00
31	600219	南山铝业	1,248,096	4,880,055.36	0.98
32	601229	上海银行	523,800	4,792,770.00	0.97
33	601288	农业银行	897,331	4,791,747.54	0.97
34	000999	华润三九	102,400	4,540,416.00	0.92
35	600900	长江电力	148,147	4,377,743.85	0.88
36	600028	中国石化	641,480	4,285,086.40	0.86
37	600926	杭州银行	287,622	4,202,157.42	0.85
38	600803	新奥股份	193,745	4,200,391.60	0.85
39	600016	民生银行	1,015,885	4,195,605.05	0.85
40	601127	赛力斯	31,100	4,148,429.00	0.84
41	600066	宇通客车	155,200	4,094,176.00	0.83
42	601988	中国银行	736,958	4,060,638.58	0.82
43	688169	石头科技	18,288	4,010,375.52	0.81

44	600436	片仔癀	18,650	4,000,425.00	0.81
45	300308	中际旭创	32,200	3,977,022.00	0.80
46	600346	恒力石化	250,454	3,844,468.90	0.78
47	000166	申万宏源	718,000	3,841,300.00	0.78
48	601336	新华保险	76,259	3,790,072.30	0.76
49	002601	龙佰集团	205,800	3,636,486.00	0.73
50	601607	上海医药	172,600	3,624,600.00	0.73
51	688396	华润微	75,814	3,577,662.66	0.72
52	600332	白云山	125,600	3,569,552.00	0.72
53	601117	中国化学	424,852	3,522,023.08	0.71
54	688012	中微公司	18,203	3,443,279.48	0.69
55	601633	长城汽车	127,900	3,367,607.00	0.68
56	600196	复星医药	131,100	3,257,835.00	0.66
57	600600	青岛啤酒	38,500	3,115,420.00	0.63
58	688303	大全能源	123,065	2,970,789.10	0.60
59	601688	华泰证券	147,753	2,598,975.27	0.52
60	000725	京东方 A	511,164	2,244,009.96	0.45
61	601668	中国建筑	357,915	2,147,490.00	0.43
62	601728	中国电信	194,000	1,400,680.00	0.28
63	002371	北方华创	2,986	1,167,526.00	0.24
64	600188	兖矿能源	74,520	1,055,948.40	0.21
65	002938	鹏鼎控股	27,600	1,006,848.00	0.20
66	603799	华友钴业	31,651	926,108.26	0.19
67	603019	中科曙光	9,800	708,736.00	0.14
68	688111	金山办公	1,841	527,243.99	0.11
69	002050	三花智控	21,800	512,518.00	0.10
70	000938	紫光股份	18,374	511,348.42	0.10
71	000977	浪潮信息	9,796	508,216.48	0.10
72	000651	格力电器	11,100	504,495.00	0.10
73	600690	海尔智家	17,695	503,776.65	0.10
74	002714	牧原股份	12,914	496,414.16	0.10
75	300498	温氏股份	29,808	492,130.08	0.10
76	000001	平安银行	41,800	489,060.00	0.10
77	002230	科大讯飞	10,100	488,032.00	0.10
78	300033	同花顺	1,600	460,000.00	0.09
79	002179	中航光电	11,300	444,090.00	0.09
80	600760	中航沈飞	8,508	431,525.76	0.09
81	300999	金龙鱼	10,900	355,449.00	0.07
82	300059	东方财富	13,295	343,276.90	0.07
83	600570	恒生电子	5,992	167,716.08	0.03
84	600588	用友网络	13,617	146,110.41	0.03
85	300442	润泽科技	1,600	83,136.00	0.02
86	300760	迈瑞医疗	168	42,840.00	0.01

87	600809	山西汾酒	160	29,473.60	0.01
88	002594	比亚迪	100	28,266.00	0.01
89	688041	海光信息	173	25,913.67	0.01
90	300896	爱美客	140	25,550.00	0.01
91	000858	五粮液	174	24,366.96	0.00
92	000596	古井贡酒	136	23,568.80	0.00
93	603501	韦尔股份	185	19,315.85	0.00
94	688036	传音控股	197	18,715.00	0.00
95	688271	联影医疗	138	17,443.20	0.00
96	300979	华利集团	194	15,258.10	0.00
97	000568	泸州老窖	107	13,396.40	0.00
98	601799	星宇股份	100	13,348.00	0.00
99	603195	公牛集团	184	12,924.16	0.00
100	002916	深南电路	100	12,500.00	0.00
101	600941	中国移动	100	11,816.00	0.00
102	603392	万泰生物	167	11,766.82	0.00
103	300502	新易盛	100	11,558.00	0.00
104	002920	德赛西威	100	11,011.00	0.00
105	000661	长春高新	110	10,938.40	0.00
106	002049	紫光国微	162	10,427.94	0.00
107	600309	万华化学	143	10,203.05	0.00
108	688082	盛美上海	100	10,000.00	0.00
109	603259	药明康德	175	9,632.00	0.00
110	002304	洋河股份	115	9,605.95	0.00
111	605117	德业股份	112	9,497.60	0.00
112	300661	圣邦股份	116	9,486.48	0.00
113	603260	合盛硅业	162	9,000.72	0.00
114	300782	卓胜微	100	8,970.00	0.00
115	300347	泰格医药	159	8,684.58	0.00
116	601689	拓普集团	177	8,673.00	0.00
117	603833	欧派家居	121	8,341.74	0.00
118	300124	汇川技术	140	8,201.20	0.00
119	600276	恒瑞医药	166	7,619.40	0.00
120	601021	春秋航空	127	7,324.09	0.00
121	300418	昆仑万维	190	7,311.20	0.00
122	002028	思源电气	100	7,270.00	0.00
123	603296	华勤技术	100	7,095.00	0.00
124	300832	新产业	100	7,085.00	0.00
125	601888	中国中免	104	6,969.04	0.00
126	601100	恒立液压	132	6,965.64	0.00
127	002460	赣锋锂业	180	6,301.80	0.00
128	688187	时代电气	131	6,277.52	0.00
129	603369	今世缘	136	6,151.28	0.00

130	002466	天齐锂业	185	6,105.00	0.00
131	002311	海大集团	124	6,082.20	0.00
132	002463	沪电股份	150	5,947.50	0.00
133	600085	同仁堂	136	5,520.24	0.00
134	000786	北新建材	180	5,455.80	0.00
135	000963	华东医药	156	5,397.60	0.00
136	600893	航发动力	126	5,222.70	0.00
137	600845	宝信软件	162	4,740.12	0.00
138	300316	晶盛机电	148	4,721.20	0.00
139	300014	亿纬锂能	100	4,674.00	0.00
140	601225	陕西煤业	199	4,628.74	0.00
141	300413	芒果超媒	170	4,571.30	0.00
142	600406	国电南瑞	175	4,413.50	0.00
143	600584	长电科技	104	4,249.44	0.00
144	000408	藏格矿业	150	4,159.50	0.00
145	600887	伊利股份	136	4,104.48	0.00
146	002475	立讯精密	100	4,076.00	0.00
147	000063	中兴通讯	100	4,040.00	0.00
148	002352	顺丰控股	100	4,030.00	0.00
149	601877	正泰电器	171	4,003.11	0.00
150	600547	山东黄金	176	3,982.88	0.00
151	002001	新和成	178	3,910.66	0.00
152	600009	上海机场	112	3,824.80	0.00
153	002648	卫星化学	199	3,739.21	0.00
154	002709	天赐材料	189	3,727.08	0.00
155	600150	中国船舶	100	3,596.00	0.00
156	002180	纳思达	124	3,493.08	0.00
157	300122	智飞生物	131	3,445.30	0.00
158	601995	中金公司	100	3,369.00	0.00
159	002812	恩捷股份	100	3,199.00	0.00
160	002415	海康威视	104	3,192.80	0.00
161	300759	康龙化成	124	3,186.80	0.00
162	600161	天坛生物	155	3,177.50	0.00
163	600030	中信证券	108	3,150.36	0.00
164	600031	三一重工	191	3,147.68	0.00
165	600111	北方稀土	148	3,140.56	0.00
166	002422	科伦药业	100	2,993.00	0.00
167	600886	国投电力	178	2,958.36	0.00
168	600938	中国海油	100	2,951.00	0.00
169	002142	宁波银行	120	2,917.20	0.00
170	603659	璞泰来	180	2,863.80	0.00
171	000768	中航西飞	100	2,824.00	0.00
172	601166	兴业银行	146	2,797.36	0.00

173	001965	招商公路	196	2,734.20	0.00
174	600460	士兰微	100	2,602.00	0.00
175	600426	华鲁恒升	120	2,593.20	0.00
176	002241	歌尔股份	100	2,581.00	0.00
177	601066	中信建投	100	2,575.00	0.00
178	600104	上汽集团	124	2,574.24	0.00
179	600741	华域汽车	146	2,571.06	0.00
180	688126	沪硅产业	136	2,559.52	0.00
181	601899	紫金矿业	164	2,479.68	0.00
182	600482	中国动力	100	2,447.00	0.00
183	300450	先导智能	122	2,442.44	0.00
184	600160	巨化股份	100	2,412.00	0.00
185	600585	海螺水泥	100	2,378.00	0.00
186	600999	招商证券	124	2,375.84	0.00
187	600674	川投能源	136	2,346.00	0.00
188	600089	特变电工	180	2,293.20	0.00
189	601838	成都银行	134	2,292.74	0.00
190	600438	通威股份	100	2,211.00	0.00
191	000708	中信特钢	190	2,167.90	0.00
192	601878	浙商证券	175	2,142.00	0.00
193	002074	国轩高科	100	2,122.00	0.00
194	000807	云铝股份	154	2,083.62	0.00
195	600362	江西铜业	100	2,064.00	0.00
196	601698	中国卫通	100	2,040.00	0.00
197	601881	中国银河	133	2,025.59	0.00
198	601211	国泰君安	107	1,995.55	0.00
199	688599	天合光能	103	1,987.90	0.00
200	000625	长安汽车	148	1,977.28	0.00
201	601865	福莱特	100	1,969.00	0.00
202	002271	东方雨虹	150	1,947.00	0.00
203	601009	南京银行	181	1,927.65	0.00
204	002459	晶澳科技	137	1,883.75	0.00
205	000776	广发证券	112	1,815.52	0.00
206	601788	光大证券	100	1,811.00	0.00
207	601898	中煤能源	142	1,729.56	0.00
208	002236	大华股份	106	1,696.00	0.00
209	002007	华兰生物	100	1,685.00	0.00
210	600989	宝丰能源	100	1,684.00	0.00
211	601012	隆基绿能	106	1,665.26	0.00
212	002129	TCL 中环	187	1,658.69	0.00
213	600958	东方证券	156	1,647.36	0.00
214	000792	盐湖股份	100	1,646.00	0.00
215	600875	东方电气	100	1,589.00	0.00

216	601238	广汽集团	169	1,578.46	0.00
217	001289	龙源电力	100	1,571.00	0.00
218	603806	福斯特	106	1,568.80	0.00
219	601699	潞安环能	109	1,565.24	0.00
220	002555	三七互娱	100	1,564.00	0.00
221	600377	宁沪高速	100	1,531.00	0.00
222	601808	中海油服	100	1,525.00	0.00
223	300015	爱尔眼科	114	1,510.50	0.00
224	601059	信达证券	100	1,498.00	0.00
225	000301	东方盛虹	182	1,494.22	0.00
226	000157	中联重科	200	1,446.00	0.00
227	600233	圆通速递	100	1,419.00	0.00
228	600176	中国巨石	122	1,389.58	0.00
229	601186	中国铁建	151	1,384.67	0.00
230	000338	潍柴动力	100	1,370.00	0.00
231	002493	荣盛石化	150	1,357.50	0.00
232	002027	分众传媒	193	1,356.79	0.00
233	600415	小商品城	100	1,341.00	0.00
234	601006	大秦铁路	195	1,322.10	0.00
235	000002	万 科 A	181	1,314.06	0.00
236	300628	亿联网络	34	1,312.40	0.00
237	601857	中国石油	144	1,287.36	0.00
238	600372	中航机载	100	1,233.00	0.00
239	600489	中金黄金	100	1,203.00	0.00
240	601939	建设银行	136	1,195.44	0.00
241	600026	中远海能	100	1,160.00	0.00
242	601800	中国交建	111	1,159.95	0.00
243	600048	保利发展	127	1,125.22	0.00
244	002736	国信证券	100	1,120.00	0.00
245	600837	海通证券	100	1,112.00	0.00
246	601390	中国中铁	174	1,111.86	0.00
247	601872	招商轮船	167	1,070.47	0.00
248	601985	中国核电	100	1,043.00	0.00
249	601360	三六零	100	1,035.00	0.00
250	601600	中国铝业	140	1,029.00	0.00
251	001979	招商蛇口	100	1,024.00	0.00
252	600039	四川路桥	140	1,019.20	0.00
253	601901	方正证券	120	999.60	0.00
254	000425	徐工机械	126	999.18	0.00
255	688223	晶科能源	137	974.07	0.00
256	000876	新 希 望	100	898.00	0.00
257	601669	中国电建	162	884.52	0.00
258	601328	交通银行	113	878.01	0.00

259	601236	红塔证券	100	849.00	0.00
260	600795	国电电力	182	833.56	0.00
261	000983	山西焦煤	100	824.00	0.00
262	000800	一汽解放	100	820.00	0.00
263	601111	中国国航	100	791.00	0.00
264	600061	国投资本	104	782.08	0.00
265	600023	浙能电力	135	764.10	0.00
266	601377	兴业证券	119	744.94	0.00
267	601998	中信银行	105	732.90	0.00
268	601169	北京银行	119	731.85	0.00
269	002252	上海莱士	100	722.00	0.00
270	000617	中油资本	100	689.00	0.00
271	600011	华能国际	100	677.00	0.00
272	603993	洛阳钼业	100	665.00	0.00
273	600918	中泰证券	100	657.00	0.00
274	000100	TCL 科技	130	653.90	0.00
275	600029	南方航空	100	649.00	0.00
276	688008	澜起科技	9	611.10	0.00
277	600905	三峡能源	137	598.69	0.00
278	601658	邮储银行	100	568.00	0.00
279	600027	华电国际	100	561.00	0.00
280	600050	中国联通	100	531.00	0.00
281	601818	光大银行	127	491.49	0.00
282	601989	中国重工	100	481.00	0.00
283	003816	中国广核	100	413.00	0.00
284	600115	中国东航	100	400.00	0.00
285	601868	中国能建	170	389.30	0.00
286	600515	海南机场	100	378.00	0.00
287	601618	中国中冶	102	336.60	0.00
288	601916	浙商银行	100	291.00	0.00
289	600010	包钢股份	100	186.00	0.00

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002128	电投能源	265,200	5,192,616.00	1.05
2	002186	全聚德	332,500	3,857,000.00	0.78
3	601577	长沙银行	348,100	3,094,609.00	0.62
4	002423	中粮资本	221,400	2,964,546.00	0.60
5	300529	健帆生物	99,900	2,931,066.00	0.59
6	300207	欣旺达	130,302	2,907,037.62	0.59
7	300735	光弘科技	89,200	2,496,708.00	0.50
8	002281	光迅科技	44,800	2,337,216.00	0.47

9	300070	碧水源	427,100	2,161,126.00	0.44
10	600642	申能股份	206,000	1,954,940.00	0.39
11	600582	天地科技	300,100	1,854,618.00	0.37
12	600637	东方明珠	228,600	1,773,936.00	0.36
13	600648	外高桥	146,600	1,746,006.00	0.35
14	002911	佛燃能源	137,690	1,740,401.60	0.35
15	603568	伟明环保	79,300	1,715,259.00	0.35
16	300627	华测导航	40,100	1,676,180.00	0.34
17	600862	中航高科	65,900	1,664,634.00	0.34
18	601018	宁波港	430,300	1,656,655.00	0.33
19	000967	盈峰环境	325,400	1,617,238.00	0.33
20	000061	农产品	212,900	1,492,429.00	0.30
21	301050	雷电微力	28,800	1,485,504.00	0.30
22	688019	安集科技	9,686	1,349,840.96	0.27
23	600562	国睿科技	67,500	1,345,275.00	0.27
24	600236	桂冠电力	178,830	1,216,044.00	0.25
25	600064	南京高科	154,100	1,197,357.00	0.24
26	300035	中科电气	77,100	1,152,645.00	0.23
27	605333	沪光股份	31,500	1,027,845.00	0.21
28	688568	中科星图	19,300	984,879.00	0.20
29	688336	三生国健	45,218	968,569.56	0.20
30	300685	艾德生物	41,820	953,496.00	0.19
31	300722	新余国科	32,700	883,554.00	0.18
32	300341	麦克奥迪	50,400	882,504.00	0.18
33	688138	清溢光电	38,107	872,650.30	0.18
34	300618	寒锐钴业	24,800	837,496.00	0.17
35	300337	银邦股份	73,500	817,320.00	0.16
36	688658	悦康药业	48,982	705,830.62	0.14
37	688533	上声电子	19,788	689,018.16	0.14
38	600517	国网英大	119,400	657,894.00	0.13
39	300861	美畅股份	29,900	596,505.00	0.12
40	600352	浙江龙盛	56,700	583,443.00	0.12
41	600968	海油发展	100,900	430,843.00	0.09
42	600258	首旅酒店	25,144	368,862.48	0.07
43	600895	张江高科	13,100	351,080.00	0.07
44	300455	航天智装	17,300	224,208.00	0.05
45	600754	锦江酒店	7,700	206,822.00	0.04
46	000544	中原环保	20,800	181,584.00	0.04
47	600664	哈药股份	37,800	156,114.00	0.03
48	002891	中宠股份	2,600	92,820.00	0.02
49	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
50	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
51	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.01

52	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
53	603072	C 天和	2,255	27,736.50	0.01
54	688318	财富趋势	120	20,520.00	0.00
55	688696	极米科技	199	19,505.98	0.00
56	688188	柏楚电子	85	16,511.25	0.00
57	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
58	300751	迈为股份	146	15,351.90	0.00
59	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
60	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
61	688200	华峰测控	121	12,644.50	0.00
62	002821	凯莱英	166	12,630.94	0.00
63	688003	天准科技	275	11,907.50	0.00
64	301004	嘉益股份	100	11,565.00	0.00
65	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
66	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
67	300857	协创数据	100	10,689.00	0.00
68	688356	键凯科技	178	10,135.32	0.00
69	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
70	300779	惠城环保	100	9,760.00	0.00
71	603236	移远通信	140	9,581.60	0.00
72	002625	光启技术	200	9,560.00	0.00
73	300474	景嘉微	100	9,349.00	0.00
74	688578	艾力斯	155	9,284.50	0.00
75	688278	特宝生物	120	8,804.40	0.00
76	002294	信立泰	256	7,918.08	0.00
77	300054	鼎龙股份	300	7,806.00	0.00
78	603713	密尔克卫	144	7,372.80	0.00
79	300570	太辰光	100	7,270.00	0.00
80	688408	中信博	100	7,200.00	0.00
81	603605	珀莱雅	84	7,114.80	0.00
82	300573	兴齐眼药	100	6,978.00	0.00
83	688777	中控技术	140	6,953.80	0.00
84	603283	赛腾股份	100	6,916.00	0.00
85	688686	奥普特	91	6,880.51	0.00
86	600763	通策医疗	152	6,748.80	0.00
87	688208	道通科技	169	6,618.04	0.00
88	600702	舍得酒业	100	6,593.00	0.00
89	688063	派能科技	160	6,408.00	0.00
90	300957	贝泰妮	150	6,403.50	0.00
91	600348	华阳股份	900	6,381.00	0.00
92	300776	帝尔激光	100	6,358.00	0.00
93	300724	捷佳伟创	100	6,321.00	0.00
94	600132	重庆啤酒	100	6,302.00	0.00

95	688122	西部超导	147	6,294.54	0.00
96	603613	国联股份	236	6,272.88	0.00
97	000423	东阿阿胶	100	6,272.00	0.00
98	000628	高新发展	100	6,229.00	0.00
99	300763	锦浪科技	100	6,107.00	0.00
100	002120	韵达股份	800	6,016.00	0.00
101	002035	华帝股份	800	5,872.00	0.00
102	000028	国药一致	200	5,850.00	0.00
103	688100	威胜信息	160	5,792.00	0.00
104	300913	兆龙互连	100	5,751.00	0.00
105	300454	深信服	100	5,740.00	0.00
106	603228	景旺电子	200	5,568.00	0.00
107	000799	酒鬼酒	100	5,562.00	0.00
108	688005	容百科技	175	5,521.25	0.00
109	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
110	603198	迎驾贡酒	100	5,394.00	0.00
111	600779	水井坊	100	5,352.00	0.00
112	605168	三人行	145	5,208.40	0.00
113	688363	华熙生物	102	5,206.08	0.00
114	002865	钧达股份	100	5,110.00	0.00
115	600129	太极集团	200	4,944.00	0.00
116	603515	欧普照明	300	4,935.00	0.00
117	300917	特发服务	100	4,838.00	0.00
118	603737	三棵树	111	4,728.60	0.00
119	603486	科沃斯	100	4,700.00	0.00
120	300548	博创科技	100	4,641.00	0.00
121	688268	华特气体	100	4,592.00	0.00
122	688139	海尔生物	128	4,505.60	0.00
123	688711	宏微科技	260	4,492.80	0.00
124	603087	甘李药业	100	4,410.00	0.00
125	300827	上能电气	100	4,390.00	0.00
126	603658	安图生物	100	4,364.00	0.00
127	000988	华工科技	100	4,330.00	0.00
128	688065	凯赛生物	111	4,306.80	0.00
129	603345	安井食品	52	4,236.96	0.00
130	000733	振华科技	100	4,217.00	0.00
131	300476	胜宏科技	100	4,209.00	0.00
132	300888	稳健医疗	100	4,208.00	0.00
133	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
134	603083	剑桥科技	100	4,060.00	0.00
135	300073	当升科技	100	4,028.00	0.00
136	600694	大商股份	150	3,955.50	0.00
137	688166	博瑞医药	130	3,926.00	0.00

138	002841	视源股份	106	3,912.46	0.00
139	688276	百克生物	155	3,892.05	0.00
140	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
141	000513	丽珠集团	100	3,800.00	0.00
142	603197	保隆科技	100	3,775.00	0.00
143	300595	欧普康视	199	3,771.05	0.00
144	000762	西藏矿业	175	3,762.50	0.00
145	603688	石英股份	130	3,734.90	0.00
146	300919	中伟股份	100	3,612.00	0.00
147	002738	中矿资源	100	3,550.00	0.00
148	002997	瑞鹄模具	100	3,465.00	0.00
149	300623	捷捷微电	100	3,416.00	0.00
150	002444	巨星科技	104	3,364.40	0.00
151	002929	润建股份	100	3,362.00	0.00
152	002653	海思科	100	3,325.00	0.00
153	300049	福瑞股份	100	3,154.00	0.00
154	300726	宏达电子	100	3,110.00	0.00
155	601567	三星医疗	100	3,076.00	0.00
156	688561	奇安信	114	3,058.62	0.00
157	688569	铁科轨道	144	3,057.12	0.00
158	603899	晨光股份	100	3,025.00	0.00
159	688099	晶晨股份	43	2,953.24	0.00
160	002384	东山精密	100	2,920.00	0.00
161	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
162	000921	海信家电	100	2,890.00	0.00
163	300777	中简科技	100	2,829.00	0.00
164	002889	东方嘉盛	140	2,812.60	0.00
165	002568	百润股份	100	2,801.00	0.00
166	300100	双林股份	100	2,764.00	0.00
167	002831	裕同科技	100	2,710.00	0.00
168	601231	环旭电子	162	2,673.00	0.00
169	000099	中信海直	100	2,636.00	0.00
170	300905	宝丽迪	100	2,606.00	0.00
171	688116	天奈科技	66	2,561.46	0.00
172	688202	美迪西	84	2,534.28	0.00
173	300677	英科医疗	100	2,528.00	0.00
174	002130	沃尔核材	100	2,525.00	0.00
175	688185	康希诺	41	2,503.05	0.00
176	001696	宗申动力	100	2,490.00	0.00
177	300294	博雅生物	82	2,482.96	0.00
178	603530	神马电力	100	2,471.00	0.00
179	603127	昭衍新药	148	2,461.24	0.00
180	300873	海晨股份	140	2,367.40	0.00

181	603348	文灿股份	100	2,366.00	0.00
182	000869	张裕 A	100	2,319.00	0.00
183	300601	康泰生物	134	2,298.10	0.00
184	605598	上海港湾	100	2,241.00	0.00
185	000062	深圳华强	100	2,240.00	0.00
186	600096	云天化	100	2,230.00	0.00
187	300769	德方纳米	60	2,212.80	0.00
188	300926	博俊科技	100	2,201.00	0.00
189	300001	特锐德	100	2,195.00	0.00
190	300101	振芯科技	100	2,166.00	0.00
191	600559	老白干酒	100	2,099.00	0.00
192	300952	恒辉安防	100	2,083.00	0.00
193	000681	视觉中国	100	2,082.00	0.00
194	002410	广联达	175	2,058.00	0.00
195	002487	大金重工	100	2,049.00	0.00
196	603212	赛伍技术	200	2,036.00	0.00
197	002987	京北方	140	1,992.20	0.00
198	300761	立华股份	100	1,946.00	0.00
199	300438	鹏辉能源	69	1,939.59	0.00
200	002085	万丰奥威	100	1,895.00	0.00
201	300384	三联虹普	100	1,862.00	0.00
202	603995	甬金股份	100	1,829.00	0.00
203	000913	钱江摩托	100	1,801.00	0.00
204	603218	日月股份	149	1,795.45	0.00
205	002541	鸿路钢构	100	1,793.00	0.00
206	300748	金力永磁	100	1,788.00	0.00
207	300673	佩蒂股份	100	1,773.00	0.00
208	002484	江海股份	100	1,758.00	0.00
209	300768	迪普科技	100	1,750.00	0.00
210	002458	益生股份	180	1,729.80	0.00
211	600487	亨通光电	100	1,722.00	0.00
212	600368	五洲交通	358	1,707.66	0.00
213	600315	上海家化	100	1,691.00	0.00
214	601156	东航物流	100	1,687.00	0.00
215	000819	岳阳兴长	100	1,673.00	0.00
216	600621	华鑫股份	100	1,648.00	0.00
217	603517	绝味食品	100	1,644.00	0.00
218	002612	朗姿股份	100	1,636.00	0.00
219	603733	仙鹤股份	79	1,629.77	0.00
220	601825	沪农商行	191	1,625.41	0.00
221	002268	电科网安	100	1,625.00	0.00
222	002603	以岭药业	100	1,601.00	0.00
223	603108	润达医疗	100	1,593.00	0.00

224	002824	和胜股份	100	1,570.00	0.00
225	002925	盈趣科技	100	1,566.00	0.00
226	300181	佐力药业	100	1,536.00	0.00
227	688819	天能股份	55	1,497.10	0.00
228	002078	太阳纸业	100	1,487.00	0.00
229	600598	北大荒	100	1,475.00	0.00
230	601058	赛轮轮胎	100	1,433.00	0.00
231	600522	中天科技	100	1,432.00	0.00
232	600985	淮北矿业	100	1,407.00	0.00
233	000528	柳 工	116	1,398.96	0.00
234	003022	联泓新科	100	1,377.00	0.00
235	300894	火星人	100	1,370.00	0.00
236	603456	九洲药业	100	1,368.00	0.00
237	002139	拓邦股份	100	1,361.00	0.00
238	601869	长飞光纤	45	1,345.05	0.00
239	600256	广汇能源	199	1,339.27	0.00
240	603317	天味食品	100	1,334.00	0.00
241	603489	八方股份	56	1,333.92	0.00
242	002202	金风科技	129	1,332.57	0.00
243	601128	常熟银行	175	1,324.75	0.00
244	000887	中鼎股份	100	1,312.00	0.00
245	002020	京新药业	100	1,280.00	0.00
246	002803	吉宏股份	100	1,268.00	0.00
247	601155	新城控股	106	1,267.76	0.00
248	600388	龙净环保	100	1,265.00	0.00
249	002461	珠江啤酒	125	1,236.25	0.00
250	600801	华新水泥	100	1,210.00	0.00
251	300142	沃森生物	100	1,208.00	0.00
252	000729	燕京啤酒	100	1,204.00	0.00
252	600826	兰生股份	140	1,204.00	0.00
253	300118	东方日升	100	1,198.00	0.00
254	000657	中钨高新	130	1,197.30	0.00
255	600420	国药现代	100	1,194.00	0.00
256	301301	川宁生物	100	1,186.00	0.00
257	600546	山煤国际	100	1,183.00	0.00
258	002497	雅化集团	100	1,170.00	0.00
259	002152	广电运通	100	1,166.00	0.00
260	300002	神州泰岳	100	1,159.00	0.00
261	601101	昊华能源	140	1,152.20	0.00
262	002756	永兴材料	30	1,131.60	0.00
263	300593	新雷能	100	1,120.00	0.00
264	603225	新凤鸣	100	1,113.00	0.00
265	000426	兴业银锡	100	1,112.00	0.00

266	600732	爱旭股份	100	1,102.00	0.00
267	601198	东兴证券	100	1,101.00	0.00
268	002041	登海种业	100	1,089.00	0.00
269	300244	迪安诊断	95	1,078.25	0.00
270	300382	斯莱克	100	1,074.00	0.00
271	688707	振华新材	98	1,073.10	0.00
272	603686	福龙马	100	1,040.00	0.00
273	000823	超声电子	100	1,032.00	0.00
274	300918	南山智尚	100	1,031.00	0.00
275	600350	山东高速	100	1,028.00	0.00
276	600737	中粮糖业	100	1,021.00	0.00
277	600873	梅花生物	100	1,003.00	0.00
277	603053	成都燃气	100	1,003.00	0.00
278	601952	苏垦农发	100	979.00	0.00
279	300568	星源材质	100	972.00	0.00
280	600839	四川长虹	100	965.00	0.00
281	600971	恒源煤电	100	941.00	0.00
282	000685	中山公用	100	923.00	0.00
283	600629	华建集团	100	922.00	0.00
284	600035	楚天高速	200	920.00	0.00
285	000009	中国宝安	100	915.00	0.00
286	600271	航天信息	100	911.00	0.00
287	603105	芯能科技	100	901.00	0.00
288	600177	雅戈尔	100	890.00	0.00
289	600351	亚宝药业	145	883.05	0.00
290	001203	大中矿业	100	866.00	0.00
290	601990	南京证券	100	866.00	0.00
291	600143	金发科技	100	864.00	0.00
292	600846	同济科技	100	862.00	0.00
293	600987	航民股份	122	846.68	0.00
294	601958	金钼股份	83	834.98	0.00
295	603868	飞科电器	20	830.40	0.00
296	600707	彩虹股份	100	822.00	0.00
297	002064	华峰化学	100	818.00	0.00
298	300638	广和通	40	806.00	0.00
298	600867	通化东宝	100	806.00	0.00
299	002600	领益智造	100	800.00	0.00
300	002400	省广集团	100	799.00	0.00
301	002539	云图控股	100	782.00	0.00
302	601555	东吴证券	100	780.00	0.00
303	000039	中集集团	100	777.00	0.00
304	000990	诚志股份	100	775.00	0.00
305	000598	兴蓉环境	100	759.00	0.00

306	002080	中材科技	58	758.64	0.00
307	600223	福瑞达	100	756.00	0.00
308	600884	杉杉股份	100	745.00	0.00
309	600032	浙江新能	100	740.00	0.00
310	688057	金达莱	66	732.60	0.00
311	002372	伟星新材	58	732.54	0.00
312	601918	新集能源	100	718.00	0.00
313	300806	斯迪克	55	712.25	0.00
314	600330	天通股份	100	710.00	0.00
315	600901	江苏金租	135	704.70	0.00
316	603889	新澳股份	100	701.00	0.00
317	603808	歌力思	100	699.00	0.00
318	600667	太极实业	100	692.00	0.00
319	300390	天华新能	30	691.50	0.00
320	000541	佛山照明	110	682.00	0.00
320	300303	聚飞光电	100	682.00	0.00
321	002511	中顺洁柔	100	681.00	0.00
322	603866	桃李面包	100	660.00	0.00
323	000027	深圳能源	100	648.00	0.00
324	000937	冀中能源	100	632.00	0.00
325	002500	山西证券	100	628.00	0.00
326	000958	电投产融	100	623.00	0.00
327	601077	渝农商行	100	605.00	0.00
328	600497	驰宏锌锗	100	557.00	0.00
329	601666	平煤股份	55	551.10	0.00
330	603002	宏昌电子	100	537.00	0.00
331	601598	中国外运	100	535.00	0.00
332	600740	山西焦化	130	523.90	0.00
333	000828	东莞控股	49	523.81	0.00
334	600266	城建发展	100	510.00	0.00
335	000090	天健集团	123	505.53	0.00
336	000589	贵州轮胎	100	503.00	0.00
337	600105	永鼎股份	100	496.00	0.00
338	000035	中国天楹	100	487.00	0.00
339	002392	北京利尔	100	472.00	0.00
340	000723	美锦能源	100	451.00	0.00
341	002183	怡亚通	100	449.00	0.00
342	600383	金地集团	100	438.00	0.00
343	601200	上海环境	53	433.01	0.00
344	600908	无锡银行	73	431.43	0.00
345	000932	华菱钢铁	100	418.00	0.00
346	600606	绿地控股	199	417.90	0.00
347	002966	苏州银行	50	405.50	0.00

348	002573	清新环境	100	398.00	0.00
349	600284	浦东建设	60	376.20	0.00
350	002060	广东建工	100	366.00	0.00
351	600339	中油工程	100	358.00	0.00
351	601599	浙文影业	100	358.00	0.00
352	603300	海南华铁	60	346.80	0.00
353	002061	浙江交科	80	326.40	0.00
354	601222	林洋能源	45	318.15	0.00
355	600208	衢州发展	100	296.00	0.00
356	601778	晶科科技	100	282.00	0.00
357	000069	华侨城 A	100	267.00	0.00
358	601866	中远海发	100	261.00	0.00
359	600477	杭萧钢构	100	257.00	0.00
360	000718	苏宁环球	96	226.56	0.00
361	600639	浦东金桥	20	222.00	0.00
362	603939	益丰药房	7	168.91	0.00
363	600933	爱柯迪	10	163.00	0.00
364	600251	冠农股份	20	145.80	0.00
365	605399	晨光新材	10	116.80	0.00
366	605366	宏柏新材	20	108.40	0.00
367	002936	郑州银行	20	42.00	0.00
368	603043	广州酒家	2	33.26	0.00
369	601216	君正集团	6	31.56	0.00
370	600008	首创环保	3	9.84	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	71,548,424.50	8.72
2	600900	长江电力	59,624,674.26	7.27
3	600887	伊利股份	56,448,370.00	6.88
4	300750	宁德时代	50,917,121.48	6.21
5	601166	兴业银行	49,062,892.00	5.98
6	601318	中国平安	47,191,712.00	5.75
7	600019	宝钢股份	46,583,197.23	5.68
8	601919	中远海控	46,044,344.59	5.61
9	601899	紫金矿业	44,259,620.54	5.40
10	000938	紫光股份	44,001,067.00	5.36
11	601601	中国太保	42,948,136.00	5.24
12	601398	工商银行	40,969,025.00	4.99
13	002371	北方华创	39,328,588.80	4.79
14	300408	三环集团	38,183,606.98	4.65

15	002475	立讯精密	37,016,903.80	4.51
16	000651	格力电器	36,160,050.00	4.41
17	601088	中国神华	36,077,447.00	4.40
18	000001	平安银行	35,536,184.00	4.33
19	300999	金龙鱼	33,896,570.00	4.13
20	600183	生益科技	33,616,085.42	4.10
21	600028	中国石化	33,212,857.50	4.05
22	002049	紫光国微	31,469,541.10	3.84
23	600519	贵州茅台	30,944,579.00	3.77
24	002594	比亚迪	30,853,570.00	3.76
25	600036	招商银行	30,837,642.00	3.76
26	603288	海天味业	30,380,568.13	3.70
27	601138	工业富联	30,076,973.00	3.67
28	603993	洛阳钼业	30,062,424.00	3.66
29	000568	泸州老窖	29,883,492.00	3.64
30	601668	中国建筑	28,718,407.20	3.50
31	600690	海尔智家	28,399,126.00	3.46
32	600023	浙能电力	27,883,679.05	3.40
33	300308	中际旭创	27,858,116.00	3.40
34	601766	中国中车	27,713,613.00	3.38
35	002415	海康威视	27,121,108.00	3.31
36	601628	中国人寿	27,040,065.50	3.30
37	601808	中海油服	26,824,248.94	3.27
38	300014	亿纬锂能	26,540,352.00	3.24
39	601225	陕西煤业	26,452,618.00	3.22
40	600989	宝丰能源	25,926,823.00	3.16
41	000338	潍柴动力	25,756,786.00	3.14
42	601169	北京银行	25,685,738.00	3.13
43	600089	特变电工	25,221,205.50	3.07
44	601229	上海银行	25,188,678.00	3.07
45	300124	汇川技术	24,981,016.00	3.05
46	601600	中国铝业	24,642,528.00	3.00
47	000999	华润三九	24,598,529.90	3.00
48	003816	中国广核	23,491,511.00	2.86
49	688012	中微公司	23,424,967.04	2.86
50	300979	华利集团	23,322,820.24	2.84
51	000063	中兴通讯	23,313,003.00	2.84
52	002271	东方雨虹	23,223,762.45	2.83
53	600346	恒力石化	23,208,639.04	2.83
54	601012	隆基绿能	23,124,562.00	2.82
55	601939	建设银行	22,756,835.50	2.77
56	601186	中国铁建	22,748,159.00	2.77
57	601336	新华保险	22,697,816.08	2.77

58	600893	航发动力	22,605,732.00	2.76
59	603799	华友钴业	22,503,283.38	2.74
60	000625	长安汽车	22,491,786.00	2.74
61	601857	中国石油	22,368,494.00	2.73
62	600482	中国动力	22,269,336.89	2.71
63	601009	南京银行	22,047,922.84	2.69
64	002714	牧原股份	21,851,914.00	2.66
65	601816	京沪高铁	21,813,950.00	2.66
66	688981	中芯国际	21,772,336.88	2.65
67	000895	双汇发展	21,713,587.00	2.65
68	600000	浦发银行	21,522,818.75	2.62
69	601077	渝农商行	21,417,942.00	2.61
70	601328	交通银行	21,369,429.00	2.60
71	002916	深南电路	21,185,392.00	2.58
72	600803	新奥股份	21,015,448.28	2.56
73	601901	方正证券	20,712,377.00	2.52
74	603195	公牛集团	20,675,162.75	2.52
75	603019	中科曙光	20,587,625.00	2.51
76	600660	福耀玻璃	20,564,903.36	2.51
77	600030	中信证券	20,521,277.80	2.50
78	601607	上海医药	20,388,312.00	2.49
79	601319	中国人保	20,260,402.00	2.47
80	002252	上海莱士	19,865,266.00	2.42
81	000725	京东方 A	19,737,961.00	2.41
82	600919	江苏银行	19,728,280.00	2.40
83	300394	天孚通信	19,641,086.00	2.39
84	600570	恒生电子	19,429,520.00	2.37
85	600018	上港集团	19,274,134.00	2.35
86	688008	澜起科技	19,226,753.63	2.34
87	601898	中煤能源	19,194,244.40	2.34
88	600015	华夏银行	18,896,563.00	2.30
89	300498	温氏股份	18,743,733.00	2.28
90	601985	中国核电	18,591,638.35	2.27
91	300274	阳光电源	18,568,646.00	2.26
92	300015	爱尔眼科	18,515,356.00	2.26
93	600809	山西汾酒	18,461,062.00	2.25
94	601998	中信银行	18,325,470.00	2.23
95	600489	中金黄金	18,267,568.65	2.23
96	601128	常熟银行	18,230,321.28	2.22
97	000858	五粮液	18,058,565.00	2.20
98	002493	荣盛石化	17,842,853.00	2.18
99	605499	东鹏饮料	17,742,474.10	2.16
100	601877	正泰电器	17,533,778.00	2.14

101	300433	蓝思科技	17,522,812.00	2.14
102	000538	云南白药	17,492,861.40	2.13
103	002352	顺丰控股	17,443,817.00	2.13
104	600332	白云山	17,257,576.00	2.10
105	600845	宝信软件	17,055,225.66	2.08
106	601988	中国银行	16,771,229.00	2.04
107	600585	海螺水泥	16,560,738.00	2.02
108	300223	北京君正	16,556,220.00	2.02
109	600406	国电南瑞	16,478,154.54	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	71,012,210.00	8.66
2	000333	美的集团	67,684,841.00	8.25
3	600900	长江电力	60,002,106.00	7.31
4	600887	伊利股份	56,045,214.00	6.83
5	601166	兴业银行	52,562,855.00	6.41
6	000938	紫光股份	49,286,814.00	6.01
7	300750	宁德时代	47,150,379.00	5.75
8	600019	宝钢股份	45,708,705.00	5.57
9	300999	金龙鱼	44,807,205.00	5.46
10	601899	紫金矿业	44,373,929.00	5.41
11	000001	平安银行	43,999,354.00	5.36
12	601318	中国平安	42,841,844.00	5.22
13	002371	北方华创	42,045,988.16	5.13
14	000338	潍柴动力	40,654,945.00	4.96
15	600030	中信证券	39,251,351.00	4.78
16	000651	格力电器	38,191,847.00	4.66
17	002475	立讯精密	37,606,465.00	4.58
18	002415	海康威视	37,485,852.84	4.57
19	601939	建设银行	36,860,447.00	4.49
20	601225	陕西煤业	36,832,121.00	4.49
21	601398	工商银行	36,829,490.55	4.49
22	601138	工业富联	36,432,381.00	4.44
23	601601	中国太保	35,852,078.00	4.37
24	601919	中远海控	35,040,275.10	4.27
25	600036	招商银行	34,965,844.04	4.26
26	002049	紫光国微	33,756,518.58	4.11
27	000063	中兴通讯	33,425,474.00	4.07
28	603799	华友钴业	32,800,790.95	4.00
29	002594	比亚迪	32,179,158.20	3.92

30	300408	三环集团	31,754,320.01	3.87
31	000568	泸州老窖	31,560,072.00	3.85
32	601328	交通银行	31,347,885.43	3.82
33	002916	深南电路	30,942,094.40	3.77
34	600690	海尔智家	30,019,428.77	3.66
35	300014	亿纬锂能	29,740,217.00	3.63
36	603993	洛阳钼业	29,610,268.00	3.61
37	600809	山西汾酒	29,315,602.20	3.57
38	002142	宁波银行	29,223,650.00	3.56
39	601668	中国建筑	28,786,539.00	3.51
40	600183	生益科技	28,633,993.17	3.49
41	600028	中国石化	28,503,687.00	3.47
42	601898	中煤能源	28,003,307.00	3.41
43	600023	浙能电力	27,764,402.00	3.38
44	601169	北京银行	27,710,383.00	3.38
45	603290	斯达半导	27,136,731.50	3.31
46	300308	中际旭创	26,306,092.00	3.21
47	601808	中海油服	26,199,765.00	3.19
48	600989	宝丰能源	25,896,051.00	3.16
49	601088	中国神华	25,431,954.00	3.10
50	601600	中国铝业	25,325,257.49	3.09
51	300124	汇川技术	25,210,402.00	3.07
52	601881	中国银河	25,183,699.00	3.07
53	300450	先导智能	25,162,817.00	3.07
54	601077	渝农商行	24,379,112.00	2.97
55	003816	中国广核	24,303,575.00	2.96
56	601012	隆基绿能	24,050,957.00	2.93
57	300979	华利集团	23,957,458.00	2.92
58	603259	药明康德	23,956,675.01	2.92
59	600089	特变电工	23,773,738.60	2.90
60	601211	国泰君安	23,723,589.52	2.89
61	601888	中国中免	23,435,949.00	2.86
62	601336	新华保险	22,950,497.00	2.80
63	601688	华泰证券	22,945,116.00	2.80
64	600893	航发动力	22,864,573.00	2.79
65	000858	五粮液	22,649,736.00	2.76
66	600482	中国动力	22,485,181.06	2.74
67	601186	中国铁建	22,054,539.00	2.69
68	601901	方正证券	22,037,011.38	2.69
69	601009	南京银行	22,019,117.00	2.68
70	002271	东方雨虹	21,967,976.00	2.68
71	603288	海天味业	21,937,144.54	2.67
72	601816	京沪高铁	21,862,551.00	2.67

73	603019	中科曙光	21,848,937.00	2.66
74	600346	恒力石化	21,505,891.00	2.62
75	002714	牧原股份	21,399,770.00	2.61
76	601766	中国中车	21,367,103.00	2.60
77	601229	上海银行	21,256,044.00	2.59
78	002938	鹏鼎控股	21,147,943.00	2.58
79	000625	长安汽车	21,134,471.06	2.58
80	002352	顺丰控股	20,941,151.00	2.55
81	601857	中国石油	20,805,146.00	2.54
82	688008	澜起科技	20,731,422.97	2.53
83	000408	藏格矿业	20,667,054.00	2.52
84	300223	北京君正	20,580,093.00	2.51
85	603195	公牛集团	20,451,894.48	2.49
86	600999	招商证券	20,168,663.00	2.46
87	601628	中国人寿	19,914,501.00	2.43
88	002709	天赐材料	19,897,006.00	2.43
89	002129	TCL 中环	19,599,223.00	2.39
90	300347	泰格医药	19,570,799.00	2.39
91	688012	中微公司	19,559,100.49	2.38
92	601838	成都银行	19,495,303.02	2.38
93	002384	东山精密	19,418,388.00	2.37
94	002252	上海莱士	19,265,964.00	2.35
95	601985	中国核电	19,029,405.00	2.32
96	600570	恒生电子	18,635,374.00	2.27
97	000999	华润三九	18,532,898.00	2.26
98	601128	常熟银行	18,409,770.00	2.24
99	600660	福耀玻璃	18,051,430.70	2.20
100	000725	京东方 A	17,957,665.00	2.19
101	601998	中信银行	17,819,115.00	2.17
102	300122	智飞生物	17,732,794.00	2.16
103	300015	爱尔眼科	17,696,496.59	2.16
104	600489	中金黄金	17,529,289.00	2.14
105	600132	重庆啤酒	17,498,694.00	2.13
106	600919	江苏银行	17,376,505.00	2.12
107	600000	浦发银行	17,369,435.00	2.12
108	300498	温氏股份	17,340,954.00	2.11
109	002180	纳思达	17,287,731.42	2.11
110	601006	大秦铁路	17,258,134.00	2.10
111	601607	上海医药	16,964,414.00	2.07
112	600803	新奥股份	16,949,557.05	2.07
113	002459	晶澳科技	16,947,873.00	2.07
114	600406	国电南瑞	16,812,627.00	2.05
115	002920	德赛西威	16,656,999.00	2.03

116	002493	荣盛石化	16,622,091.00	2.03
117	002410	广联达	16,459,675.73	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,190,624,752.98
卖出股票收入（成交）总额	5,526,450,056.45

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,163,934.66	1.24
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	6,163,934.66	1.24

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	37,000	3,749,705.70	0.76
2	019758	24 国债 21	13,000	1,305,691.15	0.26
3	019749	24 国债 15	11,000	1,108,537.81	0.22

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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和中国太保发行主体外，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：

招商银行股份有限公司（简称招商银行）因未能有效穿透识别底层资产及信息披露不规范案由，于 2024 年 6 月 24 日被国家金融监督管理总局处以罚款。

根据国家外汇管理局上海市分局发布的行政处罚决定书：

中国太平洋保险（集团）股份有限公司（简称中国太保）因未按规定报送资料报表及直接申报数据错报、漏报、多报案由，于 2024 年 1 月 30 日被国家外汇管理局上海市分局处以罚款等。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	326,151.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,079.83
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	404,231.19

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
长城久泰沪深 300 指数 A	19,020	14,798.10	71,757,682.31	25.49	209,702,111.71	74.51
长城久泰沪深 300 指数 C	2,495	6,327.69	-	-	15,787,575.90	100.00
合计	21,515	13,815.82	71,757,682.31	24.14	225,489,687.61	75.86

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业	长城久泰沪深 300 指数 A	46,708.03	0.0166
	长城久泰沪深 300 指数 C	130,853.49	0.8288

人员持有本基金			
	合计	177,561.52	0.0597

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	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
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。

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

注：本报告期末无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2004 年 5 月 21 日）基金份额总额	1,512,020,891.32	-
本报告期期初基金份额总额	284,368,425.63	380,877,975.61
本报告期基金总申购份额	250,789,150.93	127,122,766.25
减：本报告期基金总赎回份额	253,697,782.54	492,213,165.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	281,459,794.02	15,787,575.90

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

自 2024 年 10 月 28 日起，刘沛先生担任公司首席信息官，邱春杨先生继续担任本公司总经理，不再担任首席信息官。

自 2024 年 10 月 28 日起，崔金宝先生担任公司财务负责人。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币伍万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金提供审计服务自 2008 年起持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	45.93	1,210,163.68	51.60	-
中信建投	2	1,812,014,136.86	16.91	354,953.70	15.14	-
兴业证券	2	1,604,308,625.03	14.97	314,281.94	13.40	-
中信证券	2	1,534,322,621.91	14.32	300,571.77	12.82	-
华泰证券	1	737,894,431.00	6.89	144,551.62	6.16	-
东方证券	2	105,660,915.60	0.99	20,699.25	0.88	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华源证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 6 个专用交易单元（华源证券新增 1 个交易单元、中信建投证券新增 2 个交易单元、兴业证券新增 2 个交易单元、国泰君安证券新增 1 个交易单元），减少 3 个专用交易单元（第一创业减少 2 个交易单元，华西证券减少 1 个交易单元）。

2、选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

2.1 选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；

(3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；

(4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服

务；

(5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2.2 选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

(1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；

(2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；

(3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券	3,407,954.00	14.25	-	-	-	-
中信建投	2,499,785.00	10.45	-	-	-	-
兴业证券	17,931,163.00	74.98	-	-	-	-
中信证券	76,352.84	0.32	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

第一创业	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金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	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 2 日
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
5	长城基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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 7 月 18 日
6	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 7 月 23 日
7	长城基金管理有限公司关于终止永鑫保险销售服务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 7 月 26 日
8	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	2024 年 10 月 29 日
9	长城基金管理有限公司关于调整旗	中国证监会规定报刊及	2024 年 11 月 16 日

	下基金所持停牌股票估值方法的公告	网站	
10	长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 11 月 21 日
11	长城基金管理有限公司关于北京分公司变更营业场所的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 12 月 12 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20240101-20241028	164,264,534.23	-	164,264,534.23	-	-

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

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

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

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

3、基金净值波动风险

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

4、投资受限风险

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

5、基金合同终止或转型风险

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城久泰沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日