

# 长城久兆中小板 300 指数分级 证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 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。本半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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 08 月 25 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 2015 年 01 月 01 日起至 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.....	6
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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
11.1 备查文件目录.....	60
11.2 存放地点.....	61
11.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金		
基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级		
基金主代码	162010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 1 月 30 日		
基金管理人	长城基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	107,408,049.48 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-02-21		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板 300 指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金场内简称:	长城久兆	中小 300A	中小 300B
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	33,811,016.48 份	29,438,813.00 份	44,158,220.00 份

注:自 2015 年 6 月 8 日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由“久兆稳健”(代码:150057)变更为“中小 300A”,长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称由“久兆积极”(代码:150058)变更为“中小 300B”。基金代码和其他信息均保持不变,详见本管理人 2015 年 6 月 4 日公告。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,力求实现对中小板 300(价格)指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。		
投资策略	本基金采用完全复制策略,按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时,本基金将运用其他方法建立实际组合,力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。		
业绩比较基准	中小板 300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。		
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等,为高风险、高收益产品。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率高于	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的

	普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。	的特征。	特征。
--	---	------	-----

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518026	100033
法定代表人		杨光裕	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算公司深圳分公司	深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
---------------	---------------------------------------

本期已实现收益	18,303,340.16
本期利润	7,467,497.09
加权平均基金份额本期利润	0.1625
本期加权平均净值利润率	13.37%
本期基金份额净值增长率	62.32%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
期末可供分配利润	45,459,536.61
期末可供分配基金份额利润	0.4232
期末基金资产净值	94,077,754.07
期末基金份额净值	0.876
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2015年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	93.50%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-14.62%	3.92%	-13.86%	3.56%	-0.76%	0.36%
过去三个月	14.24%	2.91%	19.91%	2.84%	-5.67%	0.07%
过去六个月	62.32%	2.31%	71.41%	2.24%	-9.09%	0.07%
过去一年	85.30%	1.80%	97.24%	1.77%	-11.94%	0.03%
过去三年	104.77%	1.54%	127.32%	1.53%	-22.55%	0.01%
自基金合同生效起至今	93.50%	1.49%	141.11%	1.49%	-47.61%	0.00%

注：从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率由 D1 到 Dn 区间内每个交易日收益率的合成计算而来，计算公式如下：

从 D1 到 Dn 时间区间业绩比较基准的收益率 = (1+D1 日业绩比较基准收益率) × (1+D2 日业绩比较基准收益率) × …… × (1+Dn 日业绩比较基准收益率) - 1

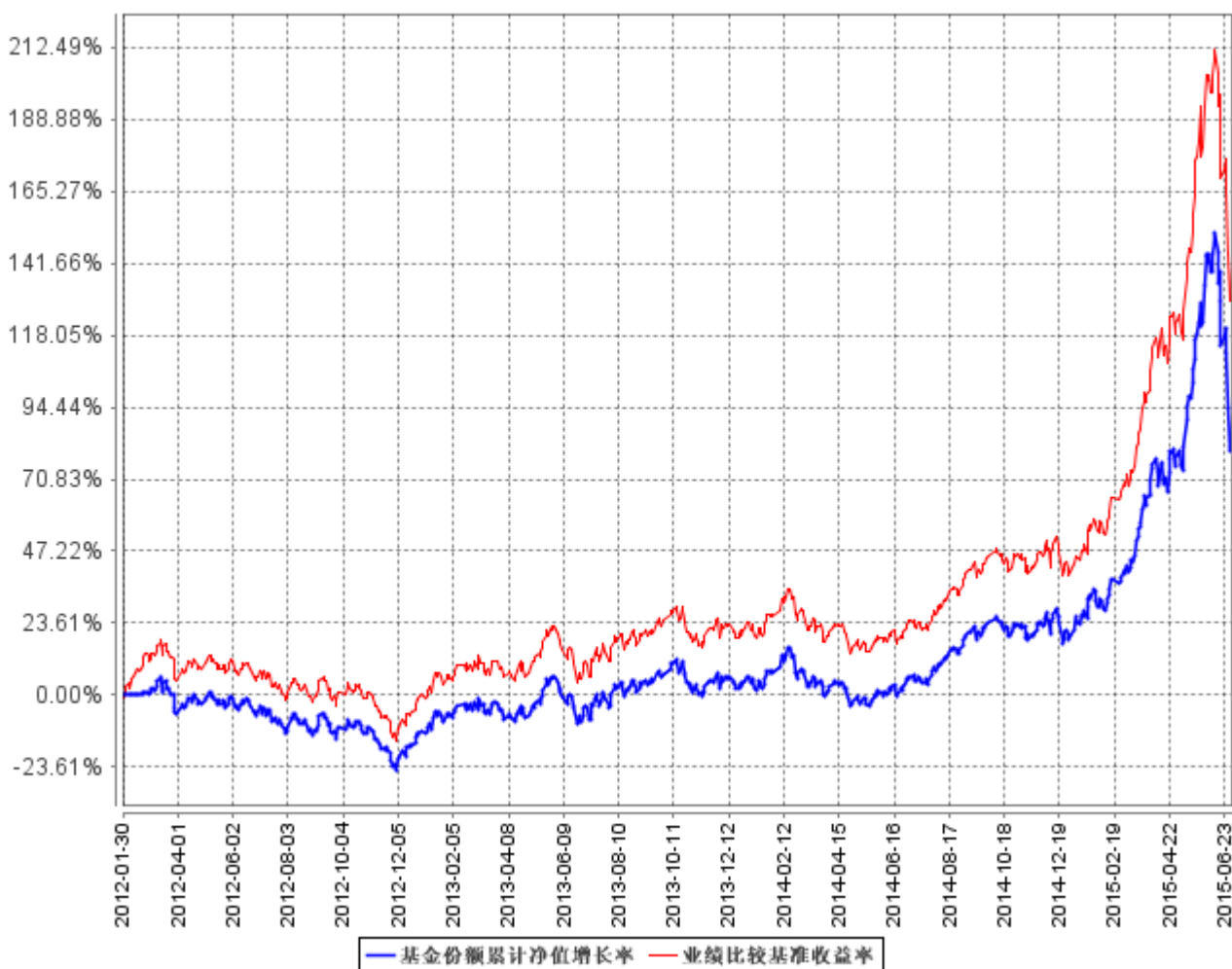
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

长城久兆业绩比较基准每日收益率=中小板 300(价格)指数日收益率×95%+活期存款每日利率(税后)×5%

指数收益率以当日收盘价相对于上一个交易日收盘价计算而成；计算活期存款利率收益时，如果前一日或者多日为非交易日的，考虑该非交易日。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金投资组合为：本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于90%，其中将不低于90%的股票资产投资于中小板300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起6个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长股票型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长股票型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级股票型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健股票型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
余礼冰	长城久兆中小板 300 指数分级基金的基金经理	2012 年 4 月 17 日	-	14 年	女，中国籍，华中理工大学工学硕士。曾就职于富国基金、宝盈基金、友邦华泰基金等，2007 年加入长城基

					金管理有限公司，曾任研究部副总经理。2012 年 1 月至 2012 年 4 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理助理，自 2012 年 4 月至今任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”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证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们在报告期内严格遵守基金合同，通过投资约束和数量化控制，以中小板 300（价格）指数成分股为投资组合，采取完全复制策略，紧密跟踪指数走势，缩小跟踪误差。并采用程序化管理和人工管理的方式，处理基金日常运作中出现的基金规模流动性需求、组合偏差调整、风险平

衡等事件，将本基金的跟踪误差控制在合理范围，使本基金成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 62.32%，本基金比较基准收益率为 71.41%。本报告期内，本基金日均跟踪误差控制在 0.35% 之内，年化跟踪误差控制在 4% 之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年 A 股市场在经历了狂热之后，于 6 月份始现了巨幅调整。

经济基本面方面，6 月工业经济仍未见改善迹象：终端需求中仅地产一枝独秀，乘用车、家电和纺织服装依然疲弱；而与工业休戚相关的发电耗煤、铁路货运，其增速都是向下。政府仍以稳增长为首要目标，并以地方债务置换等积极财政托底经济。但宽松货币预期引发金融市场的不稳定，阻碍调结构，稳增长与调结构间的矛盾进一步凸显。

二级市场在经过了这一轮暴跌和风险教育以后，投资环境可能会变得冷静理智一些。我们相信驱动这一轮超级牛市的三大逻辑依然成立，这三大逻辑是长期利率预期下行流动性环境宽松、国民资产配置长周期调整于金融资产、人民对国家改革转型的信心持续增强。而且，资本市场于国家改革转型和产业升级与优化资源配置的作用不可替代。我们依然相信这一轮牛市的基础依然存在，只不过中间充满了波折，尤其考虑到史无前例的杠杆资金入市，使得上涨和下跌都被放大，因而也加剧了波动和风险。

15 年是中国改革的深化年。中小板 300 指数做为新兴产业和大消费占比较高的市场代表性指数将受益改革和经济转型，长城久兆中小板 300 指数分级基金做为交易型投资工具，适合于投资者做为交易品种投资。我们将通过对基金合同的严格遵守，对跟踪误差的严格控制，将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司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、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟

练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究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，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果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。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

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。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、剪操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

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，由其按约定提供债券品种的估值数据。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定：

本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

### 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，本基金自 2015 年 1 月 6 日起至 2015 年 4 月 2 日止连续 58 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元，自 2015 年 4 月 8 日起至 2015 年 5 月 25 日止连续 33 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

## § 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

根据《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》，本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,189,835.01	3,427,357.41
结算备付金		1,402,556.62	21,799.58
存出保证金		58,778.30	20,895.20
交易性金融资产	6.4.7.2	90,270,539.74	52,864,868.93
其中：股票投资		90,270,539.74	52,833,684.43
基金投资		-	-
债券投资		-	31,184.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,839.54	878.24
应收股利		-	-
应收申购款		250,468.73	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		98,174,017.94	56,335,799.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		-	-
应付证券清算款		865.11	-
应付赎回款		3,449,077.11	1,342,196.11
应付管理人报酬		115,765.73	29,645.45
应付托管费		25,468.46	6,522.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	248,225.42	68,377.31
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	256,862.04	165,054.11
负债合计		4,096,263.87	1,611,794.99
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	48,618,217.46	45,930,808.67
未分配利润	6.4.7.10	45,459,536.61	8,793,195.70
所有者权益合计		94,077,754.07	54,724,004.37
负债和所有者权益总计		98,174,017.94	56,335,799.36

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，长城久兆中小板 300 指数分级份额净值 0.876 元，长城久兆稳健指数的参考份额净值 1.006 元，长城久兆积极指数的参考份额净值 0.789 元。基金份额总额为 107,408,049.48 份，其中长城久兆中小板 300 指数分级份额 33,811,016.48 份，长城久兆稳健指数份额 29,438,813.00 份，长城久兆积极指数份额 44,158,220.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		8,564,950.24	6,826,342.30
1.利息收入		24,063.09	12,505.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,040.17	12,490.36
债券利息收入		22.92	15.34
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）		19,152,496.61	7,393,277.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,911,807.07	7,291,961.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	17,737.56	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	222,951.98	101,315.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,835,843.07	-708,560.93
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	224,233.61	129,120.43
<b>减：二、费用</b>		1,097,453.15	752,885.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	275,041.10	202,123.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,509.09	44,467.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	535,022.39	251,299.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	226,880.57	254,995.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,467,497.09	6,073,456.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7,467,497.09	6,073,456.33

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	45,930,808.67	8,793,195.70	54,724,004.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,467,497.09	7,467,497.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,687,408.79	29,198,843.82	31,886,252.61
其中：1.基金申购款	99,525,153.10	115,618,747.81	215,143,900.91
2.基金赎回款	-96,837,744.31	-86,419,903.99	-183,257,648.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	48,618,217.46	45,459,536.61	94,077,754.07
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,445,251.13	3,281,570.62	75,726,821.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,073,456.33	6,073,456.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-54,306,687.90	-8,558,731.53	-62,865,419.43
其中：1.基金申购款	41,352,296.88	1,628,326.03	42,980,622.91
2.基金赎回款	-95,658,984.78	-10,187,057.56	-105,846,042.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	18,138,563.23	796,295.42	18,934,858.65



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>杨光裕</u>	<u>熊科金</u>	<u>彭洪波</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

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）二零一一年九月十五日下发的证监许可【2011】1474 号文“关于核准长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金募集的批复”的核准，由长城基金管理有限公司作为管理人自 2011 年 12 月 19 日至 2012 年 1 月 17 日止向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第 60737541\_H01 号验资报告。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 965,751,817.91 元，折合 965,751,817.91 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 190,967.22 元，折合 190,967.22 份基金份额。其中场外已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 919,615,817.91 元，折合 919,615,817.91 份基金份额，场外有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 181,884.22 元，折合 181,884.22 份基金份额；场内已收到的首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币 46,136,000.00 元，折合 46,136,000.00 份基金份额，场内有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 9,083.00 元，折合 9,083.00 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 965,942,785.13 元，折合 965,942,785.13 份基金份额。本基金的基金合同于 2012 年 01 月 30 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）。

本基金的基金份额包括长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（简称“久兆 300 份额”）、“久兆稳健份额”与“久兆积极份额”。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为久兆 300 份额；场内认购的全部份额将按照基金合同约定比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。久兆 300 份额设置单独的基金代码，只接受场外与场内申购和赎回；久兆稳健份额、久兆积极份额交易代码不同，只上市交易，不接受申购和赎回。

本基金四份久兆稳健份额与六份久兆积极份额的参考净值之和将等于十份久兆 300 份额的净值。久兆稳健份额的约定收益率为 5.8%。久兆稳健份额的约定收益率除以 365 得到久兆稳健份额的约定日简单收益率。久兆稳健份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算

日经折算后的份额净值为基准采用久兆稳健份额的约定日简单收益率单利进行计算。计算出久兆稳健份额的份额参考净值后，根据久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额净值的关系，可以计算出久兆积极份额的份额参考净值。

定期份额折算：自基金合同生效日或前一定定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止，本基金将按照基金合同规定进行基金的定期份额折算。本基金进行定期份额折算后，久兆稳健份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆 300 份额分配给久兆稳健份额持有人，久兆稳健份额的份额参考净值调整为 1.000 元；久兆 300 份额持有人持有的每十份久兆 300 份额将按四份久兆稳健份额获得新增久兆 300 份额的分配，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。

经过定期份额折算，久兆 300 份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后，久兆积极份额的份额参考净值及其份额数未发生变化，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

不定期份额折算：本基金运作期间，如久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元或久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元，本基金将按照基金合同规定进行基金的不定期份额折算。

当久兆 300 份额的份额净值达到 2.000 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。不定期份额折算后，持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应增加，持有场外久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆 300 份额的分配，持有场内久兆 300 份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆 300 份额的分配。持有人持有的久兆稳健份额和久兆积极份额的份额数在折算前后均保持不变，因折算新增的份额将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

当久兆积极份额的份额参考净值达到 0.250 元时，不定期份额折算后，久兆 300 份额的基金份额净值以及久兆稳健份额与久兆积极份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元；持有人持有的久兆 300 份额的份额数按照久兆 300 份额折算比例相应减少，久兆积极份额持有人持有的久兆积极份额数按照久兆积极份额的折算比例相应减少。为保持久兆稳健份额和久兆积极份额比例不变，久兆稳健份额的折算比例与久兆积极份额相同，久兆稳健份额持有人持有的久兆稳健份额数同比例相应减少，超出份额数将全部折算成久兆 300 份额的场内份额。

不定期份额折算前后，久兆稳健份额和久兆积极份额的份额配比始终保持 4:6 的比例不变。折算所产生的场内久兆 300 份额不进行自动分离。

根据基金管理人 2015 年 6 月 4 日《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更场内基金简称的公告》，自 2015 年 6 月 8 日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由“久兆稳健”（代码：150057）变更为“中小 300A”，长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称由“久兆积极”（代码：150058）变更为“中小 300B”。基金代码和其他信息均保持不变。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券、资产支持证券、权证，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，进行组合资产管理。

本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中小板 300(价格)指数收益率 $\times$ 95%+活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 6 月 30 日的财

务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5.2 中说明的内容外其余均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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）中对于固定收益品种估值的相关规定，自 2015 年 3 月 25 日起，本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，调整后采用第三方估值机构提供的价格数据对前述固定收益品种进行估值。相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

除上述事项外，本基金本报告期内无其他会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，免征营业税。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	6,189,835.01
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	6,189,835.01

注：本基金于本报告期间未投资定期存款和其他存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	100,711,000.29	90,270,539.74	-10,440,460.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	100,711,000.29	90,270,539.74	-10,440,460.55

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,181.68
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	631.36
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	26.50
合计	1,839.54

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	248,225.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	248,225.42

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,887.90
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	193,974.14
合计	256,862.04

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,150,552.71	45,930,808.67
本期申购	992,345.15	946,400.97
本期赎回(以“-”号填列)	-24,458,679.72	-23,337,584.84
2015 年 1 月 29 日 基金拆分/份 额折算前	24,684,218.14	23,539,624.80
基金拆分/份额折算变动份额	458,867.45	-
本期申购	207,183,950.61	98,578,752.13
本期赎回(以“-”号填列)	-124,918,986.72	-73,500,159.47
本期末	107,408,049.48	48,618,217.46

注：1、根据长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同、招募说明书及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2015 年 1 月 29 日为份额折算日，对久兆 300 份额的场外份额、场内份额和久兆稳健份额实施定期份额折算。

2、根据本基金的基金合同第二十一章“基金份额折算”的有关规定，如长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“久兆 300 份额”）的基金份额净值达到 2.000 元，本基金将进行不定期份额折算。截至 2015 年 5 月 20 日，久兆 300 份额的基金份额净值为 2.005 元，达到基金合同规定的不定期份额折算条件。根据基金合同、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金以 2015 年 5 月 21 日为基准日办理不定期份额折算业务。2015 年 5 月 25 日，本基金管理人披露了《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》。

3、本基金本报告期份额折算后的申购包含基金转入的份额及金额以及上述不定期折算中久兆 300 份额的份额增加数，赎回包含基金转出的份额及金额。

4、根据《基金合同》规定：长城久兆中小板 300 指数分级份额只接受场外与场内申购和赎回；长城久兆稳健指数份额和长城久兆积极指数份额只上市交易，不接受申购和赎回，因此上表不再单独披露长城久兆稳健指数份额和长城久兆积极指数份额的情况。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,537,077.75	-11,743,882.05	8,793,195.70
本期利润	18,303,340.16	-10,835,843.07	7,467,497.09
本期基金份额交易产生的变动数	15,593,130.27	13,605,713.55	29,198,843.82
其中：基金申购款	93,087,727.70	22,531,020.11	115,618,747.81
基金赎回款	-77,494,597.43	-8,925,306.56	-86,419,903.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	54,433,548.18	-8,974,011.57	45,459,536.61

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,763.90
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	2,931.91
其他	344.36
合计	24,040.17

注：其他包括申购款利息收入 12.79 元以及结算保证金利息收入 331.57 元



#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	165,491,458.83
减：卖出股票成本总额	146,579,651.76
买卖股票差价收入	18,911,807.07

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	17,737.56
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	17,737.56

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	42,966.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,200.00
减：应收利息总额	28.44
买卖债券差价收入	17,737.56

##### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

##### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未发生贵金属投资，本期末持有数量及金额均为零，无收益/损失。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金于本报告期无衍生工具投资收益/损失。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	222,951.98
基金投资产生的股利收益	-
合计	222,951.98

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,835,843.07
——股票投资	-10,829,858.57
——债券投资	-5,984.50
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-10,835,843.07

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	223,463.12
转出基金补偿收入	770.49
合计	224,233.61

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

交易所市场交易费用	535,022.39
银行间市场交易费用	-
合计	535,022.39

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	74,385.57
上市年费	29,752.78
银行费用	2,906.43
指数使用费	100,000.00
合计	226,880.57

#### 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。

#### 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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	275,041.10	202,123.76
其中：支付销售机构的客户维护费	45,940.11	38,516.86

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	60,509.09	44,467.23

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金，基金管理人于本期末及上年度可比期末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末未持有本基金的份额。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 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
中国建设银行	6,189,835.01	20,763.90	1,153,287.76	11,215.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行间同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期末未有在承销期内直接购入关联方承销证券。

### 6.4.11 利润分配情况

注：根据法律法规的规定及《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，本基金（包括久兆 300 份额、久兆稳健份额、久兆积极份额）不进行收益分配。

### 6.4.12 期末（2015 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

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
002183	怡亚通	2015年6月1日	重大事项	65.78	-	-	41,146	2,641,592.77	2,706,583.88	-
002303	美盈森	2015年6月9日	重大事项	47.70	2015年7月13日	21.43	16,358	635,274.99	780,276.60	-
002223	鱼跃医疗	2015年6月25日	重大事项	67.20	2015年7月13日	60.48	10,860	551,399.20	729,792.00	-
002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项	31.15	-	-	22,402	580,545.03	697,822.30	-
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	32.86	-	-	20,486	707,137.81	673,169.96	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	重大事项	19.22	-	-	33,844	547,478.80	650,481.68	-
002308	威创股份	2015年6月12日	重大事项	31.00	-	-	20,189	443,916.85	625,859.00	-
002276	万马股份	2015年6月30日	重大事项	34.15	2015年7月20日	30.74	17,382	623,748.34	593,595.30	-
002375	亚厦股份	2015年6月17日	重大事项	23.96	2015年7月20日	26.29	23,082	594,390.76	553,044.72	-
002288	超华科技	2015年6月8日	重大事项	17.75	2015年8月17日	15.98	27,865	327,761.00	494,603.75	-
002367	康力电梯	2015年6月2日	重大事项	20.90	-	-	23,103	552,427.59	482,852.70	-
002309	中利科技	2015年6月2日	重大事项	33.39	2015年7月21日	30.05	14,293	435,624.37	477,243.27	-
002577	雷柏科技	2015年6月10日	重大事项	80.60	-	-	5,279	350,254.01	425,487.40	-
002369	卓翼科技	2015年6月3日	重大事项	20.03	-	-	19,835	330,117.72	397,295.05	-
002527	新时达	2015年6月15日	重大事项	30.92	-	-	11,865	298,147.14	366,865.80	-
002298	鑫龙电器	2015年6月25日	重大事项	28.16	2015年7月2日	25.34	12,627	390,101.14	355,576.32	-
002091	江苏国泰	2015年6月1日	重大事项	26.22	-	-	13,515	331,357.64	354,363.30	-
002574	明牌珠宝	2015年6月4日	重大事项	22.90	-	-	15,384	264,471.43	352,293.60	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项	27.70	2015年7月1日	30.00	12,714	392,461.36	352,177.80	-
002069	獐子岛	2015年6月1日	重大事项	19.76	-	-	16,701	321,795.18	330,011.76	-
002001	新和成	2015年6月30日	员工持股	17.09	2015年7月13日	18.49	18,207	394,290.39	311,157.63	-

002268	卫 士 通	2015 年 5 月 8 日	重大事 项	84.80	2015 年 8 月 4 日	76.32	3,029	149,708.29	256,859.20	-
002461	珠江啤 酒	2015 年 6 月 4 日	重大事 项	26.40	2015 年 7 月 24 日	23.76	9,558	203,709.39	252,331.20	-
002242	九阳股 份	2015 年 6 月 15 日	重大事 项	19.45	2015 年 7 月 7 日	17.51	12,656	214,719.57	246,159.20	-
002310	东方园 林	2015 年 5 月 27 日	重大事 项	38.30	-	-	6,147	199,217.66	235,430.10	-
002353	杰瑞股 份	2015 年 5 月 27 日	重大事 项	35.04	-	-	5,879	223,174.94	206,000.16	-
002194	武汉凡 谷	2015 年 6 月 18 日	重大事 项	26.98	2015 年 7 月 24 日	24.28	6,903	124,792.20	186,242.94	-
002170	芭田股 份	2015 年 5 月 26 日	重大事 项	26.12	2015 年 7 月 28 日	23.51	6,490	117,662.46	169,518.80	-
002368	太极股 份	2015 年 5 月 14 日	重大事 项	65.52	-	-	2,454	108,522.87	160,786.08	-
002292	奥飞动 漫	2015 年 5 月 18 日	重大事 项	37.29	-	-	4,186	86,575.16	156,095.94	-
002617	露笑科 技	2015 年 6 月 23 日	重大事 项	53.28	2015 年 7 月 2 日	47.95	2,835	116,127.55	151,048.80	-
002605	姚记扑 克	2015 年 6 月 16 日	重大事 项	29.01	-	-	4,784	123,205.89	138,783.84	-
002106	莱宝高 科	2015 年 4 月 7 日	重大事 项	16.42	-	-	7,639	105,326.72	125,432.38	-
002354	天神娱 乐	2015 年 5 月 28 日	重大事 项	96.97	2015 年 7 月 23 日	87.27	897	71,802.17	86,982.09	-
002345	潮宏基	2015 年 5 月 22 日	重大事 项	19.58	-	-	4,415	56,431.90	86,445.70	-
002020	京新药 业	2015 年 4 月 16 日	重大事 项	29.44	2015 年 8 月 10 日	26.10	2,805	63,617.13	82,579.20	-
002097	山河智 能	2015 年 5 月 21 日	重大事 项	19.80	-	-	3,471	46,502.64	68,725.80	-
002166	莱茵生 物	2015 年 5 月 25 日	重大事 项	40.49	2015 年 7 月 2 日	36.44	1,593	49,119.05	64,500.57	-
002203	海亮股 份	2015 年 4 月 27 日	重大事 项	12.71	-	-	4,925	50,129.13	62,596.75	-
002316	键桥通 讯	2015 年 2 月 17 日	重大事 项	14.95	-	-	3,851	35,788.40	57,572.45	-
002379	鲁丰环 保	2015 年 5 月 22 日	重大事 项	8.42	2015 年 7 月 14 日	7.58	6,628	34,441.62	55,807.76	-
002571	德力股 份	2015 年 5 月 4 日	重大事 项	18.46	-	-	2,962	41,275.28	54,678.52	-
002269	美邦服	2015 年 5 月	重大事 项	11.86	2015 年 7 月	10.67	4,128	25,909.42	48,958.08	-

	饰	月 22 日	项		月 2 日					
002278	神开股份	2015 年 5 月 26 日	重大事项	16.09	-	-	3,002	37,520.33	48,302.18	-
002683	宏大爆破	2015 年 5 月 11 日	重大事项	35.48	-	-	1,284	42,633.07	45,556.32	-
002416	爱施德	2015 年 5 月 5 日	重大事项	20.67	2015 年 7 月 29 日	18.60	2,023	34,874.66	41,815.41	-
002655	共达电声	2015 年 5 月 11 日	重大事项	15.49	-	-	2,570	30,260.35	39,809.30	-
002080	中材科技	2015 年 4 月 21 日	重大事项	22.79	-	-	1,711	27,744.87	38,993.69	-
002414	高德红外	2015 年 5 月 13 日	重大事项	39.36	-	-	851	20,546.75	33,495.36	-
002716	金贵银业	2015 年 4 月 20 日	重大事项	13.87	2015 年 8 月 24 日	12.48	1,905	24,026.82	26,422.35	-
002306	*ST 云网	2015 年 6 月 3 日	重大事项	9.22	-	-	1,967	13,635.73	18,135.74	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，无质押债券。

### 6.4.13 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、投资决策委员会和监察稽核部、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，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可通过银行间同业市场交易，期末除 6.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外，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可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值（所有者权益）的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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	1 个月以内	1-3 个月	3 个月	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	--------	------	-------	-------	-----	----

2015 年 6 月 30 日			-1 年				
资产							
银行存款	6,189,835.01	-	-	-	-	-	6,189,835.01
结算备付金	1,402,556.62	-	-	-	-	-	1,402,556.62
存出保证金	58,778.30	-	-	-	-	-	58,778.30
交易性金融资产	-	-	-	-	-	90,270,539.74	90,270,539.74
应收利息	-	-	-	-	-	1,839.54	1,839.54
应收申购款	-	-	-	-	-	250,468.73	250,468.73
资产总计	7,651,169.93	-	-	-	-	90,522,848.01	98,174,017.94
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	865.11	865.11
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,449,077.11	3,449,077.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	115,765.73	115,765.73
应付托管费	-	-	-	-	-	25,468.46	25,468.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	248,225.42	248,225.42
其他负债	-	-	-	-	-	256,862.04	256,862.04
负债总计	-	-	-	-	-	4,096,263.87	4,096,263.87
利率敏感度缺口	7,651,169.93	-	-	-	-	-	-
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,427,357.41	-	-	-	-	-	3,427,357.41
结算备付金	21,799.58	-	-	-	-	-	21,799.58
存出保证金	20,895.20	-	-	-	-	-	20,895.20
交易性金融资产	-	-	-	-	31,184.50	52,833,684.43	52,864,868.93
应收利息	-	-	-	-	-	878.24	878.24
资产总计	3,470,052.19	-	-	-	31,184.50	52,834,562.67	56,335,799.36
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,342,196.11	1,342,196.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	29,645.45	29,645.45
应付托管费	-	-	-	-	-	6,522.01	6,522.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	68,377.31	68,377.31
其他负债	-	-	-	-	-	165,054.11	165,054.11
负债总计	-	-	-	-	-	1,611,794.99	1,611,794.99
利率敏感度缺口	3,470,052.19	-	-	-	31,184.50	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券投资；于上年度末持有的交易性债券投资占基金资产净值比重为 0.06%。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本报告期末本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 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	90,270,539.74	95.95	52,833,684.43	96.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	31,184.50	0.06
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	90,270,539.74	95.95	52,864,868.93	96.60

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,287,850.64	2,509,600.01
	沪深 300 指数下降 5%	-4,287,850.64	-2,509,600.01

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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 74,313,920.01 元，划分为第二层次的余额为人民币 15,956,619.73 元，无划分为第三层次余额。

##### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	90,270,539.74	91.95

	其中：股票	90,270,539.74	91.95
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,592,391.63	7.73
7	其他各项资产	311,086.57	0.32
8	合计	98,174,017.94	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,315,163.07	1.40
B	采矿业	848,080.30	0.90
C	制造业	64,743,798.71	68.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	438,030.37	0.47
E	建筑业	3,107,809.14	3.30
F	批发和零售业	3,754,351.74	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	175,814.03	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,797,010.52	8.29
J	金融业	2,575,924.57	2.74
K	房地产业	1,194,081.60	1.27
L	租赁和商务服务业	3,582,319.43	3.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	659,052.36	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	79,103.90	0.08
S	综合	-	-
	合计	90,270,539.74	95.95

## 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002183	怡亚通	41,146	2,706,583.88	2.88
2	002024	苏宁云商	158,610	2,426,733.00	2.58
3	002415	海康威视	46,107	2,065,593.60	2.20
4	002450	康得新	41,878	1,281,466.80	1.36
5	002202	金风科技	59,217	1,152,954.99	1.23
6	002008	大族激光	39,236	1,126,857.92	1.20
7	002230	科大讯飞	31,842	1,112,559.48	1.18
8	002142	宁波银行	47,962	1,014,396.30	1.08
9	002456	欧菲光	28,760	970,362.40	1.03
10	002241	歌尔声学	26,612	955,370.80	1.02
11	002304	洋河股份	13,493	935,874.48	0.99
12	002465	海格通信	28,268	909,946.92	0.97
13	002673	西部证券	31,712	899,669.44	0.96
14	002065	东华软件	27,731	797,266.25	0.85
15	002303	美盈森	16,358	780,276.60	0.83
16	002223	鱼跃医疗	10,860	729,792.00	0.78
17	002312	三泰控股	19,349	724,813.54	0.77
18	002022	科华生物	16,787	716,133.42	0.76
19	002129	中环股份	36,177	715,942.83	0.76
20	002325	洪涛股份	22,402	697,822.30	0.74
21	002030	达安基因	15,664	693,915.20	0.74
22	002018	华信国际	20,486	673,169.96	0.72
23	002500	山西证券	36,587	661,858.83	0.70
24	002191	劲嘉股份	33,844	650,481.68	0.69
25	002439	启明星辰	18,758	643,399.40	0.68
26	002236	大华股份	19,820	632,654.40	0.67
27	002308	威创股份	20,189	625,859.00	0.67
28	002152	广电运通	18,934	612,325.56	0.65
29	002252	上海莱士	9,291	608,003.04	0.65
30	002276	万马股份	17,382	593,595.30	0.63

31	002410	广联达	24,914	582,987.60	0.62
32	002385	大北农	43,090	582,576.80	0.62
33	002038	双鹭药业	10,215	578,679.75	0.62
34	002146	荣盛发展	45,619	570,237.50	0.61
35	002475	立讯精密	16,811	568,379.91	0.60
36	002073	软控股份	24,520	566,412.00	0.60
37	002375	亚厦股份	23,082	553,044.72	0.59
38	002055	得润电子	9,485	548,991.80	0.58
39	002266	浙富控股	38,845	531,399.60	0.56
40	002153	石基信息	4,061	527,889.39	0.56
41	002005	德豪润达	45,911	527,058.28	0.56
42	002219	恒康医疗	11,711	520,671.06	0.55
43	002007	华兰生物	11,267	499,015.43	0.53
44	002004	华邦颖泰	38,197	495,797.06	0.53
45	002288	超华科技	27,865	494,603.75	0.53
46	002367	康力电梯	23,103	482,852.70	0.51
47	002285	世联行	22,423	480,749.12	0.51
48	002501	利源精制	29,900	477,802.00	0.51
49	002309	中利科技	14,293	477,243.27	0.51
50	002340	格林美	30,093	457,714.53	0.49
51	002123	荣信股份	19,932	443,487.00	0.47
52	002161	远望谷	20,317	442,097.92	0.47
53	002422	科伦药业	10,964	438,998.56	0.47
54	002570	贝因美	21,948	426,010.68	0.45
55	002577	雷柏科技	5,279	425,487.40	0.45
56	002250	联化科技	18,432	412,876.80	0.44
57	002261	拓维信息	8,457	410,756.49	0.44
58	002092	中泰化学	39,037	397,787.03	0.42
59	002369	卓翼科技	19,835	397,295.05	0.42
60	002573	清新环境	19,173	396,305.91	0.42
61	002089	新海宜	16,672	390,458.24	0.42
62	002428	云南锗业	16,384	385,187.84	0.41
63	002063	远光软件	12,208	381,744.16	0.41
64	002051	中工国际	12,545	373,590.10	0.40
65	002049	同方国芯	7,782	373,536.00	0.40
66	002467	二六三	19,027	370,075.15	0.39
67	002527	新时达	11,865	366,865.80	0.39
68	002029	七匹狼	17,187	360,927.00	0.38
69	002298	鑫龙电器	12,627	355,576.32	0.38

70	002390	信邦制药	19,877	355,400.76	0.38
71	002440	闰土股份	14,820	355,235.40	0.38
72	002091	江苏国泰	13,515	354,363.30	0.38
73	002574	明牌珠宝	15,384	352,293.60	0.37
74	002665	首航节能	12,714	352,177.80	0.37
75	002344	海宁皮城	17,715	347,745.45	0.37
76	002048	宁波华翔	16,622	345,571.38	0.37
77	002179	中航光电	10,406	343,398.00	0.37
78	002318	久立特材	6,393	334,865.34	0.36
79	002271	东方雨虹	13,011	334,382.70	0.36
80	002470	金正大	15,320	332,597.20	0.35
81	002155	湖南黄金	26,622	330,911.46	0.35
82	002690	美亚光电	8,421	330,692.67	0.35
83	002069	獐子岛	16,701	330,011.76	0.35
84	002299	圣农发展	16,247	329,814.10	0.35
85	002185	华天科技	18,215	328,234.30	0.35
86	002311	海大集团	23,452	323,403.08	0.34
87	002131	利欧股份	5,514	322,624.14	0.34
88	002190	成飞集成	6,325	322,511.75	0.34
89	002544	杰赛科技	9,137	321,531.03	0.34
90	002396	星网锐捷	9,974	320,165.40	0.34
91	002400	省广股份	12,560	317,265.60	0.34
92	002023	海特高新	13,929	315,491.85	0.34
93	002001	新和成	18,207	311,157.63	0.33
94	002052	同洲电子	22,331	310,177.59	0.33
95	002011	盾安环境	21,396	310,028.04	0.33
96	002358	森源电气	14,161	304,178.28	0.32
97	002037	久联发展	8,993	302,704.38	0.32
98	002176	江特电机	10,826	302,261.92	0.32
99	002508	老板电器	7,845	300,934.20	0.32
100	002550	千红制药	14,291	300,253.91	0.32
101	002104	恒宝股份	12,241	289,989.29	0.31
102	002294	信立泰	10,111	289,174.60	0.31
103	002555	顺荣三七	6,448	288,870.40	0.31
104	002085	万丰奥威	4,679	286,682.33	0.30
105	002064	华峰氨纶	31,390	284,707.30	0.30
106	002197	证通电子	10,223	284,403.86	0.30
107	002551	尚荣医疗	6,537	283,640.43	0.30
108	002221	东华能源	9,494	283,206.02	0.30



109	002444	巨星科技	15,319	283,095.12	0.30
110	002595	豪迈科技	13,118	283,086.44	0.30
111	002421	达实智能	13,953	279,478.59	0.30
112	002215	诺普信	16,170	278,932.50	0.30
113	002013	中航机电	9,941	276,856.85	0.29
114	002424	贵州百灵	4,381	274,075.36	0.29
115	002342	巨力索具	28,690	271,694.30	0.29
116	002056	横店东磁	8,641	270,290.48	0.29
117	002028	思源电气	14,581	268,290.40	0.29
118	002399	海普瑞	7,781	264,476.19	0.28
119	002366	丹甫股份	3,585	263,067.30	0.28
120	002672	东江环保	12,423	262,746.45	0.28
121	002099	海翔药业	10,083	262,359.66	0.28
122	002463	沪电股份	31,337	261,663.95	0.28
123	002095	生意宝	4,068	259,904.52	0.28
124	002078	太阳纸业	32,434	259,472.00	0.28
125	002436	兴森科技	14,327	259,318.70	0.28
126	002277	友阿股份	14,987	257,176.92	0.27
127	002081	金螳螂	9,118	257,036.42	0.27
128	002268	卫士通	3,029	256,859.20	0.27
129	002474	榕基软件	13,068	253,911.24	0.27
130	002168	深圳惠程	16,300	252,976.00	0.27
131	002603	以岭药业	12,548	252,967.68	0.27
132	002461	珠江啤酒	9,558	252,331.20	0.27
133	002384	东山精密	11,386	251,744.46	0.27
134	002195	二三四五	6,007	249,650.92	0.27
135	002138	顺络电子	16,273	248,163.25	0.26
136	002588	史丹利	8,592	247,020.00	0.26
137	002242	九阳股份	12,656	246,159.20	0.26
138	002130	沃尔核材	12,271	245,174.58	0.26
139	002714	牧原股份	4,124	242,243.76	0.26
140	002009	天奇股份	9,731	241,036.87	0.26
141	002449	国星光电	10,919	240,218.00	0.26
142	002031	巨轮股份	15,029	239,562.26	0.25
143	002371	七星电子	6,270	238,260.00	0.25
144	002482	广田股份	8,712	237,837.60	0.25
145	002334	英威腾	19,071	237,624.66	0.25
146	002262	恩华药业	7,316	236,599.44	0.25
147	002310	东方园林	6,147	235,430.10	0.25

148	002025	航天电器	8,912	233,494.40	0.25
149	002233	塔牌集团	13,463	232,371.38	0.25
150	002041	登海种业	13,125	232,181.25	0.25
151	002122	天马股份	21,782	231,978.30	0.25
152	002556	辉隆股份	11,592	231,955.92	0.25
153	002237	恒邦股份	19,318	231,236.46	0.25
154	002117	东港股份	6,898	231,014.02	0.25
155	002698	博实股份	4,331	228,676.80	0.24
156	002070	众和股份	17,166	227,621.16	0.24
157	002376	新北洋	12,634	226,148.60	0.24
158	002263	大东南	20,573	223,217.05	0.24
159	002663	普邦园林	22,839	221,538.30	0.24
160	002108	沧州明珠	13,873	218,638.48	0.23
161	002480	新筑股份	13,410	218,046.60	0.23
162	002405	四维图新	4,899	214,576.20	0.23
163	002317	众生药业	7,567	213,313.73	0.23
164	002497	雅化集团	26,037	213,243.03	0.23
165	002433	太安堂	13,153	212,552.48	0.23
166	002408	齐翔腾达	12,373	212,073.22	0.23
167	002181	粤传媒	14,335	210,724.50	0.22
168	002083	孚日股份	24,012	210,585.24	0.22
169	002167	东方锆业	17,510	209,944.90	0.22
170	002460	赣锋锂业	8,657	209,499.40	0.22
171	002389	南洋科技	10,783	209,190.20	0.22
172	002128	露天煤业	12,606	207,746.88	0.22
173	002332	仙琚制药	11,923	206,506.36	0.22
174	002353	杰瑞股份	5,879	206,000.16	0.22
175	002479	富春环保	11,202	205,556.70	0.22
176	002432	九安医疗	7,262	203,336.00	0.22
177	002151	北斗星通	3,992	202,993.20	0.22
178	002526	山东矿机	15,021	199,779.30	0.21
179	002126	银轮股份	9,862	198,817.92	0.21
180	002060	粤水电	15,899	197,465.58	0.21
181	002254	泰和新材	12,184	196,162.40	0.21
182	002100	天康生物	16,644	194,901.24	0.21
183	002653	海思科	7,099	191,673.00	0.20
184	002638	勤上光电	10,021	188,996.06	0.20
185	002111	威海广泰	5,790	187,248.60	0.20
186	002510	天汽模	12,243	186,705.75	0.20

187	002194	武汉凡谷	6,903	186,242.94	0.20
188	002156	通富微电	9,943	185,536.38	0.20
189	002313	日海通讯	9,659	185,066.44	0.20
190	002019	亿帆鑫富	5,376	184,396.80	0.20
191	002658	雪迪龙	7,035	182,206.50	0.19
192	002604	龙力生物	13,025	181,959.25	0.19
193	002283	天润曲轴	10,620	181,071.00	0.19
194	002628	成都路桥	23,624	179,306.16	0.19
195	002411	九九久	10,603	179,084.67	0.19
196	002079	苏州固锴	16,419	178,802.91	0.19
197	002486	嘉麟杰	21,585	177,212.85	0.19
198	002646	青青稞酒	6,032	176,013.76	0.19
199	002010	传化股份	10,889	175,095.12	0.19
200	002564	天沃科技	13,909	172,471.60	0.18
201	002170	芭田股份	6,490	169,518.80	0.18
202	002204	大连重工	12,568	167,908.48	0.18
203	002118	紫鑫药业	9,701	167,827.30	0.18
204	002273	水晶光电	5,342	166,937.50	0.18
205	002521	齐峰新材	11,828	164,645.76	0.18
206	002322	理工监测	7,461	163,022.85	0.17
207	002447	壹桥海参	12,874	160,925.00	0.17
208	002368	太极股份	2,454	160,786.08	0.17
209	002229	鸿博股份	6,704	160,091.52	0.17
210	002393	力生制药	3,498	159,788.64	0.17
211	002259	升达林业	15,441	159,196.71	0.17
212	002253	川大智胜	3,561	158,642.55	0.17
213	002198	嘉应制药	11,203	157,738.24	0.17
214	002186	全聚德	6,039	157,678.29	0.17
215	002292	奥飞动漫	4,186	156,095.94	0.17
216	002566	益盛药业	6,836	155,382.28	0.17
217	002140	东华科技	6,919	154,708.84	0.16
218	002297	博云新材	8,521	154,656.15	0.16
219	002629	仁智油服	12,989	154,179.43	0.16
220	002617	露笑科技	2,835	151,048.80	0.16
221	002407	多氟多	5,282	150,589.82	0.16
222	002240	威华股份	11,064	150,027.84	0.16
223	002293	罗莱家纺	8,018	145,045.62	0.15
224	002701	奥瑞金	5,523	143,763.69	0.15
225	002148	北纬通信	6,293	143,543.33	0.15

226	002174	游族网络	1,545	143,314.20	0.15
227	002681	奋达科技	5,196	142,682.16	0.15
228	002094	青岛金王	7,322	141,387.82	0.15
229	002605	姚记扑克	4,784	138,783.84	0.15
230	002275	桂林三金	5,405	138,151.80	0.15
231	002618	丹邦科技	3,240	137,473.20	0.15
232	002017	东信和平	6,310	137,179.40	0.15
233	002267	陕天然气	8,797	136,265.53	0.14
234	002035	华帝股份	8,469	134,233.65	0.14
235	002678	珠江钢琴	6,502	131,860.56	0.14
236	002177	御银股份	9,143	131,842.06	0.14
237	002563	森马服饰	5,442	131,478.72	0.14
238	002246	北化股份	8,028	126,922.68	0.13
239	002225	濮耐股份	13,401	126,773.46	0.13
240	002106	莱宝高科	7,639	125,432.38	0.13
241	002021	中捷资源	10,037	124,659.54	0.13
242	002016	世荣兆业	8,744	123,028.08	0.13
243	002281	光迅科技	2,552	122,700.16	0.13
244	002232	启明信息	6,423	121,394.70	0.13
245	002401	中海科技	5,006	120,894.90	0.13
246	002235	安妮股份	4,028	120,235.80	0.13
247	002635	安洁科技	4,851	118,121.85	0.13
248	002419	天虹商场	6,616	112,472.00	0.12
249	002093	国脉科技	6,863	109,808.00	0.12
250	002554	惠博普	7,633	109,686.21	0.12
251	002476	宝莫股份	7,757	108,675.57	0.12
252	002378	章源钨业	6,421	107,872.80	0.11
253	002218	拓日新能	8,169	104,399.82	0.11
254	002642	荣之联	1,792	102,412.80	0.11
255	002490	山东墨龙	8,130	97,641.30	0.10
256	002700	新疆浩源	6,342	96,208.14	0.10
257	002032	苏泊尔	3,905	96,102.05	0.10
258	002227	奥特迅	2,812	89,281.00	0.09
259	002354	天神娱乐	897	86,982.09	0.09
260	002345	潮宏基	4,415	86,445.70	0.09
261	002020	京新药业	2,805	82,579.20	0.09
262	002466	天齐锂业	1,310	80,958.00	0.09
263	002071	长城影视	3,749	79,103.90	0.08
264	002249	大洋电机	5,768	73,945.76	0.08

265	002315	焦点科技	754	72,384.00	0.08
266	002583	海能达	4,082	72,128.94	0.08
267	002097	山河智能	3,471	68,725.80	0.07
268	002429	兆驰股份	5,182	66,847.80	0.07
269	002216	三全食品	4,423	65,018.10	0.07
270	002166	莱茵生物	1,593	64,500.57	0.07
271	002726	龙大肉食	4,382	62,794.06	0.07
272	002203	海亮股份	4,925	62,596.75	0.07
273	002316	键桥通讯	3,851	57,572.45	0.06
274	002379	鲁丰环保	6,628	55,807.76	0.06
275	002571	德力股份	2,962	54,678.52	0.06
276	002287	奇正藏药	1,364	52,800.44	0.06
277	002437	誉衡药业	1,694	49,210.70	0.05
278	002269	美邦服饰	4,128	48,958.08	0.05
279	002278	神开股份	3,002	48,302.18	0.05
280	002683	宏大爆破	1,284	45,556.32	0.05
281	002050	三花股份	3,926	45,109.74	0.05
282	002416	爱施德	2,023	41,815.41	0.04
283	002648	卫星石化	2,661	40,287.54	0.04
284	002655	共达电声	2,570	39,809.30	0.04
285	002080	中材科技	1,711	38,993.69	0.04
286	002414	高德红外	851	33,495.36	0.04
287	002264	新华都	3,483	32,566.05	0.03
288	002601	佰利联	636	28,938.00	0.03
289	002716	金贵银业	1,905	26,422.35	0.03
290	002244	滨江集团	1,090	20,066.90	0.02
291	002477	雏鹰农牧	1,041	19,987.20	0.02
292	002630	华西能源	705	19,042.05	0.02
293	002306	*ST 云网	1,967	18,135.74	0.02
294	002565	上海绿新	1,367	13,738.35	0.01
295	002594	比亚迪	229	12,647.67	0.01
296	002383	合众思壮	276	12,483.48	0.01
297	002251	步步高	404	9,857.60	0.01
298	002121	科陆电子	300	9,009.00	0.01
299	002697	红旗连锁	324	4,205.52	0.00
300	002431	棕榈园林	1	29.02	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002024	苏宁云商	5,291,378.00	9.67
2	002415	海康威视	4,302,425.00	7.86
3	002450	康得新	3,476,971.28	6.35
4	002230	科大讯飞	3,284,487.52	6.00
5	002183	怡亚通	2,998,172.75	5.48
6	002202	金风科技	2,739,423.98	5.01
7	002065	东华软件	2,391,299.00	4.37
8	002465	海格通信	2,253,458.00	4.12
9	002241	歌尔声学	2,144,136.72	3.92
10	002129	中环股份	2,011,645.55	3.68
11	002673	西部证券	1,966,749.00	3.59
12	002304	洋河股份	1,923,295.97	3.51
13	002142	宁波银行	1,908,356.00	3.49
14	002456	欧菲光	1,893,738.00	3.46
15	002236	大华股份	1,823,303.00	3.33
16	002008	大族激光	1,821,583.00	3.33
17	002500	山西证券	1,786,518.00	3.26
18	002410	广联达	1,697,580.00	3.10
19	002030	达安基因	1,499,547.00	2.74
20	002439	启明星辰	1,462,048.00	2.67
21	002152	广电运通	1,419,489.00	2.59
22	002385	大北农	1,413,886.84	2.58
23	002007	华兰生物	1,363,649.85	2.49
24	002022	科华生物	1,356,122.20	2.48
25	002038	双鹭药业	1,354,974.86	2.48
26	002153	石基信息	1,339,597.00	2.45
27	002004	华邦颖泰	1,334,119.10	2.44

28	002252	上海莱士	1,282,749.00	2.34
29	002276	万马股份	1,278,298.78	2.34
30	002285	世联行	1,221,931.00	2.23
31	002266	浙富控股	1,210,266.00	2.21
32	002312	三泰控股	1,197,039.00	2.19
33	002063	远光软件	1,183,752.00	2.16
34	002475	立讯精密	1,137,636.00	2.08

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	002024	苏宁云商	4,190,127.64	7.66
2	002415	海康威视	3,535,993.37	6.46
3	002450	康得新	2,770,229.08	5.06
4	002230	科大讯飞	2,674,922.39	4.89
5	002202	金风科技	2,263,097.95	4.14
6	002241	歌尔声学	1,997,095.83	3.65
7	002065	东华软件	1,951,522.46	3.57
8	002594	比亚迪	1,817,252.78	3.32
9	002304	洋河股份	1,810,408.68	3.31
10	002465	海格通信	1,805,630.04	3.30
11	002142	宁波银行	1,671,906.86	3.06
12	002236	大华股份	1,600,335.57	2.92
13	002673	西部证券	1,593,433.60	2.91
14	002500	山西证券	1,455,725.28	2.66
15	002129	中环股份	1,442,188.56	2.64
16	002008	大族激光	1,331,764.79	2.43
17	002456	欧菲光	1,331,654.00	2.43
18	002081	金螳螂	1,321,862.93	2.42
19	002410	广联达	1,279,199.75	2.34
20	002030	达安基因	1,230,336.72	2.25
21	002038	双鹭药业	1,198,526.33	2.19
22	002385	大北农	1,190,392.20	2.18
23	002022	科华生物	1,176,402.91	2.15
24	002007	华兰生物	1,163,784.30	2.13
25	002400	省广股份	1,160,533.72	2.12

26	002252	上海莱士	1,157,578.99	2.12
27	002153	石基信息	1,130,746.46	2.07

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	194,846,365.64
卖出股票收入（成交）总额	165,491,458.83

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末投资股指期货，本期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：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

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

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

### 7.12.2

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	58,778.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,839.54
5	应收申购款	250,468.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,086.57

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	2,706,583.88	2.88	重大事项

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长城久兆中小板 300 指数分级（场内简称：长城久兆）	3,299	10,248.87	69,114.00	0.20%	33,741,902.48	99.80%
长城久兆稳健指数（场内简称：中小 300A）	824	35,726.71	2,759,842.00	9.37%	26,678,971.00	90.63%
长城久兆积极指数（场内简称：中小 300B）	2,153	20,510.09	7,533,176.00	17.06%	36,625,044.00	82.94%
合计	6,276	17,114.09	10,362,132.00	9.65%	97,045,917.48	90.35%

注：①对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，对于合计数，比例的分母

采用下属分级基金份额的合计数。

②以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

长城久兆稳健指数（场内简称：中小 300A）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	刘小强	1,743,512.00	5.92%
2	银河资本—光大银行—银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	1,440,380.00	4.89%
3	李时龙	1,315,620.00	4.47%
4	张明媛	820,000.00	2.79%
5	周健文	818,900.00	2.78%
6	鹏华基金—工商银行—鹏华基金鹏诚理财多策略绝对收益 5 号资	800,000.00	2.72%
7	唐彬彬	617,600.00	2.10%
8	华红一	590,900.00	2.01%
9	蒋义宏	590,482.00	2.01%
10	刘春	531,000.00	1.80%

长城久兆积极指数（场内简称：中小 300B）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	长江证券—招商银行—长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管	5,284,114.00	11.97%
2	银河资本—光大银行—银河资本青昀套利 2 号资产管理计划	2,000,000.00	4.53%
3	陈健	1,456,000.00	3.30%
4	杨树志	506,300.00	1.15%
5	毛庆华	500,000.00	1.13%
6	郑刚	412,135.00	0.93%
7	谢峥嵘	362,100.00	0.82%
8	余斌	356,996.00	0.81%
9	俞恭俭	273,400.00	0.62%
10	江思源	270,600.00	0.61%

注：①持有人为场内持有人，占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例×100%。

②对于长城久兆稳健指数、长城久兆积极指数前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别份额总数。

③以基金账户为统计口径。

④以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 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	长城久兆中小板 300 指数分级 (场内简称: 长城久兆)	-	-
	长城久兆稳健指数 (场内简称: 中小 300A)	-	-
	长城久兆积极指数 (场内简称: 中小 300B)	-	-
	合计	-	-

注: 对于分级基金, 下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额, 对于合计数, 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	长城久兆中小板 300 指数分级(场内简称: 长城久兆)	0
	长城久兆稳健指数(场内简称: 中小 300A)	0
	长城久兆积极指数(场内简称: 中小 300B)	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长城久兆中小板 300 指数分级(场内简称: 长城久兆)	0
	长城久兆稳健指数(场内简称: 中小 300A)	0
	长城久兆积极指数(场内简称: 中小 300B)	0
	合计	0

注: 同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的, 分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	长城久兆中小板 300 指数分级 (场 内简称: 长城久兆)	长城久兆稳健 指数 (场内简 称: 中小 300A)	长城久兆积极 指数 (场内简 称: 中小 300B)
基金合同生效日 (2012 年 1 月 30 日) 基金份额总额	919, 797, 702. 13	18, 458, 033. 00	27, 687, 050. 00

本报告期期初基金份额总额	30,879,829.71	6,908,289.00	10,362,434.00
本报告期基金总申购份额	184,423,045.54	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	149,377,666.44	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-32,114,192.33	22,530,524.00	33,795,786.00
本报告期期末基金份额总额	33,811,016.48	29,438,813.00	44,158,220.00

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中新增的份额。

## § 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

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	358,843,497.85	99.59%	326,691.78	99.59%	-
国金证券	2	1,494,326.62	0.41%	1,360.69	0.41%	-
长城证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	42,966.00	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
天源证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 42 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
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。

### 10.8 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旗下基金持有的“12 邵城投（122565）”债券估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
3	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持中国南车、中国北车股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 6 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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 21 日
5	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2015 年 1 月 23 日
6	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本	2015 年 1 月 26 日



		基金管理人网站	
7	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 27 日
8	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算期间久兆稳健份额停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 1 月 30 日
9	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 2 日
10	关于长城久兆稳健定期份额折算后次日收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 2 日
11	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 7 日
12	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 12 日
13	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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 6 日
14	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 10 日
15	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 14 日
16	长城基金关于增加泉州银行为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 16 日
17	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
18	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持正邦科技股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 18 日
19	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2015 年 3 月 19 日

		理人网站	
20	长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
21	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
22	长城基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
23	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 4 日
24	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 8 日
25	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 11 日
26	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 23 日
27	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 28 日
28	长城基金关于增加中金公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务及实施申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
29	关于长城基金管理有限公司旗下基金参与天天基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 4 日
30	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2015 年 5 月 12 日

		理人网站	
31	长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 14 日
32	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 19 日
33	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 20 日
34	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 21 日
35	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
36	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算业务期间停复牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
37	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 25 日
38	关于久兆稳健和久兆积极不定期份额折算后前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 25 日
39	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 26 日
40	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
41	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与农业银行开展的网上银行、手机银行申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 1 日
42	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 2 日

43	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 3 日
44	关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更场内基金简称的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 4 日
45	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 4 日
46	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 9 日
47	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 13 日
48	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 19 日
49	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	中国证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
50	长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日
51	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 30 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立等相关批准文件
- (二) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》

- (四) 法律意见书
- (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

## 11.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## 11.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)