

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 28 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 08 月 21 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 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告	13
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
7.8 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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

§ 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
前端交易代码	200002
后端交易代码	201002
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	1,465,600,931.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	(1) 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。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。(2) 股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3) 本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险，获取市场平均收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	张燕
	联系电话	0755-23982338	0755-83199084
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95555
传真		0755-23982328	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518026	518040
法定代表人		杨光裕	傅育宁

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	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-45,510,961.06
本期利润	-83,276,140.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0598
本期加权平均净值利润率	-6.77%
本期基金份额净值增长率	-6.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,376,386,962.23

期末可供分配基金份额利润	-0.9391
期末基金资产净值	1,288,739,761.89
期末基金份额净值	0.8793
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	127.49%

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	1.05%	0.73%	0.39%	0.74%	0.66%	-0.01%
过去三个月	1.51%	0.83%	0.85%	0.83%	0.66%	0.00%
过去六个月	-6.29%	0.99%	-6.69%	0.99%	0.40%	0.00%
过去一年	-0.85%	1.12%	-1.42%	1.11%	0.57%	0.01%
过去三年	-25.64%	1.23%	-27.36%	1.23%	1.72%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	127.49%	1.68%	94.51%	1.68%	32.98%	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

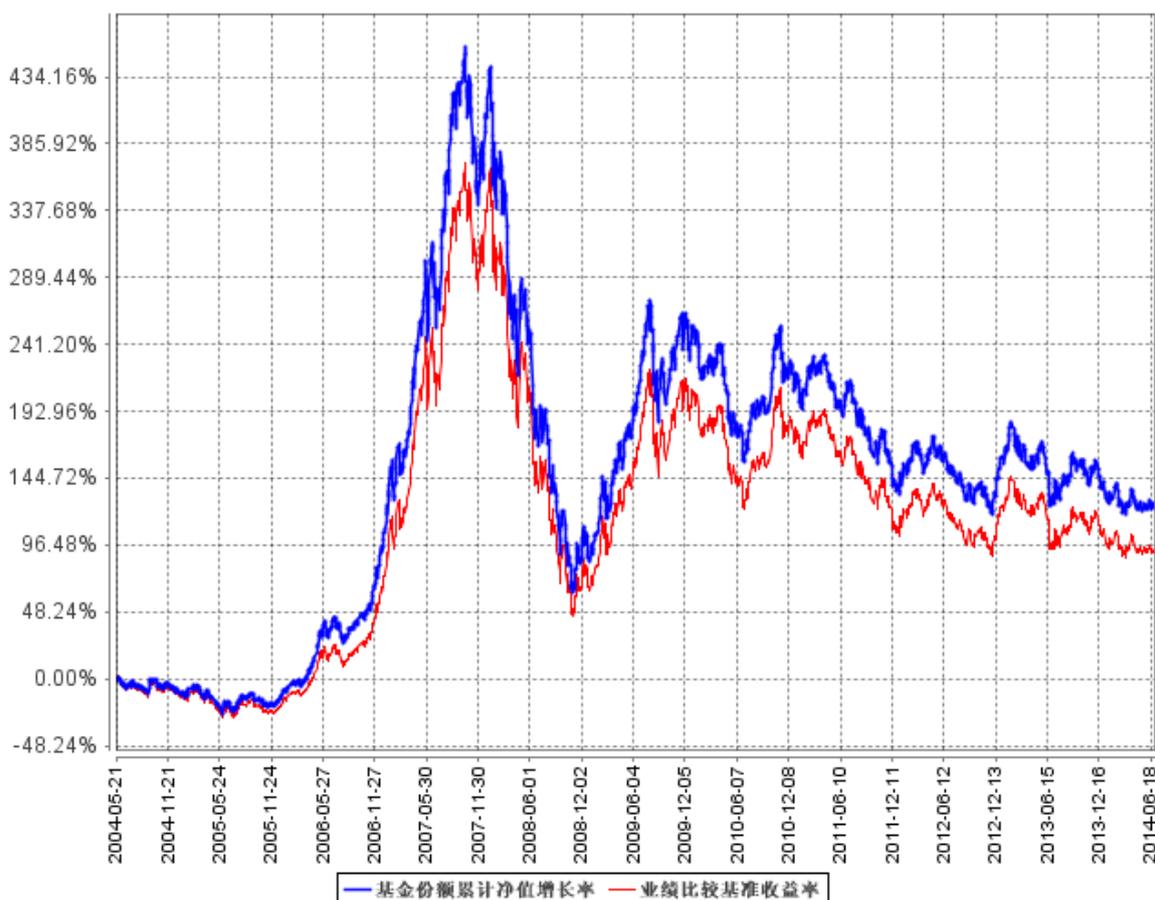
这里的每日业绩比较基准收益率计算公式如下：

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%。

指数收益率均以当日收盘价相对于上一交易日收盘价计算而成；计算银行同业存款每日利率时，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%。

§ 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，由长城证券有限责任公司（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有限责任公司（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。

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、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	14 年	男，中国籍，北京大学力学系理学学士，北京大学光华管理学院经济学硕士，注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部，2001 年 10 月进入长城基金管理公司，曾任基金经理助理、“长

					城安心回报混合型证券投资基金”和“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，外部宏观经济环境相对稳定。美国经济复苏波澜不惊，就业市场不断向好，美联储

有节奏地减少 QE 规模，加息预期也不断被提前。欧元区经济仍在低位徘徊，欧洲央行进一步降息以提振经济，隔夜存款利率甚至已经调整到负利率。在稳定的外部环境下，我国出口数据有所好转。但是国内需求则明显不足，房地产市场成交清淡，地产开发投资增速下滑，社会消费品零售总额同比保持低速增长，进口低迷。二季度后政府和央行明显加大了稳增长的政策力度，不断推出微刺激政策和定向宽松（放松存贷比、定向降准、再贷款等）政策以保持 GDP 增长达到预期调控目标，二季度各月数据看效果有所显现，但是增长动力仍然较弱。在宏观经济有所企稳的环境下，A 股市场仍然呈现冰火两重天的走势。IPO 上半年两度启动，定价水平有所降低，超募资金现象得到遏制，但是上市后被爆炒依旧。年内 100 家左右的预计发行数量大大低于市场此前的预期。在宏观经济未显示新的增长动力、市场存量资金博弈态势依旧的格局下，中小市值个股和新兴产业个股仍然成为市场资金关注的重点。大市值、传统经济相关的个股继续成为被抛弃的对象，蕴含新兴产业主题的信息安全、信息消费、军工、互联网（游戏、教育）、新能源汽车成为市场持续的热点。本基金报告期内严格遵守基金合同，严控跟踪误差，总体操作基本得当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金目标指数沪深 300 指数涨幅为-7.08%，本基金比较基准涨幅为-6.69%，本基金净值增长率为 -6.29%。本基金报告期内日均跟踪误差为 0.00357%，年化跟踪误差为 0.5525%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，定向宽松、微刺激政策的不断推出证明中央政府稳增长的决心是比较大的，随着上半年稳增长的政策逐步落实，以及后续政策的推出，完成全年的经济目标问题不大，但是能否从中长期缓解和消除宏观经济对房地产行业的严重依赖和真正有效提振内需还需要观察。房地产走势是下半年的重要不确定因素。地方政府不断为地产松绑，各地陆续取消限购是大概率事件，但是在人口红利消退，刚性需求被透支的情况下，这些政策能起到多大的作用也需要观察。我们认为，随着稳增长预期的增强，上半年投资进度严重滞后的电网、高铁、节能减排、智能装备等将面临较大的发展机遇。如果政策能够有效降低实体经济的资金成本，走低的无风险收益率必然提升股市的吸引力，加之沪港通政策的落实，由于资金紧张被持续压制的 A 股市场有望迎来估值修复。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。本基金将继续按照基金合同的规定，努力控制跟踪偏差，争取获得适度超越目标指数的超额收益。

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、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，为受托资产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。监察稽核人员对受托资产估值委员会做出的决议进行合规性审查，对受托资产估值委员会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

基金经理作为受托资产估值委员会成员，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。基金经理有权出席受托资产估值委员会会议，但不得干涉受托资产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

受托资产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、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

本基金管理人尚未就没有市价的投资品种的定价服务签署任何协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》规定的收益分配原则为：基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成。

截止本报告期末，本基金可供分配利润为-1,376,386,962.23 元，不进行收益分配。

§ 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，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	215,463,482.90	87,240,807.41
结算备付金		26,384.38	34,059.13
存出保证金		186,415.07	730,491.75

交易性金融资产	6.4.7.2	1, 214, 861, 912. 59	1, 424, 733, 546. 80
其中：股票投资		1, 214, 861, 912. 59	1, 424, 733, 546. 80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	30, 207, 065. 91
应收利息	6.4.7.5	15, 998. 20	19, 272. 03
应收股利		-	-
应收申购款		113, 808. 00	548, 565. 66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1, 430, 668, 001. 14	1, 543, 513, 808. 69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		139, 139, 884. 92	-
应付赎回款		1, 267, 266. 10	1, 451, 569. 56
应付管理人报酬		911, 097. 88	1, 414, 123. 92
应付托管费		185, 938. 33	288, 596. 71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	234, 564. 20	1, 096, 954. 15
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	189, 487. 82	156, 885. 56
负债合计		141, 928, 239. 25	4, 408, 129. 90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1, 465, 600, 931. 95	1, 640, 353, 569. 06
未分配利润	6.4.7.10	-176, 861, 170. 06	-101, 247, 890. 27
所有者权益合计		1, 288, 739, 761. 89	1, 539, 105, 678. 79
负债和所有者权益总计		1, 430, 668, 001. 14	1, 543, 513, 808. 69

注：截至 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8793 元，基金份额总额 1,465,600,931.95 份。

6.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-75,013,305.74	-340,218,318.74
1.利息收入		265,968.81	525,060.03
其中：存款利息收入	6.4.7.11	265,912.60	523,276.80
债券利息收入		56.21	1,783.23
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）		-37,960,855.09	-2,315,620.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-51,292,062.68	-33,987,142.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	15,553.79	361,029.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	13,315,653.80	31,310,492.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-37,765,179.06	-338,645,753.08
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	446,759.60	217,994.74
减：二、费用		8,262,834.38	15,910,340.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,000,328.65	11,689,525.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,224,556.91	2,385,617.44
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	854,069.68	1,661,165.98
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	183,879.14	174,031.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-83,276,140.12	-356,128,659.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-83,276,140.12	-356,128,659.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,640,353,569.06	-101,247,890.27	1,539,105,678.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-83,276,140.12	-83,276,140.12
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）	-174,752,637.11	7,662,860.33	-167,089,776.78
其中：1.基金申购款	217,354,989.19	-27,039,288.40	190,315,700.79
2.基金赎回款	-392,107,626.30	34,702,148.73	-357,405,477.57
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）	1,465,600,931.95	-176,861,170.06	1,288,739,761.89
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	1,895,275,936.88	200,159.50	1,895,476,096.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-356,128,659.35	-356,128,659.35
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）	1,244,329,593.48	387,767.17	1,244,717,360.65
其中：1.基金申购款	1,415,773,315.65	3,337,974.04	1,419,111,289.69
2.基金赎回款	-171,443,722.17	-2,950,206.87	-174,393,929.04
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	3,139,605,530.36	-355,540,732.68	2,784,064,797.68

金净值)			
------	--	--	--

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：

_____ 杨光裕	_____ 熊科金	_____ 彭洪波
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

本基金的指数化投资采用分层抽样法，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。自 2011 年 4 月 1 日起，所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数，并在 2011 年 4 月 20 日前将现有的组合调整为跟踪沪深 300 指数的新组合。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。自 2011 年 4 月 1 日起本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日本基金的业绩比较基准为：95%×中信标普 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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

本基金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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金于本期未发生会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

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、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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。

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 2014 年 6 月 30 日
活期存款	215,463,482.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	215,463,482.90

注：本基金本期末投资于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 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,403,816,897.20	1,214,861,912.59	-188,954,984.61
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	1,403,816,897.20	1,214,861,912.59	-188,954,984.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,902.40
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	11.90
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	83.90
合计	15,998.20

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	234,564.20
银行间市场应付交易费用	-
合计	234,564.20

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 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,009.93
预提信息披露费	148,765.71
预提审计费	34,712.18
合计	189,487.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,640,353,569.06	1,640,353,569.06
本期申购	217,354,989.19	217,354,989.19
本期赎回(以“-”号填列)	-392,107,626.30	-392,107,626.30
本期末	1,465,600,931.95	1,465,600,931.95

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,487,702,310.07	1,386,454,419.80	-101,247,890.27
本期利润	-45,510,961.06	-37,765,179.06	-83,276,140.12
本期基金份额交易产生的变动数	156,826,308.90	-149,163,448.57	7,662,860.33

其中：基金申购款	-203,477,506.20	176,438,217.80	-27,039,288.40
基金赎回款	360,303,815.10	-325,601,666.37	34,702,148.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,376,386,962.23	1,199,525,792.17	-176,861,170.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	260,651.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,684.65
其他	3,576.09
合计	265,912.60

注：其他包括交易所结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	319,074,931.68
减：卖出股票成本总额	370,366,994.36
买卖股票差价收入	-51,292,062.68

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	238,610.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	223,000.00
减：应收利息总额	56.21
债券投资收益	15,553.79

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,315,653.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,315,653.80

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-37,765,179.06
——股票投资	-37,765,179.06
——债券投资	-
——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	-37,765,179.06

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	425,942.32
转出基金补偿收入	20,817.28
合计	446,759.60

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	854,069.68
银行间市场交易费用	-
合计	854,069.68

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,765.71
银行费用	401.25
合计	183,879.14

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，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。

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

截至本基金财务报表批准日，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

于本报告期，并无对本基金存在控制关系或重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
--------------------	----------------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
长城证券	4,089,240.17	0.79%	573,110,714.50	38.81%
东方证券	192,991,936.47	37.39%	502,189,376.80	34.01%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东方证券	238,610.00	100.00%	-	-
长城证券	-	-	9,402,812.30	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	3,722.80	0.79%	3,709.01	1.58%
东方证券	175,700.16	37.39%	84,240.77	35.91%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	519,229.32	38.70%	386,109.00	46.98%
东方证券	457,155.87	34.07%	196,678.30	23.93%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,000,328.65	11,689,525.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,307,516.68	1,723,631.82

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.98% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.98\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

2) 本期末本基金未支付的管理费余额人民币 911,097.88 元。(上年度可比期间：人民币 2,348,192.08 元)

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	1, 224, 556. 91	2, 385, 617. 44

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

2) 本期末本基金未支付的托管费余额人民币 185, 938. 33 元。(上年度可比期间：人民币 479, 222. 86 元)

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期及上年度可比期间均未投资于本基金，于本期末及上年度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，本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	215, 463, 482. 90	260, 651. 86	250, 845, 112. 28	507, 400. 99

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603328	依顿电子	2014 年 6 月 23 日	2014 年 7 月 1 日	新股流通受限	15.31	15.31	1,000	15,310.00	15,310.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600637	百视通	2014 年 5 月 29 日	重大事项停牌	32.03	-	-	149,156	4,181,408.53	4,777,466.68	-
000562	宏源证券	2013 年 10 月 31 日	重大事项停牌	8.22	2014 年 7 月 28 日	8.93	524,793	5,157,851.27	4,313,798.46	-
600832	东方明珠	2014 年 5 月 29 日	重大事项停牌	10.98	-	-	357,750	2,861,162.48	3,928,095.00	-
000009	中国宝安	2014 年 5 月 28 日	重大事项停牌	10.21	2014 年 8 月 15 日	9.33	291,203	2,931,671.83	2,973,182.63	-
601669	中国电建	2014 年 5 月 13 日	重大事项停牌	2.79	-	-	873,648	3,185,346.64	2,437,477.92	-
002570	贝因美	2014 年 6 月 19 日	重大事项停牌	14.36	-	-	132,720	2,140,168.51	1,905,859.20	-
000960	锡业股份	2014 年 5 月 6 日	重大事项停牌	12.44	2014 年 8 月 5 日	13.68	112,263	2,163,813.79	1,396,551.72	-
000878	云南铜业	2014 年 4 月 17 日	重大事项停牌	7.61	2014 年 7 月 17 日	7.50	166,102	2,951,258.19	1,264,036.22	-
600498	烽火通信	2014 年 6 月 30 日	重大事项停牌	11.91	2014 年 7 月 7 日	12.10	105,832	1,722,469.03	1,260,459.12	-
000536	华映科技	2014 年 5 月 23 日	重大事项停牌	23.10	2014 年 8 月 20 日	25.41	34,436	901,884.14	795,471.60	-

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 2014 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额为 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 2014 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所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涉及的财务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、监察稽核部和相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券, 不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估, 以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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。除 6.4.12 期末持有的流通受限股票外, 本基金持有的其他证券在本期末均能及时变现。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。

由于本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

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受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	215,463,482.90	-	-	-	-	-	215,463,482.90
结算备付金	26,384.38	-	-	-	-	-	26,384.38
存出保证金	186,415.07	-	-	-	-	-	186,415.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,214,861,912.59	1,214,861,912.59
应收利息	-	-	-	-	-	15,998.20	15,998.20
应收申购款	-	-	-	-	-	113,808.00	113,808.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	215,676,282.35	-	-	-	-	1,214,991,718.79	1,430,668,001.14
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	139,139,884.92	139,139,884.92
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,267,266.10	1,267,266.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	911,097.88	911,097.88
应付托管费	-	-	-	-	-	185,938.33	185,938.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	234,564.20	234,564.20
其他负债	-	-	-	-	-	189,487.82	189,487.82
负债总计	-	-	-	-	-	141,928,239.25	141,928,239.25
利率敏感度缺口	215,676,282.35	-	-	-	-	-	
上年度末 2013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	87,240,807.41	-	-	-	-	87,240,807.41
结算备付金	34,059.13	-	-	-	-	34,059.13
存出保证金	730,491.75	-	-	-	-	730,491.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-1,424,733,546.80	1,424,733,546.80
应收证券清算款	-	-	-	-	30,207,065.91	30,207,065.91
应收利息	-	-	-	-	19,272.03	19,272.03
应收申购款	-	-	-	-	548,565.66	548,565.66
资产总计	88,005,358.29	-	-	-	-1,455,508,450.40	1,543,513,808.69
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1,451,569.56	1,451,569.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,414,123.92	1,414,123.92
应付托管费	-	-	-	-	288,596.71	288,596.71
应付交易费用	-	-	-	-	1,096,954.15	1,096,954.15
其他负债	-	-	-	-	156,885.56	156,885.56
负债总计	-	-	-	-	4,408,129.90	4,408,129.90
利率敏感度缺口	88,005,358.29	-	-	-	-	

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金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

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：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。于本期末，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 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,214,861,912.59	94.27	1,424,733,546.80	92.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,214,861,912.59	94.27	1,424,733,546.80	92.57

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（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	60,743,095.63	68,387,210.25
	沪深 300 指数下降 5%	-60,743,095.63	-68,387,210.25

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,214,861,912.59	84.92
	其中：股票	1,214,861,912.59	84.92
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	215,489,867.28	15.06
7	其他各项资产	316,221.27	0.02
8	合计	1,430,668,001.14	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	3,882,317.29	0.30
B	采矿业	74,017,108.83	5.74
C	制造业	444,224,714.28	34.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,097,953.59	3.19
E	建筑业	36,338,965.04	2.82
F	批发和零售业	30,893,609.41	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	30,764,270.72	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,498,416.48	3.69
J	金融业	411,836,365.98	31.96
K	房地产业	56,814,871.36	4.41
L	租赁和商务服务业	10,681,105.97	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,006,498.84	0.85
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	10,842,463.25	0.84
S	综合	4,947,941.55	0.38
	合计	1,214,846,602.59	94.27

7.2.2 期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	15,310.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,310.00	0.00

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	600016	民生银行	7,707,515	47,863,668.15	3.71
2	601318	中国平安	1,171,423	46,083,780.82	3.58
3	601166	兴业银行	3,729,471	37,406,594.13	2.90
4	600000	浦发银行	3,148,052	28,489,870.60	2.21
5	600030	中信证券	1,919,737	22,000,186.02	1.71
6	000002	万科A	2,384,443	19,719,343.61	1.53
7	000001	平安银行	1,942,050	19,245,715.50	1.49
8	600837	海通证券	1,973,464	18,057,195.60	1.40
9	601288	农业银行	6,948,644	17,510,582.88	1.36
10	000651	格力电器	590,485	17,389,783.25	1.35

11	600519	贵州茅台	118,653	16,846,352.94	1.31
12	601328	交通银行	4,151,033	16,106,008.04	1.25
13	601169	北京银行	1,983,644	15,988,170.64	1.24
14	601398	工商银行	4,434,194	15,031,917.66	1.17
15	601601	中国太保	767,143	13,647,473.97	1.06
16	600887	伊利股份	403,727	13,371,438.24	1.04
17	600015	华夏银行	1,552,427	12,729,901.40	0.99
18	601818	光大银行	4,908,319	12,467,130.26	0.97
19	600104	上汽集团	807,446	12,353,923.80	0.96
20	601088	中国神华	815,356	11,855,276.24	0.92
21	601668	中国建筑	3,661,460	10,325,317.20	0.80
22	601939	建设银行	2,495,927	10,308,178.51	0.80
23	600383	金地集团	1,097,974	9,760,988.86	0.76
24	601006	大秦铁路	1,482,122	9,352,189.82	0.73
25	000858	五粮液	477,902	8,568,782.86	0.66
26	000333	美的集团	435,423	8,412,372.36	0.65
27	600900	长江电力	1,311,464	8,157,306.08	0.63
28	600048	保利地产	1,580,373	7,838,650.08	0.61
29	600585	海螺水泥	479,258	7,533,935.76	0.58
30	600028	中国石化	1,362,324	7,179,447.48	0.56
31	002024	苏宁云商	1,091,870	7,162,667.20	0.56
32	000776	广发证券	723,371	7,089,035.80	0.55
33	600111	包钢稀土	359,351	7,061,247.15	0.55
34	600050	中国联通	2,096,343	6,771,187.89	0.53
35	000538	云南白药	127,466	6,653,725.20	0.52
36	600089	特变电工	774,007	6,571,319.43	0.51
37	601857	中国石油	864,771	6,520,373.34	0.51
38	600276	恒瑞医药	195,000	6,466,200.00	0.50
39	601989	中国重工	1,312,662	6,327,030.84	0.49
40	000063	中兴通讯	479,345	6,289,006.40	0.49
41	600535	天士力	162,104	6,284,772.08	0.49
42	000895	双汇发展	169,876	6,079,862.04	0.47
43	600886	国投电力	1,166,938	5,951,383.80	0.46
44	000625	长安汽车	478,710	5,892,920.10	0.46
45	600999	招商证券	568,312	5,745,634.32	0.45
46	600690	青岛海尔	389,190	5,744,444.40	0.45
47	600674	川投能源	484,438	5,687,302.12	0.44
48	600196	复星医药	281,138	5,676,176.22	0.44
49	600518	康美药业	378,380	5,656,781.00	0.44

50	601766	中国南车	1,224,196	5,508,882.00	0.43
51	002594	比亚迪	114,070	5,417,184.30	0.42
52	600256	广汇能源	770,519	5,409,043.38	0.42
53	601688	华泰证券	684,937	5,150,726.24	0.40
54	600406	国电南瑞	384,513	5,125,558.29	0.40
55	601009	南京银行	638,982	5,111,856.00	0.40
56	600739	辽宁成大	335,084	5,103,329.32	0.40
57	600019	宝钢股份	1,223,979	5,018,313.90	0.39
58	601628	中国人寿	368,194	5,011,120.34	0.39
59	600018	上港集团	1,125,232	5,007,282.40	0.39
60	002415	海康威视	293,509	4,972,042.46	0.39
61	601901	方正证券	907,228	4,926,248.04	0.38
62	002241	歌尔声学	184,638	4,922,449.08	0.38
63	601299	中国北车	1,064,751	4,833,969.54	0.38
64	000157	中联重科	1,088,528	4,822,179.04	0.37
65	600795	国电电力	2,216,432	4,809,657.44	0.37
66	600637	百视通	149,156	4,777,466.68	0.37
67	000725	京东方 A	2,136,058	4,635,245.86	0.36
68	000338	潍柴动力	259,349	4,613,818.71	0.36
69	600703	三安光电	195,657	4,584,243.51	0.36
70	601336	新华保险	210,586	4,449,682.18	0.35
71	000423	东阿阿胶	132,309	4,408,535.88	0.34
72	000100	TCL 集团	1,898,150	4,327,782.00	0.34
73	000562	宏源证券	524,793	4,313,798.46	0.33
74	601899	紫金矿业	1,945,742	4,241,717.56	0.33
75	002304	洋河股份	83,532	4,239,249.00	0.33
76	601988	中国银行	1,661,988	4,238,069.40	0.33
77	600352	浙江龙盛	261,093	4,216,651.95	0.33
78	000069	华侨城 A	897,581	4,209,654.89	0.33
79	002450	康得新	184,610	4,199,877.50	0.33
80	600315	上海家化	114,363	4,191,403.95	0.33
81	000581	威孚高科	154,028	4,154,135.16	0.32
82	002236	大华股份	148,240	3,995,068.00	0.31
83	600804	鹏博士	275,816	3,982,783.04	0.31
84	002353	杰瑞股份	98,950	3,982,737.50	0.31
85	600832	东方明珠	357,750	3,928,095.00	0.30
86	000783	长江证券	406,210	3,899,616.00	0.30
87	002230	科大讯飞	146,106	3,886,419.60	0.30
88	000568	泸州老窖	235,077	3,850,561.26	0.30

89	600309	万华化学	253,962	3,850,063.92	0.30
90	002065	东华软件	187,234	3,767,148.08	0.29
91	600031	三一重工	746,553	3,762,627.12	0.29
92	601998	中信银行	863,031	3,685,142.37	0.29
93	600893	航空动力	138,816	3,577,288.32	0.28
94	002038	双鹭药业	79,973	3,564,396.61	0.28
95	002202	金风科技	374,975	3,558,512.75	0.28
96	600600	青岛啤酒	88,678	3,552,440.68	0.28
97	600150	中国船舶	168,312	3,544,650.72	0.28
98	002008	大族激光	203,900	3,535,626.00	0.27
99	000768	中航飞机	334,832	3,525,780.96	0.27
100	601186	中国铁建	764,367	3,523,731.87	0.27
101	600066	宇通客车	217,527	3,510,885.78	0.27
102	600109	国金证券	176,349	3,504,054.63	0.27
103	600100	同方股份	386,700	3,445,497.00	0.27
104	601390	中国中铁	1,313,394	3,388,556.52	0.26
105	600340	华夏幸福	134,610	3,388,133.70	0.26
106	600332	白云山	136,078	3,386,981.42	0.26
107	600583	海油工程	454,508	3,349,723.96	0.26
108	601377	兴业证券	382,838	3,300,063.56	0.26
109	000402	金融街	600,331	3,271,803.95	0.25
110	002456	欧菲光	151,478	3,246,173.54	0.25
111	000400	许继电气	160,580	3,219,629.00	0.25
112	002142	宁波银行	347,388	3,195,969.60	0.25
113	000793	华闻传媒	270,050	3,173,087.50	0.25
114	600009	上海机场	244,232	3,150,592.80	0.24
115	600079	人福医药	104,763	3,127,175.55	0.24
116	002081	金螳螂	218,978	3,100,728.48	0.24
117	601607	上海医药	243,735	3,029,626.05	0.24
118	600718	东软集团	220,674	2,976,892.26	0.23
119	000009	中国宝安	291,203	2,973,182.63	0.23
120	600010	宝钢股份	816,821	2,956,892.02	0.23
121	600271	航天信息	141,459	2,952,249.33	0.23
122	600705	中航投资	183,422	2,947,591.54	0.23
123	600839	四川长虹	938,412	2,890,308.96	0.22
124	002465	海格通信	181,250	2,887,312.50	0.22
125	600027	华电国际	935,495	2,871,969.65	0.22
126	000826	桑德环境	125,547	2,868,748.95	0.22
127	000963	华东医药	52,960	2,859,840.00	0.22

128	600085	同仁堂	163,050	2,841,961.50	0.22
129	600489	中金黄金	372,202	2,828,735.20	0.22
130	000039	中集集团	209,712	2,822,723.52	0.22
131	601991	大唐发电	792,630	2,821,762.80	0.22
132	600372	中航电子	124,308	2,818,062.36	0.22
133	600118	中国卫星	151,213	2,794,416.24	0.22
134	600660	福耀玻璃	331,607	2,785,498.80	0.22
135	002400	省广股份	113,300	2,784,914.00	0.22
136	600547	山东黄金	179,862	2,784,263.76	0.22
137	601168	西部矿业	501,099	2,741,011.53	0.21
138	000024	招商地产	259,530	2,704,302.60	0.21
139	000623	吉林敖东	173,084	2,686,263.68	0.21
140	000831	五矿稀土	128,034	2,686,153.32	0.21
141	600252	中恒集团	227,652	2,670,357.96	0.21
142	601117	中国化学	507,301	2,643,038.21	0.21
143	601098	中南传媒	181,848	2,625,885.12	0.20
144	000917	电广传媒	171,100	2,605,853.00	0.20
145	600177	雅戈尔	368,303	2,589,170.09	0.20
146	600642	申能股份	595,668	2,573,285.76	0.20
147	601808	中海油服	145,404	2,557,656.36	0.20
148	000060	中金岭南	374,451	2,546,266.80	0.20
149	600597	光明乳业	157,714	2,529,732.56	0.20
150	000970	中科三环	212,829	2,528,408.52	0.20
151	600741	华域汽车	258,021	2,523,445.38	0.20
152	002410	广联达	95,100	2,514,444.00	0.20
153	603000	人民网	63,652	2,494,521.88	0.19
154	601633	长城汽车	98,354	2,488,356.20	0.19
155	600362	江西铜业	202,679	2,486,871.33	0.19
156	601929	吉视传媒	215,300	2,463,032.00	0.19
157	601888	中国国旅	74,159	2,450,213.36	0.19
158	002475	立讯精密	74,700	2,448,666.00	0.19
159	601669	中国电建	873,648	2,437,477.92	0.19
160	000792	盐湖股份	161,544	2,434,468.08	0.19
161	600221	海南航空	1,446,435	2,415,546.45	0.19
162	600649	城投控股	383,155	2,413,876.50	0.19
163	002422	科伦药业	60,021	2,391,836.85	0.19
164	600867	通化东宝	181,300	2,362,339.00	0.18
165	600369	西南证券	275,659	2,356,884.45	0.18
166	601018	宁波港	1,022,553	2,321,195.31	0.18

167	000061	农产品	251,374	2,320,182.02	0.18
168	000012	南玻A	335,193	2,289,368.19	0.18
169	600153	建发股份	419,011	2,283,609.95	0.18
170	000728	国元证券	241,664	2,281,308.16	0.18
171	000598	兴蓉投资	477,590	2,278,104.30	0.18
172	000629	攀钢钒钛	1,093,984	2,275,486.72	0.18
173	601333	广深铁路	883,161	2,243,228.94	0.17
174	000729	燕京啤酒	343,125	2,230,312.50	0.17
175	002385	大北农	196,225	2,229,116.00	0.17
176	601555	东吴证券	311,060	2,214,747.20	0.17
177	000503	海虹控股	113,300	2,209,350.00	0.17
178	600549	厦门钨业	86,959	2,208,758.60	0.17
179	601933	永辉超市	345,586	2,184,103.52	0.17
180	601600	中国铝业	713,531	2,169,134.24	0.17
181	600827	友谊股份	196,647	2,159,184.06	0.17
182	000425	徐工机械	307,219	2,104,450.15	0.16
183	600029	南方航空	910,877	2,104,125.87	0.16
184	000983	西山煤电	393,070	2,071,478.90	0.16
185	600588	用友软件	146,968	2,067,839.76	0.16
186	600108	亚盛集团	373,823	2,067,241.19	0.16
187	600166	福田汽车	400,992	2,045,059.20	0.16
188	000800	一汽轿车	212,338	2,038,444.80	0.16
189	601618	中国中冶	1,191,647	2,037,716.37	0.16
190	000709	河北钢铁	1,094,909	2,036,530.74	0.16
191	000778	新兴铸管	535,144	1,985,384.24	0.15
192	600497	驰宏锌锗	214,017	1,971,096.57	0.15
193	600875	东方电气	165,635	1,966,087.45	0.15
194	600068	葛洲坝	525,011	1,947,790.81	0.15
195	000876	新希望	172,225	1,944,420.25	0.15
196	600060	海信电器	201,388	1,943,394.20	0.15
197	600655	豫园商城	262,771	1,933,994.56	0.15
198	002570	贝因美	132,720	1,905,859.20	0.15
199	600880	博瑞传播	158,600	1,877,824.00	0.15
200	600008	首创股份	303,086	1,873,071.48	0.15
201	600316	洪都航空	109,527	1,871,816.43	0.15
202	002007	华兰生物	71,475	1,865,497.50	0.14
203	000839	中信国安	244,200	1,855,920.00	0.14
204	601928	凤凰传媒	198,809	1,844,947.52	0.14
205	600688	上海石化	560,339	1,843,515.31	0.14

206	600267	海正药业	122,583	1,817,905.89	0.14
207	601118	海南橡胶	295,615	1,815,076.10	0.14
208	600516	方大炭素	188,729	1,809,911.11	0.14
209	601898	中煤能源	447,724	1,804,327.72	0.14
210	000999	华润三九	98,106	1,804,169.34	0.14
211	600208	新湖中宝	603,413	1,761,965.96	0.14
212	601179	中国西电	487,300	1,739,661.00	0.13
213	600415	小商品城	344,862	1,734,655.86	0.13
214	601699	潞安环能	228,162	1,731,749.58	0.13
215	600348	阳泉煤业	300,644	1,695,632.16	0.13
216	600436	片仔癀	21,844	1,693,565.32	0.13
217	601958	金铂股份	238,750	1,685,575.00	0.13
218	002500	山西证券	258,326	1,676,535.74	0.13
219	600143	金发科技	378,046	1,667,182.86	0.13
220	002292	奥飞动漫	45,300	1,662,510.00	0.13
221	600062	华润双鹤	96,589	1,660,364.91	0.13
222	000750	国海证券	174,915	1,652,946.75	0.13
223	002001	新 和 成	133,203	1,650,385.17	0.13
224	601231	环旭电子	52,411	1,616,355.24	0.13
225	600663	陆家嘴	100,968	1,599,333.12	0.12
226	002129	中环股份	82,233	1,568,183.31	0.12
227	000630	铜陵有色	174,713	1,565,428.48	0.12
228	000758	中色股份	156,889	1,559,476.66	0.12
229	002310	东方园林	93,372	1,541,571.72	0.12
230	601238	广汽集团	203,828	1,534,824.84	0.12
231	002294	信立泰	50,821	1,525,646.42	0.12
232	600219	南山铝业	302,365	1,517,872.30	0.12
233	600664	哈药股份	243,680	1,515,689.60	0.12
234	600115	东方航空	647,347	1,495,371.57	0.12
235	002375	亚厦股份	65,775	1,483,884.00	0.12
236	601992	金隅股份	262,900	1,477,498.00	0.11
237	002146	荣盛发展	154,341	1,461,609.27	0.11
238	000960	锡业股份	112,263	1,396,551.72	0.11
239	002344	海宁皮城	111,559	1,391,140.73	0.11
240	000883	湖北能源	260,600	1,373,362.00	0.11
241	601111	中国国航	416,972	1,371,837.88	0.11
242	600157	永泰能源	574,900	1,362,513.00	0.11
243	000413	东旭光电	181,400	1,360,500.00	0.11
244	601866	中海集运	617,488	1,302,899.68	0.10

245	002106	莱宝高科	114,031	1,288,550.30	0.10
246	600376	首开股份	296,544	1,281,070.08	0.10
247	600648	外高桥	47,912	1,276,375.68	0.10
248	600123	兰花科创	169,627	1,275,595.04	0.10
249	000878	云南铜业	166,102	1,264,036.22	0.10
250	600498	烽火通信	105,832	1,260,459.12	0.10
251	601666	平煤股份	311,042	1,256,609.68	0.10
252	600216	浙江医药	133,530	1,221,799.50	0.09
253	600259	广晟有色	31,853	1,217,740.19	0.09
254	600895	张江高科	186,585	1,216,534.20	0.09
255	002051	中工国际	74,888	1,213,185.60	0.09
256	601158	重庆水务	243,460	1,202,692.40	0.09
257	600170	上海建工	278,035	1,192,770.15	0.09
258	600058	五矿发展	110,336	1,164,044.80	0.09
259	000686	东北证券	154,006	1,104,223.02	0.09
260	000401	冀东水泥	132,120	1,074,135.60	0.08
261	000937	冀中能源	182,325	1,062,954.75	0.08
262	002653	海思科	55,039	1,056,748.80	0.08
263	002673	西部证券	96,735	1,044,738.00	0.08
264	600188	兖州煤业	149,260	1,032,879.20	0.08
265	600873	梅花生物	199,425	1,023,050.25	0.08
266	000718	苏宁环球	220,018	992,281.18	0.08
267	002470	金正大	50,900	976,771.00	0.08
268	002603	以岭药业	32,371	952,354.82	0.07
269	600809	山西汾酒	70,417	935,137.76	0.07
270	000869	张裕 A	37,573	905,885.03	0.07
271	601800	中国交建	231,439	870,210.64	0.07
272	600023	浙能电力	191,500	865,580.00	0.07
273	600546	山煤国际	231,808	829,872.64	0.06
274	600395	盘江股份	128,116	816,098.92	0.06
275	000536	华映科技	34,436	795,471.60	0.06
276	600096	云天化	109,847	772,224.41	0.06
277	603699	纽威股份	39,600	771,012.00	0.06
278	600783	鲁信创投	47,212	758,224.72	0.06
279	600633	浙报传媒	56,600	751,082.00	0.06
280	601918	国投新集	258,151	720,241.29	0.06
281	600403	大有能源	125,016	661,334.64	0.05
282	601258	庞大集团	149,207	655,018.73	0.05
283	002399	海普瑞	34,463	643,768.84	0.05

284	000961	中南建设	96,935	632,985.55	0.05
285	601139	深圳燃气	94,682	632,475.76	0.05
286	000656	金科股份	90,205	621,512.45	0.05
287	000156	华数传媒	20,279	569,637.11	0.04
288	002269	美邦服饰	50,308	418,059.48	0.03
289	603993	洛阳钼业	52,100	349,070.00	0.03
290	002416	爱施德	15,974	237,213.90	0.02
291	600998	九州通	1,100	14,729.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述积极类股票。

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	600016	民生银行	5,635,187.78	0.37
2	601318	中国平安	5,395,141.36	0.35
3	600015	华夏银行	4,697,884.48	0.31
4	600030	中信证券	4,657,116.90	0.30
5	601166	兴业银行	4,379,882.00	0.28
6	600674	川投能源	3,468,150.01	0.23
7	002008	大族激光	3,453,938.00	0.22
8	600000	浦发银行	3,338,096.00	0.22
9	601818	光大银行	2,856,482.00	0.19
10	600887	伊利股份	2,791,619.09	0.18
11	002400	省广股份	2,747,408.66	0.18
12	002465	海格通信	2,723,954.38	0.18
13	601929	吉视传媒	2,556,246.88	0.17
14	000917	电广传媒	2,531,121.61	0.16
15	002410	广联达	2,388,000.54	0.16

16	002475	立讯精密	2,370,312.25	0.15
17	000002	万科A	2,333,461.00	0.15
18	600886	国投电力	2,274,146.00	0.15
19	600867	通化东宝	2,258,775.70	0.15
20	000001	平安银行	2,251,017.70	0.15

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	600016	民生银行	16,086,497.86	1.05
2	601318	中国平安	11,297,306.80	0.73
3	601166	兴业银行	9,622,659.51	0.63
4	600000	浦发银行	5,398,599.17	0.35
5	600837	海通证券	5,232,630.82	0.34
6	000651	格力电器	4,785,759.76	0.31
7	600015	华夏银行	4,632,069.57	0.30
8	600030	中信证券	4,370,695.59	0.28
9	000002	万科A	4,167,604.08	0.27
10	601398	工商银行	3,835,941.00	0.25
11	601169	北京银行	3,824,778.26	0.25
12	600690	青岛海尔	3,653,602.79	0.24
13	000001	平安银行	3,443,308.50	0.22
14	600519	贵州茅台	3,168,473.57	0.21
15	601288	农业银行	3,031,475.71	0.20
16	600887	伊利股份	2,992,413.40	0.19
17	601601	中国太保	2,983,681.48	0.19
18	601328	交通银行	2,933,574.32	0.19
19	601901	方正证券	2,884,397.82	0.19
20	601006	大秦铁路	2,767,961.39	0.18

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	198,260,539.21
卖出股票收入（成交）总额	319,074,931.68

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 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

本报告期内本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

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	186,415.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,998.20
5	应收申购款	113,808.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,221.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	603328	依顿电子	15,310.00	0.00	新股中签

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

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
69,993	20,939.25	193,430,445.92	13.20%	1,272,170,486.03	86.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	429,001.99	0.0293%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	1,640,353,569.06
本报告期基金总申购份额	217,354,989.19
减:本报告期基金总赎回份额	392,107,626.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,465,600,931.95

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

自 2014 年 3 月 24 日起，余骏先生不再担任公司副总经理，并全职担任长城基金管理有限公司子公司长城嘉信资产管理有限公司总经理职务；自 2014 年 4 月 17 日起，杨建华先生担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

华西证券	1	319,127,823.65	61.82%	290,533.88	61.82%	-
东方证券	2	192,991,936.47	37.39%	175,700.16	37.39%	-
长城证券	2	4,089,240.17	0.79%	3,722.80	0.79%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内无交易单元增减变化，截止本报告期末共计六个交易单元。

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。

10.7.2 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
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	238,610.00	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 鞍城投(124261)”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	2014 年 1 月 10 日
2	关于恢复旗下基金所持方正证券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	2014 年 1 月 14 日
3	长城基金关于西南证券增加为代销机构并开通定投、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014 年 1 月 20 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	2014 年 1 月 23 日
5	长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“13 六安 01(124439)”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	2014 年 1 月 25 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	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014 年 2 月 15 日
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	2014 年 2 月 18 日
8	关于恢复旗下基金所持天源迪科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	2014 年 3 月 21 日
9	长城基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 26 日
10	关于恢复旗下基金所持国电清新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	2014 年 3 月 26 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	2014 年 3 月 28 日
12	长城基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	证券时报及本基金管理人网站	2014 年 3 月 28 日
13	关于恢复旗下基金所持互动娱乐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	2014 年 4 月 10 日
14	长城基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 18 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、证券时报及本基金管理人网站	2014 年 4 月 26 日
16	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	2014 年 4 月 29 日
17	关于恢复旗下基金所持拓维信息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	2014 年 5 月 21 日
18	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持停牌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	2014 年 6 月 25 日
19	长城基金管理有限公司关于恢复旗下基金所持停牌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	2014 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 本基金设立批准的相关文件
- (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

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

公司网址: <http://www.ccfund.com.cn>