

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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>8</b>
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.....	11
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
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>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>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

## § 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	904,477,854.60 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	李建红

## 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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	454,233,635.69
本期利润	460,910,447.56
加权平均基金份额本期利润	0.3916
本期加权平均净值利润率	24.30%
本期基金份额净值增长率	24.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-471,508,408.00

期末可供分配基金份额利润	-0.5213
期末基金资产净值	1,578,370,704.70
期末基金份额净值	1.7451
<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	351.48%

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	-7.21%	3.33%	-7.17%	3.32%	-0.04%	0.01%
过去三个月	9.96%	2.49%	9.99%	2.48%	-0.03%	0.01%
过去六个月	24.72%	2.16%	25.31%	2.15%	-0.59%	0.01%
过去一年	98.46%	1.75%	99.71%	1.75%	-1.25%	0.00%
过去三年	78.65%	1.42%	77.25%	1.42%	1.40%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	351.48%	1.68%	288.46%	1.69%	63.02%	-0.01%

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		
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	-	15 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, 美国经济相对于其他主要经济体一枝独秀, 欧日仍旧相对低迷, 美元维持强势, 石油等大宗商品价格维持在低位, 人民币相对美元有所贬值, 对其他货币仍然升值显著。国内宏观经济仍然呈现弱势格局, 增速继续放缓, 下行压力依然较大, 但是出现低位企稳态势。在政策放松等因素推动下房地产销售有所好转, 部分一线城市房价出现显著上涨, 社会消费相对平稳。货币政策继续延续适度宽松态势, 相继降准降息, 利率市场化稳步推进。财政政策继续托底, 同时继续深化改革、推动经济结构转型, 鼓励大众创业、支持万众创新。证券市场方面, 年初对杠杆资金进入市场的限制延缓了增量资金进场的节奏, 市场重回存量资金博弈态势, 围绕互联网的转型主题持续盛行, TMT 领涨市场, 军民融合、环保、国企改革、一带一路、京津冀一体化等主题都借助政策或者事件驱动有所表现。3 月份后, 增量基金入市节奏加快, 大盘蓝筹股有所表现, 但是投资者和关注的重点仍在互联网相关板块, 尤其是两会后, “互联网+” 大行其道, 部分相关个股短期表现、估值水平、市值规模都达到超乎想象的地步。股市成为“故事汇”, 只要有转型的愿望、拥抱互联网的决心, 市值就被高看一线, 定增注入概念、管理层增持锁定价格、股权激励描绘未来的成长, 这些都一步一步强化投资者的信心, 市值则一步一步膨胀到令人咂舌的地步, 创业板一路冲上 4000 点。最终在二季度末监管部门彻查场外配资的压迫下出现流动性问题, 指数快速回落。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, 本基金比较基准涨幅为 25.31%, 本基金净值增长率为 24.72%。本基金报告期内日均跟踪误差为 0.0571%, 年化跟踪误差为 0.8848%。

## 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, 尽管宏观经济出现企稳迹象, 上半年经济增速也超预期达到 7.0% 的水平, 但是下行压力依然存在。尽管猪价上行压力较大, 但是预期通胀率仍将保持低位。货币政策适度宽松、财政政策继续托底增长的态势仍将持续。围绕“十三五”规划, 政策着力点仍将放在推动经济增长方式转变方面, 鼓励大众创业、万众创新。证券市场经过上半年的疯狂炒作后有望恢复一定程度的理性, 监管部门对场外配资的清理和规范也会延缓增量资金进入股市的步伐, 市场不太可能出现上半年大量个股翻倍上涨的壮观景象, 投资机会将转向个股挖掘。转型成长仍将是投资者关注的重点, 缺乏业绩支撑、纯粹讲故事的公司将不再受到青睐, 具备一定估值容忍度的、积极参与转型创新的公司有望成为市场未来的中坚力量, 其中更有望诞生伟大的公司。下

半年，随着深港通的落实、A 股市场纳入 MSCI 指数体系的不断推进，资本市场会进一步对外开放，具有国际竞争优势、估值优势的公司价值有望得到提升。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、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

《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-471,508,408.00 元,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,本基金无需要说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明,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：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	110,807,953.64	115,100,757.99
结算备付金		51,899.83	50,537.04
存出保证金		576,849.10	129,393.05
交易性金融资产	6.4.7.2	1,485,268,609.91	1,990,882,352.60
其中：股票投资		1,485,268,609.91	1,990,882,352.60
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		348,209.71	2,505,358.24
应收利息	6.4.7.5	20,367.42	26,796.15
应收股利		-	-
应收申购款		5,228,925.24	2,461,801.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,602,302,814.85	2,111,156,996.10
<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		-	-
应付赎回款		21,095,779.03	11,974,879.13
应付管理人报酬		1,458,371.90	1,544,220.87
应付托管费		297,626.93	315,147.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	696,489.46	573,871.10
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	383,842.83	233,162.50
负债合计		23,932,110.15	14,641,280.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	904,477,854.60	1,498,398,195.48
未分配利润	6.4.7.10	673,892,850.10	598,117,519.92
所有者权益合计		1,578,370,704.70	2,096,515,715.40
负债和所有者权益总计		1,602,302,814.85	2,111,156,996.10

注：截至 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7451 元，基金份额总额 904,477,854.60 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：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>		474,976,724.38	-75,013,305.74
1.利息收入		392,304.30	265,968.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	392,133.61	265,912.60
债券利息收入		170.69	56.21
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）		466,215,479.96	-37,960,855.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	453,646,641.99	-51,292,062.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	405,764.51	15,553.79
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	12,163,073.46	13,315,653.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,676,811.87	-37,765,179.06
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	1,692,128.25	446,759.60
<b>减：二、费用</b>		14,066,276.82	8,262,834.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,169,519.63	6,000,328.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,871,330.53	1,224,556.91
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	2,841,699.40	854,069.68
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	183,727.26	183,879.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		460,910,447.56	-83,276,140.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		460,910,447.56	-83,276,140.12

### 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：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）	1,498,398,195.48	598,117,519.92	2,096,515,715.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	460,910,447.56	460,910,447.56
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）	-593,920,340.88	-385,135,117.38	-979,055,458.26
其中：1.基金申购款	252,230,444.62	122,411,319.22	374,641,763.84
2.基金赎回款	-846,150,785.50	-507,546,436.60	-1,353,697,222.10
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）	904,477,854.60	673,892,850.10	1,578,370,704.70
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	1,640,353,569.06	-101,247,890.27	1,539,105,678.79



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 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，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	110,807,953.64
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	110,807,953.64

注：本基金本期末未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 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	972,028,807.84	1,485,268,609.91	513,239,802.07
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	972,028,807.84	1,485,268,609.91	513,239,802.07

#### 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 2015年6月30日
应收活期存款利息	20,084.52
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	23.40
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	259.50
合计	20,367.42

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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	696,489.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	696,489.46

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	100,364.94
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	248,765.71
合计	383,842.83

### 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	1,498,398,195.48	1,498,398,195.48
本期申购	252,230,444.62	252,230,444.62
本期赎回(以“-”号填列)	-846,150,785.50	-846,150,785.50
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	904,477,854.60	904,477,854.60

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	-1,403,061,620.02	2,001,179,139.94	598,117,519.92
本期利润	454,233,635.69	6,676,811.87	460,910,447.56
本期基金份额交易产生的变动数	477,319,576.33	-862,454,693.71	-385,135,117.38
其中：基金申购款	-209,574,920.58	331,986,239.80	122,411,319.22
基金赎回款	686,894,496.91	-1,194,440,933.51	-507,546,436.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-471,508,408.00	1,145,401,258.10	673,892,850.10

### 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
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	8,093.78
其他	3,151.18
合计	392,133.61

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,295,896,411.51
减：卖出股票成本总额	842,249,769.52
买卖股票差价收入	453,646,641.99

**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	405,764.51
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	405,764.51

**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	1,494,935.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,089,000.00
减：应收利息总额	170.69
买卖债券差价收入	405,764.51

**6.4.7.13.3 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	12,163,073.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,163,073.46

### 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	6,676,811.87
——股票投资	6,676,811.87
——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	6,676,811.87

### 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	1,594,301.68
转出基金补偿收入	97,826.57
合计	1,692,128.25

### 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	2,841,699.40
银行间市场交易费用	-
合计	2,841,699.40

#### 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	34,712.18
信息披露费	148,765.71
银行费用	249.37
合计	183,727.26

#### 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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	1,546,290,037.91	99.91%	4,089,240.17	0.79%
东方证券	1,431,351.84	0.09%	192,991,936.47	37.39%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	1,494,935.20	100.00%	238,610.00	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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长城证券	1,407,739.01	99.91%	695,298.52	99.83%
东方证券	1,303.10	0.09%	1,190.94	0.17%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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
	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
当期发生的基金应支付的管理费	9,169,519.63	6,000,328.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,458,522.53	1,307,516.68

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

$$H = E \times 0.98\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	1,871,330.53	1,224,556.91

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

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

### 6.4.10.3 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，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		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
招商银行	110,807,953.64	380,888.65	215,463,482.90	260,651.86

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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：本基金于本期末未进行利润分配。

#### 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：本基金于本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
600900	长江电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项	14.35			772,684	6,510,536.73	11,088,015.40	-
600886	国投电力	2015 年 6 月 24 日	重大事项	14.87	-	-	633,402	3,581,945.86	9,418,687.74	-
000024	招商	2015	重大	36.51	-	-	196,156	3,493,053.38	7,161,655.56	-

	地产	年 4 月 3 日	事项								
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	320,677	2,535,870.17	4,925,598.72	-	
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项	42.89	-	-	108,478	1,755,439.75	4,652,621.42	-	
600153	建发股份	2015 年 6 月 29 日	重大事项	17.51	-	-	242,018	1,825,126.80	4,237,735.18	-	
000778	新兴铸管	2015 年 6 月 15 日	重大事项	12.96	-	-	314,682	1,420,042.38	4,078,278.72	-	
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	重大事项	7.00	2015 年 8 月 24 日	6.30	560,510	1,892,412.85	3,923,570.00	-	
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项	20.75	-	-	186,197	2,331,638.28	3,863,587.75	-	
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	重大事项	23.57	-	-	130,998	1,292,591.62	3,087,622.86	-	
000878	云南铜业	2015 年 6 月 8 日	重大事项	24.50	-	-	100,533	1,662,932.21	2,463,058.50	-	
002310	东方园林	2015 年 5 月 27 日	重大事项	38.30	-	-	62,341	1,265,713.82	2,387,660.30	-	
002292	奥飞动漫	2015 年 5 月 18 日	重大事项	37.29	-	-	61,818	1,058,028.39	2,305,193.22	-	
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项	8.44	-	-	267,700	2,018,900.08	2,259,388.00	-	
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月 27 日	重大事项	35.04	-	-	61,010	2,180,585.98	2,137,790.40	-	
601216	内蒙君正	2015 年 6 月 29 日	重大事项	24.07	2015 年 7 月 2 日	24.20	86,879	1,358,029.26	2,091,177.53	-	
601633	长城汽车	2015 年 6 月 19 日	重大事项	36.69	2015 年 7 月 13 日	38.50	56,014	1,994,189.85	2,055,153.66	-	

000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	62.50	2015年8月5日	69.20	30,640	1,423,438.07	1,915,000.00	-
601021	春秋航空	2015年6月26日	重大事项	126.09	2015年7月21日	113.48	14,738	2,023,231.15	1,858,314.42	-
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	77,175	1,103,433.41	1,849,113.00	-
600277	亿利能源	2015年6月1日	重大事项	14.62	-	-	114,958	971,871.33	1,680,685.96	-
002001	新和成	2015年6月30日	重大事项	17.09	2015年7月13日	18.49	77,252	1,098,116.91	1,320,236.68	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项	15.71	2015年8月19日	14.00	77,562	953,920.69	1,218,499.02	-
002416	爱施德	2015年5月5日	重大事项	20.67	2015年7月29日	18.60	11,530	161,589.95	238,325.10	-

### 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 2015 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 2015 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公司的发行的证券，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

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。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 2015 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	110,807,953.64	-	-	-	-	-	110,807,953.64
结算备付金	51,899.83	-	-	-	-	-	51,899.83
存出保证金	576,849.10	-	-	-	-	-	576,849.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,485,268,609.91	1,485,268,609.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	348,209.71	348,209.71
应收利息	-	-	-	-	-	20,367.42	20,367.42
应收申购款	4,774.53	-	-	-	-	5,224,150.71	5,228,925.24
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	111,441,477.10	-	-	-	-	1,490,861,337.75	1,602,302,814.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	21,095,779.03	21,095,779.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,458,371.90	1,458,371.90
应付托管费	-	-	-	-	-	297,626.93	297,626.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	696,489.46	696,489.46
其他负债	-	-	-	-	-	383,842.83	383,842.83
负债总计	-	-	-	-	-	23,932,110.15	23,932,110.15
利率敏感度缺口	111,441,477.10	-	-	-	-	-	
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	115,100,757.99	-	-	-	-	-	115,100,757.99
结算备付金	50,537.04	-	-	-	-	-	50,537.04
存出保证金	129,393.05	-	-	-	-	-	129,393.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,990,882,352.60	1,990,882,352.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,505,358.24	2,505,358.24
应收利息	-	-	-	-	-	26,796.15	26,796.15
应收申购款	-	-	-	-	-	2,461,801.03	2,461,801.03
资产总计	115,280,688.08	-	-	-	-	1,995,876,308.02	2,111,156,996.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,974,879.13	11,974,879.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,544,220.87	1,544,220.87
应付托管费	-	-	-	-	-	315,147.10	315,147.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	573,871.10	573,871.10
其他负债	-	-	-	-	-	233,162.50	233,162.50
负债总计	-	-	-	-	-	14,641,280.70	14,641,280.70

利率敏感度缺口	115,280,688.08	-	-	-	-	-
---------	----------------	---	---	---	---	---

#### 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均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 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	1,485,268,609.91	94.10	1,990,882,352.60	94.96
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	1,485,268,609.91	94.10	1,990,882,352.60	94.96

**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%	79,461,870.63	99,544,117.63
	沪深 300 指数下降 5%	-79,461,870.63	-99,544,117.63

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****(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 1,403,051,640.77 元，划分为第二层次的余额为人民币 82,216,969.14 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	1,485,268,609.91	92.70
	其中：股票	1,485,268,609.91	92.70
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	110,859,853.47	6.92
7	其他各项资产	6,174,351.47	0.39
8	合计	1,602,302,814.85	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	3,805,202.34	0.24
B	采矿业	67,604,168.95	4.28
C	制造业	498,188,251.55	31.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,141,800.84	4.13
E	建筑业	66,473,097.89	4.21
F	批发和零售业	31,704,992.60	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	63,432,097.98	4.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,919,934.97	5.32
J	金融业	490,115,403.82	31.05
K	房地产业	60,868,445.99	3.86
L	租赁和商务服务业	15,288,359.39	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,089,897.83	0.77

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,729,974.76	0.11
R	文化、体育和娱乐业	18,974,024.76	1.20
S	综合	4,240,412.12	0.27
	合计	1,483,576,065.79	93.99

### 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	1,243,249.02	0.08
C	制造业	4,930.00	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	238,325.10	0.02
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	206,040.00	0.01
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	1,692,544.12	0.11

### 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	601318	中国平安	698,421	57,228,616.74	3.63
2	601166	兴业银行	2,030,203	35,021,001.75	2.22
3	600016	民生银行	3,312,010	32,921,379.40	2.09
4	600000	浦发银行	1,910,599	32,403,759.04	2.05
5	600030	中信证券	1,110,173	29,874,755.43	1.89
6	600837	海通证券	1,112,423	24,250,821.40	1.54
7	601766	中国中车	1,179,765	21,660,485.40	1.37
8	000651	格力电器	310,370	19,832,643.00	1.26
9	000002	万科A	1,262,043	18,324,864.36	1.16
10	601328	交通银行	2,212,162	18,228,214.88	1.15
11	601668	中国建筑	1,936,148	16,089,389.88	1.02
12	601169	北京银行	1,204,598	16,045,245.36	1.02
13	601988	中国银行	3,163,903	15,471,485.67	0.98
14	601818	光大银行	2,883,060	15,453,201.60	0.98
15	601989	中国重工	1,036,911	15,346,282.80	0.97
16	600519	贵州茅台	59,062	15,217,324.30	0.96
17	600887	伊利股份	787,477	14,883,315.30	0.94
18	600015	华夏银行	929,096	14,131,550.16	0.90
19	601288	农业银行	3,728,141	13,831,403.11	0.88
20	601398	工商银行	2,610,391	13,782,864.48	0.87
21	000001	平安银行	941,688	13,692,143.52	0.87
22	601601	中国太保	413,561	12,481,270.98	0.79
23	601390	中国中铁	880,823	12,058,466.87	0.76
24	601006	大秦铁路	823,054	11,555,678.16	0.73
25	600900	长江电力	772,684	11,088,015.40	0.70
26	601939	建设银行	1,468,681	10,471,695.53	0.66
27	000166	申万宏源	644,162	10,467,632.50	0.66
28	000333	美的集团	274,569	10,235,932.32	0.65
29	600048	保利地产	850,561	9,713,406.62	0.62
30	000776	广发证券	426,382	9,657,552.30	0.61
31	600104	上汽集团	422,139	9,540,341.40	0.60
32	600886	国投电力	633,402	9,418,687.74	0.60
33	601009	南京银行	403,229	9,193,621.20	0.58
34	601688	华泰证券	392,015	9,067,306.95	0.57
35	600795	国电电力	1,282,103	8,936,257.91	0.57
36	002024	苏宁云商	569,923	8,719,821.90	0.55
37	600999	招商证券	320,493	8,480,244.78	0.54

38	300059	东方财富	130,000	8,201,700.00	0.52
39	600050	中国联通	1,113,896	8,164,857.68	0.52
40	000858	五粮液	249,453	7,907,660.10	0.50
41	600028	中国石化	1,071,073	7,561,775.38	0.48
42	000768	中航飞机	171,035	7,453,705.30	0.47
43	600570	恒生电子	65,165	7,301,738.25	0.46
44	600029	南方航空	499,404	7,261,334.16	0.46
45	600637	东方明珠	170,908	7,191,808.64	0.46
46	000024	招商地产	196,156	7,161,655.56	0.45
47	002415	海康威视	159,719	7,155,411.20	0.45
48	601857	中国石油	630,815	7,147,133.95	0.45
49	600518	康美药业	394,510	6,994,662.30	0.44
50	601901	方正证券	587,830	6,989,298.70	0.44
51	601377	兴业证券	508,605	6,962,802.45	0.44
52	000725	京东方 A	1,324,422	6,873,750.18	0.44
53	601628	中国人寿	217,602	6,815,294.64	0.43
54	000783	长江证券	481,460	6,716,367.00	0.43
55	601336	新华保险	109,440	6,682,406.40	0.42
56	600276	恒瑞医药	149,484	6,658,017.36	0.42
57	600109	国金证券	271,051	6,613,644.40	0.42
58	600010	包钢股份	1,272,863	6,606,158.97	0.42
59	600674	川投能源	522,766	6,539,802.66	0.41
60	000100	TCL 集团	1,126,000	6,361,900.00	0.40
61	000625	长安汽车	293,459	6,206,657.85	0.39
62	601186	中国铁建	394,758	6,170,067.54	0.39
63	000063	中兴通讯	257,593	6,133,289.33	0.39
64	000069	华侨城 A	470,360	6,105,272.80	0.39
65	600027	华电国际	540,560	6,011,027.20	0.38
66	600690	青岛海尔	195,944	5,942,981.52	0.38
67	000538	云南白药	67,975	5,864,203.25	0.37
68	600019	宝钢股份	654,503	5,720,356.22	0.36
69	601899	紫金矿业	1,115,305	5,710,361.60	0.36
70	300104	乐视网	108,079	5,594,169.04	0.35
71	600703	三安光电	176,541	5,525,733.30	0.35
72	600585	海螺水泥	257,517	5,523,739.65	0.35
73	600415	小商品城	360,654	5,510,793.12	0.35
74	600111	北方稀土	301,262	5,464,892.68	0.35
75	601088	中国神华	260,164	5,424,419.40	0.34
76	000728	国元证券	141,063	5,357,572.74	0.34

77	002450	康得新	173,499	5,309,069.40	0.34
78	601727	上海电气	354,823	5,297,507.39	0.34
79	601669	中国电建	466,684	5,292,196.56	0.34
80	600115	东方航空	429,188	5,287,596.16	0.34
81	600221	海南航空	810,501	5,179,101.39	0.33
82	600271	航天信息	77,179	4,994,253.09	0.32
83	601618	中国中冶	690,592	4,992,980.16	0.32
84	600089	特变电工	335,524	4,969,110.44	0.31
85	601600	中国铝业	529,080	4,936,316.40	0.31
86	601111	中国国航	320,677	4,925,598.72	0.31
87	600705	中航资本	211,325	4,892,173.75	0.31
88	600100	同方股份	231,078	4,850,327.22	0.31
89	601018	宁波港	546,505	4,831,104.20	0.31
90	600839	四川长虹	484,345	4,765,954.80	0.30
91	000338	潍柴动力	149,994	4,748,810.04	0.30
92	000503	海虹控股	96,486	4,727,814.00	0.30
93	600583	海油工程	280,119	4,666,782.54	0.30
94	002142	宁波银行	220,078	4,654,649.70	0.29
95	000917	电广传媒	108,478	4,652,621.42	0.29
96	600031	三一重工	479,563	4,646,965.47	0.29
97	600150	中国船舶	89,475	4,607,962.50	0.29
98	000157	中联重科	564,509	4,578,167.99	0.29
99	300024	机器人	58,686	4,534,080.36	0.29
100	600804	鹏博士	150,138	4,483,120.68	0.28
101	000402	金融街	315,364	4,456,093.32	0.28
102	601998	中信银行	574,361	4,428,323.31	0.28
103	300027	华谊兄弟	115,424	4,402,271.36	0.28
104	600118	中国卫星	76,945	4,382,787.20	0.28
105	600196	复星医药	148,780	4,305,693.20	0.27
106	601919	中国远洋	343,886	4,291,697.28	0.27
107	600893	中航动力	80,512	4,279,212.80	0.27
108	600406	国电南瑞	205,328	4,248,236.32	0.27
109	600256	广汇能源	407,515	4,238,156.00	0.27
110	600153	建发股份	242,018	4,237,735.18	0.27
111	600340	华夏幸福	138,519	4,217,903.55	0.27
112	600588	用友网络	91,681	4,206,324.28	0.27
113	600009	上海机场	132,427	4,197,935.90	0.27
114	600352	浙江龙盛	295,939	4,193,455.63	0.27
115	600535	天士力	84,159	4,187,751.84	0.27

116	601866	中海集运	438,886	4,169,417.00	0.26
117	600068	葛洲坝	352,591	4,121,788.79	0.26
118	000778	新兴铸管	314,682	4,078,278.72	0.26
119	002304	洋河股份	57,972	4,020,937.92	0.25
120	002081	金螳螂	140,461	3,959,595.59	0.25
121	601555	东吴证券	192,153	3,933,371.91	0.25
122	000039	中集集团	121,496	3,924,320.80	0.25
123	000709	河北钢铁	560,510	3,923,570.00	0.25
124	601333	广深铁路	474,567	3,900,940.74	0.25
125	600383	金地集团	306,915	3,882,474.75	0.25
126	002230	科大讯飞	110,906	3,875,055.64	0.25
127	000793	华闻传媒	186,197	3,863,587.75	0.24
128	600739	辽宁成大	157,664	3,854,884.80	0.24
129	002202	金风科技	197,523	3,845,772.81	0.24
130	600177	雅戈尔	206,809	3,776,332.34	0.24
131	002241	歌尔声学	104,981	3,768,817.90	0.24
132	002736	国信证券	150,000	3,763,500.00	0.24
133	000423	东阿阿胶	68,442	3,730,089.00	0.24
134	600005	武钢股份	510,916	3,591,739.48	0.23
135	600309	万华化学	148,523	3,591,286.14	0.23
136	600066	宇通客车	173,458	3,564,561.90	0.23
137	300070	碧水源	72,787	3,551,277.73	0.22
138	600023	浙能电力	352,463	3,496,432.96	0.22
139	600642	申能股份	344,633	3,449,776.33	0.22
140	601888	中国国旅	51,747	3,430,826.10	0.22
141	002594	比亚迪	62,107	3,430,169.61	0.22
142	600085	同仁堂	94,436	3,391,196.76	0.21
143	601800	中国交建	192,510	3,380,475.60	0.21
144	002465	海格通信	104,808	3,373,769.52	0.21
145	000559	万向钱潮	153,923	3,364,756.78	0.21
146	000623	吉林敖东	98,206	3,299,721.60	0.21
147	000060	中金岭南	174,973	3,252,748.07	0.21
148	600157	永泰能源	470,320	3,235,801.60	0.21
149	600315	上海家化	74,285	3,223,969.00	0.20
150	601991	大唐发电	402,838	3,214,647.24	0.20
151	600688	上海石化	296,139	3,177,571.47	0.20
152	000568	泸州老窖	97,284	3,172,431.24	0.20
153	002008	大族激光	110,142	3,163,278.24	0.20
154	600369	西南证券	160,007	3,144,137.55	0.20

155	300124	汇川技术	65,176	3,128,448.00	0.20
156	002673	西部证券	110,192	3,126,147.04	0.20
157	000839	中信国安	130,998	3,087,622.86	0.20
158	002065	东华软件	107,283	3,084,386.25	0.20
159	600741	华域汽车	144,064	3,075,766.40	0.19
160	601933	永辉超市	263,488	3,053,825.92	0.19
161	600398	海澜之家	167,072	3,029,015.36	0.19
162	000629	攀钢钒钛	564,151	3,023,849.36	0.19
163	300017	网宿科技	64,270	2,983,413.40	0.19
164	000686	东北证券	152,631	2,971,725.57	0.19
165	601607	上海医药	132,931	2,960,373.37	0.19
166	601898	中煤能源	257,991	2,946,257.22	0.19
167	601168	西部矿业	267,389	2,919,887.88	0.18
168	601179	中国西电	282,407	2,894,671.75	0.18
169	600649	城投控股	309,446	2,893,320.10	0.18
170	600252	中恒集团	124,898	2,872,654.00	0.18
171	000009	中国宝安	174,444	2,845,181.64	0.18
172	600018	上港集团	354,714	2,805,787.74	0.18
173	600875	东方电气	135,808	2,779,989.76	0.18
174	002456	欧菲光	82,377	2,779,399.98	0.18
175	300003	乐普医疗	68,299	2,770,890.43	0.18
176	000800	一汽轿车	110,883	2,758,769.04	0.17
177	600660	福耀玻璃	192,596	2,750,270.88	0.17
178	002500	山西证券	151,562	2,741,756.58	0.17
179	601117	中国化学	279,839	2,736,825.42	0.17
180	000046	泛海控股	186,681	2,734,876.65	0.17
181	000895	双汇发展	127,938	2,728,917.54	0.17
182	600578	京能电力	303,875	2,713,603.75	0.17
183	600663	陆家嘴	53,306	2,651,440.44	0.17
184	002236	大华股份	83,057	2,651,179.44	0.17
185	601788	光大证券	98,254	2,647,945.30	0.17
186	600489	中金黄金	203,596	2,620,280.52	0.17
187	000883	湖北能源	296,739	2,587,564.08	0.16
188	000425	徐工机械	194,848	2,585,632.96	0.16
189	002385	大北农	187,400	2,533,648.00	0.16
190	000792	盐湖股份	88,890	2,522,698.20	0.16
191	000876	新希望	129,809	2,519,592.69	0.16
192	600362	江西铜业	117,122	2,519,294.22	0.16
193	600372	中航电子	72,014	2,515,449.02	0.16

194	600718	东软集团	115,224	2,503,817.52	0.16
195	300058	蓝色光标	158,031	2,498,470.11	0.16
196	600873	梅花生物	238,538	2,490,336.72	0.16
197	600060	海信电器	100,588	2,473,458.92	0.16
198	600332	白云山	71,584	2,466,784.64	0.16
199	000878	云南铜业	100,533	2,463,058.50	0.16
200	600208	新湖中宝	318,787	2,461,035.64	0.16
201	000826	桑德环境	62,570	2,433,347.30	0.15
202	600547	山东黄金	97,050	2,397,135.00	0.15
203	600867	通化东宝	109,185	2,394,427.05	0.15
204	002310	东方园林	62,341	2,387,660.30	0.15
205	002146	荣盛发展	189,710	2,371,375.00	0.15
206	002129	中环股份	119,446	2,363,836.34	0.15
207	601808	中海油服	84,311	2,355,649.34	0.15
208	000970	中科三环	113,438	2,337,957.18	0.15
209	600827	百联股份	111,381	2,317,838.61	0.15
210	002292	奥飞动漫	61,818	2,305,193.22	0.15
211	600600	青岛啤酒	49,357	2,299,542.63	0.15
212	601098	中南传媒	99,829	2,287,082.39	0.14
213	000825	太钢不锈	320,685	2,280,070.35	0.14
214	000598	兴蓉环境	237,336	2,271,305.52	0.14
215	000061	农产品	111,158	2,267,623.20	0.14
216	000630	铜陵有色	267,700	2,259,388.00	0.14
217	600108	亚盛集团	216,981	2,247,923.16	0.14
218	002153	石基信息	17,228	2,239,467.72	0.14
219	601258	庞大集团	406,169	2,217,682.74	0.14
220	000400	许继电气	87,774	2,208,393.84	0.14
221	002038	双鹭药业	38,901	2,203,741.65	0.14
222	000581	威孚高科	69,623	2,157,616.77	0.14
223	000750	国海证券	128,411	2,157,304.80	0.14
224	000983	西山煤电	227,405	2,155,799.40	0.14
225	600170	上海建工	228,796	2,146,106.48	0.14
226	002353	杰瑞股份	61,010	2,137,790.40	0.14
227	000413	东旭光电	217,816	2,130,240.48	0.13
228	000831	五矿稀土	81,914	2,095,360.12	0.13
229	601216	内蒙君正	86,879	2,091,177.53	0.13
230	002422	科伦药业	52,196	2,089,927.84	0.13
231	603000	人民网	39,891	2,079,517.83	0.13
232	000712	锦龙股份	58,952	2,069,215.20	0.13

233	000729	燕京啤酒	198,679	2,066,261.60	0.13
234	600316	洪都航空	59,725	2,065,290.50	0.13
235	600497	驰宏锌锗	141,452	2,063,784.68	0.13
236	601633	长城汽车	56,014	2,055,153.66	0.13
237	600166	福田汽车	232,237	2,050,652.71	0.13
238	000738	中航动控	60,845	2,017,620.20	0.13
239	600008	首创股份	138,263	1,984,074.05	0.13
240	002470	金正大	89,412	1,941,134.52	0.12
241	600597	光明乳业	84,072	1,933,656.00	0.12
242	000963	华东医药	30,640	1,915,000.00	0.12
243	601992	金隅股份	158,269	1,891,314.55	0.12
244	601929	吉视传媒	124,847	1,887,686.64	0.12
245	002410	广联达	80,452	1,882,576.80	0.12
246	601225	陕西煤业	228,137	1,866,160.66	0.12
247	601021	春秋航空	14,738	1,858,314.42	0.12
248	002375	亚厦股份	77,175	1,849,113.00	0.12
249	000027	深圳能源	147,380	1,820,143.00	0.12
250	000960	锡业股份	89,804	1,809,550.60	0.11
251	601928	凤凰传媒	105,669	1,806,939.90	0.11
252	002475	立讯精密	53,215	1,799,199.15	0.11
253	600348	阳泉煤业	173,678	1,780,199.50	0.11
254	000898	鞍钢股份	238,846	1,743,575.80	0.11
255	300015	爱尔眼科	53,626	1,729,974.76	0.11
256	000999	华润三九	56,746	1,724,510.94	0.11
257	600277	亿利能源	114,958	1,680,685.96	0.11
258	600633	浙报传媒	85,265	1,671,194.00	0.11
259	600516	方大炭素	140,135	1,669,007.85	0.11
260	601699	潞安环能	171,098	1,654,517.66	0.10
261	601958	金钼股份	138,455	1,630,999.90	0.10
262	600717	天津港	108,079	1,620,104.21	0.10
263	601158	重庆水务	149,950	1,610,463.00	0.10
264	002344	海宁皮城	80,522	1,580,646.86	0.10
265	601118	海南橡胶	159,231	1,557,279.18	0.10
266	600317	营口港	245,633	1,547,487.90	0.10
267	600038	中直股份	24,961	1,546,333.95	0.10
268	002570	贝因美	79,241	1,538,067.81	0.10
269	600373	中文传媒	64,079	1,535,332.84	0.10
270	600549	厦门钨业	60,666	1,532,423.16	0.10
271	300002	神州泰岳	100,000	1,524,000.00	0.10

272	300133	华策影视	55,717	1,504,359.00	0.10
273	300146	汤臣倍健	37,845	1,486,551.60	0.09
274	300251	光线传媒	59,151	1,472,859.90	0.09
275	600648	外高桥	41,470	1,454,767.60	0.09
276	002007	华兰生物	32,606	1,444,119.74	0.09
277	600783	鲁信创投	37,226	1,395,230.48	0.09
278	002294	信立泰	47,037	1,345,258.20	0.09
279	002001	新和成	77,252	1,320,236.68	0.08
280	601099	太平洋	100,000	1,292,000.00	0.08
281	002051	中工国际	43,265	1,288,431.70	0.08
282	603288	海天味业	37,203	1,188,263.82	0.08
283	600809	山西汾酒	40,693	1,149,170.32	0.07
284	000937	冀中能源	137,064	1,099,253.28	0.07
285	002399	海普瑞	31,869	1,083,227.31	0.07
286	600998	九州通	43,518	973,062.48	0.06
287	002653	海思科	31,831	859,437.00	0.05
288	600188	兖州煤业	53,284	732,655.00	0.05
289	600485	信威集团	15,960	700,484.40	0.04
290	601231	环旭电子	30,587	520,284.87	0.03
291	000156	华数传媒	12,029	430,397.62	0.03
292	603993	洛阳钼业	30,203	373,309.08	0.02

### 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	600395	盘江股份	77,562	1,218,499.02	0.08
2	002416	爱施德	11,530	238,325.10	0.02
3	601211	国泰君安	6,000	206,040.00	0.01
4	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
5	002770	科迪乳业	500	4,930.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国中车	24,251,617.20	1.16
2	000166	申万宏源	15,786,039.16	0.75
3	601988	中国银行	13,538,186.00	0.65
4	300059	东方财富	10,544,571.84	0.50
5	601318	中国平安	9,694,850.93	0.46
6	300104	乐视网	7,294,492.00	0.35
7	600637	东方明珠	6,587,151.86	0.31
8	600016	民生银行	5,699,046.00	0.27
9	601919	中国远洋	5,022,500.00	0.24
10	600030	中信证券	4,649,276.33	0.22
11	002736	国信证券	4,628,952.00	0.22
12	601166	兴业银行	4,074,121.00	0.19
13	000046	泛海控股	3,859,169.39	0.18
14	600000	浦发银行	3,775,398.00	0.18
15	601991	大唐发电	3,635,069.00	0.17
16	600005	武钢股份	3,599,045.00	0.17
17	601788	光大证券	3,495,000.00	0.17
18	300003	乐普医疗	3,455,992.00	0.16
19	600023	浙能电力	3,253,904.00	0.16
20	600837	海通证券	3,236,298.00	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	50,942,163.54	2.43
2	601318	中国平安	44,823,680.47	2.14
3	600030	中信证券	29,284,587.75	1.40
4	601166	兴业银行	28,124,694.42	1.34
5	600000	浦发银行	24,468,340.66	1.17
6	600837	海通证券	23,484,790.75	1.12
7	000002	万科A	17,058,110.14	0.81
8	000001	平安银行	16,533,202.77	0.79
9	601766	中国中车	15,691,779.66	0.75

10	000651	格力电器	15,582,672.36	0.74
11	601668	中国建筑	14,729,781.89	0.70
12	601601	中国太保	12,963,549.31	0.62
13	600519	贵州茅台	12,636,276.26	0.60
14	601328	交通银行	12,635,586.18	0.60
15	600887	伊利股份	12,125,247.97	0.58
16	601390	中国中铁	11,860,138.93	0.57
17	601818	光大银行	11,829,575.99	0.56
18	601288	农业银行	11,637,768.82	0.56
19	601088	中国神华	11,336,678.26	0.54
20	601398	工商银行	10,952,947.61	0.52

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	329,959,214.96
卖出股票收入（成交）总额	1,295,896,411.51

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

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 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

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

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

根据中信证券、海通证券 2015 年 1 月 19 日发布的公告，二者因存在为到期融资融券合约展期的问题，被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

本基金经理分析认为，长城久泰基金是一只采取指数复制策略为主的增强指数基金，复制标的指数的成分股及其权重、控制跟踪误差是本基金运作的主要目标，该行政监管措施不影响本基金经理依据基金合同和公司投资管理制度对中信证券、海通证券进行投资。

### 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	576,849.10
2	应收证券清算款	348,209.71
3	应收股利	-
4	应收利息	20,367.42
5	应收申购款	5,228,925.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,174,351.47

**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	600395	盘江股份	1,218,499.02	0.08	重大事项
2	002416	爱施德	238,325.10	0.02	重大事项

**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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
35,675	25,353.27	368,891,285.00	40.78%	535,586,569.60	59.22%

### 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	212,827.62	0.0235%

### 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	1,498,398,195.48
本报告期基金总申购份额	252,230,444.62
减:本报告期基金总赎回份额	846,150,785.50
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	904,477,854.60

## § 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，基金管理人无重大人事变动。

### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，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	
长城证券	2	1,546,290,037.91	99.91%	1,407,739.01	99.91%	-
东方证券	2	1,431,351.84	0.09%	1,303.10	0.09%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
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，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	1,494,935.20	100.00%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
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“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	中国证券报、上海证	2015 年 1 月 6 日

	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	券报、证券时报及本 基金管理人网站	
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
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 2 月 7 日
8	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
9	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
10	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
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、证 券日报及本基金管 理人网站	2015 年 3 月 14 日
12	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
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、证 券日报及本基金管 理人网站	2015 年 3 月 17 日
14	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
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 19 日
16	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 3 月 24 日

	旗下部分基金最低赎回限额的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
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 24 日
18	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
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理人网站	2015 年 4 月 4 日
20	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
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 4 月 11 日
22	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
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 28 日
24	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
25	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
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 5 月 12 日
27	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 5 月 19 日

	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
28	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
29	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
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理人网站	2015 年 5 月 26 日
31	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
32	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
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 6 月 2 日
34	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
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 6 月 4 日
36	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
37	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
38	长城基金管理有限公司关于调整	中国证券报、上海证	2015 年 6 月 19 日

	旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
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、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2015 年 6 月 20 日
40	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
41	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>