

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 25 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 2016 年 08 月 23 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 2016 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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§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	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47

§8 基金份额持有人信息	48
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.....	48
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
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
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.....	49
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
§11 备查文件目录	55
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	476,535,341.33 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		何伟	李建红

注：2016 年 7 月 1 日前长城基金管理有限公司的法定代表人为杨光裕，自 2016 年 7 月 1 日起法定代表人变更为何伟。

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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-43,592,366.04
本期利润	-192,773,763.89
加权平均基金份额本期利润	-0.2849
本期加权平均净值利润率	-22.88%
本期基金份额净值增长率	-14.24%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	-155,990,031.60
期末可供分配基金份额利润	-0.3273
期末基金资产净值	605,194,921.88
期末基金份额净值	1.2700
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	228.57%

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。

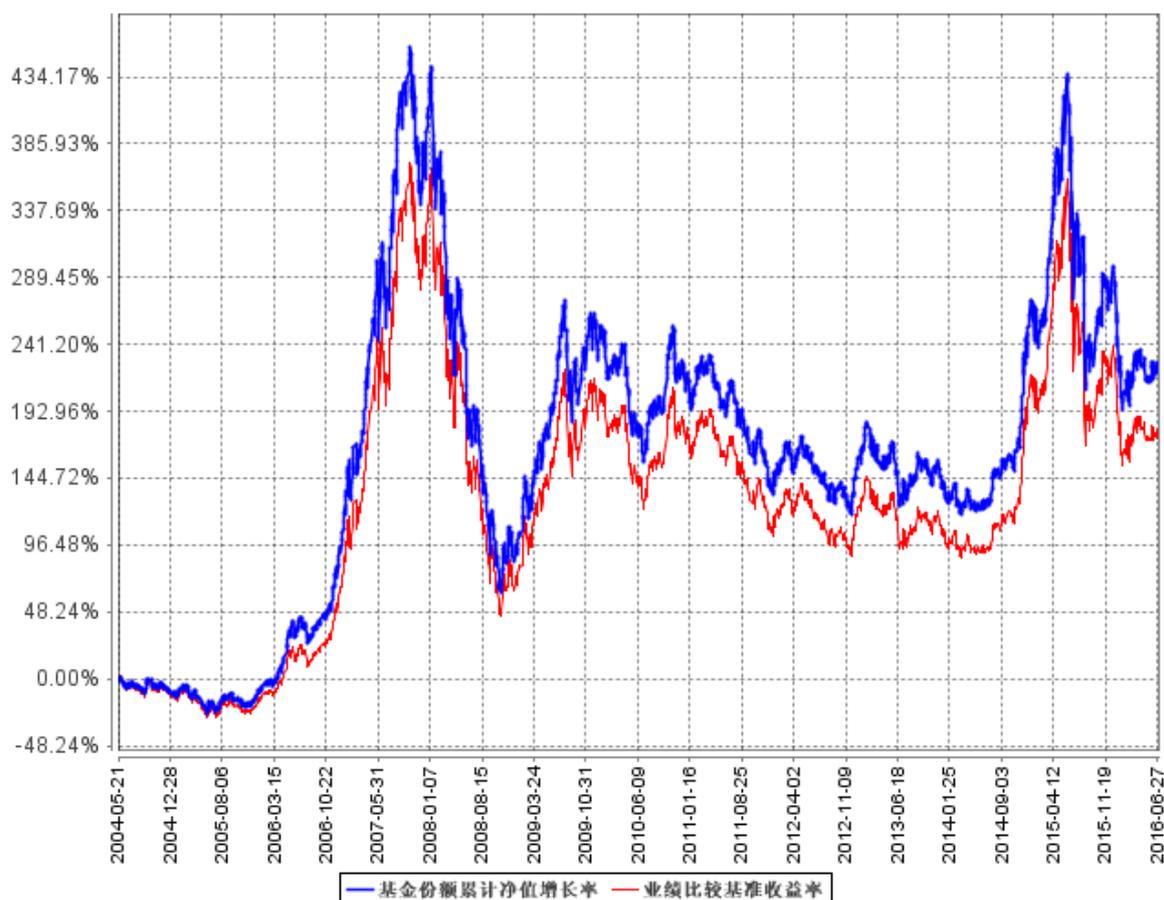
3.2 基金净值表现

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	0.87%	0.97%	-0.46%	0.93%	1.33%	0.04%
过去三个月	-0.92%	1.01%	-1.87%	0.96%	0.95%	0.05%
过去六个月	-14.24%	1.80%	-14.65%	1.75%	0.41%	0.05%
过去一年	-27.22%	2.24%	-27.99%	2.19%	0.77%	0.05%
过去三年	43.21%	1.77%	41.77%	1.75%	1.44%	0.02%
自基金合同生效日起至今	228.57%	1.74%	179.72%	1.73%	48.85%	0.01%

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%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（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：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、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、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、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、长城优化升级混合型证券投资基金、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、长城医疗保健混合型证券投资基金、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、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金、长城久安保本混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润保本混合型证券投资基金、长城久益保本混合型证券投资基金、长城新视野混合型证券投资基金、长城久源保本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	-	16 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、长城证券股份有限公司投资银行部，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“长城中小盘成长混合型证券投资基金”

					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，我国外部宏观经济环境波动加大，美国经济缓慢走弱，新增就业数据不佳，导致美联储加息不断延后，年内加息预期大幅度降低；欧元区则复苏缓慢，英国公投意外脱欧增加了欧元区经济前景的不确定性；全球避险情绪增加，贵金属价格上涨，汇率波动加大。国内宏观经济仍然比较平稳，在房地产去库存政策的推动下，房屋新开工面积增速同比转正，从而带动宏观经济增速有所回升，但是这种回升势头逐步走弱，民间投资增速仍无起色。证券市场整体上表现为先抑后扬、震荡分化的格局。年初受到人民币贬值预期增强、机构调仓、大小非减持限制到期等

因素的影响，市场在新年伊始就开始快速调整，而新实施的熔断机制则加剧了市场波动并很快被叫停。得益于美元加息预期减弱、人民币对美元汇率企稳，经济数据企稳、战略新兴板及注册制延后等利好，市场稳步反弹，并出现结构分化。存量资金博弈特征显著。新能源汽车、商品涨价预期（有色、化工、禽畜农产品等）、OLED、半导体、人工智能等主题投资受到青睐。部分行业景气度向好的白酒、乳制品等也有不错表现。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-14.65%，本基金净值增长率为-14.24%。本基金报告期内日均跟踪误差为 0.0832%，年化跟踪误差为 1.2894%。

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，但是下行压力依然存在。猪价等农产品涨幅趋缓也使得通胀率有望逐步走低。货币政策仍将维持适度宽松态势，基建环保投资有望加码。证券市场方面，监管部门明显加强了对上市公司、券商的监管，加强了资本市场的制度建设，对重组、融资、信息披露、停牌等诸多制度上的不足加以完善和提高。证券市场目前存量资金博弈的格局仍将延续，投资机会将转向个股挖掘。下半年，我们将持续关注行业景气度提升、得益于产业政策扶持的行业的投资机会，包括军民融合、新能源汽车及自动驾驶，能源互联网、VR、高端装备制造、环保、食品饮料、农产品及化工等可能得益于供给侧改革的板块，估值低、股息率高的个股也有望在资金充裕的背景下迎来估值提升。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其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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	33,026,833.41	72,259,980.66
结算备付金		243.14	18,329.71
存出保证金		346,419.18	509,390.45
交易性金融资产	6.4.7.2	573,101,105.02	1,057,057,636.36
其中：股票投资		573,101,105.02	1,056,967,236.36
基金投资		-	-
债券投资		-	90,400.00
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		512,828.50	-

应收利息	6.4.7.5	6,848.90	18,687.53
应收股利		-	-
应收申购款		43,733.87	16,913.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		607,038,012.02	1,129,880,938.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		-	-
应付赎回款		704,354.69	1,059,189.90
应付管理人报酬		481,306.01	828,006.88
应付托管费		98,225.71	168,980.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	277,034.73	466,892.98
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	282,169.00	174,462.40
负债合计		1,843,090.14	2,697,533.13
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	476,535,341.33	761,211,580.78
未分配利润	6.4.7.10	128,659,580.55	365,971,824.33
所有者权益合计		605,194,921.88	1,127,183,405.11
负债和所有者权益总计		607,038,012.02	1,129,880,938.24

注：截至 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2700 元，基金份额总额 476,535,341.33 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
一、收入		-186,153,699.02	474,976,724.38
1.利息收入		227,208.60	392,304.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	227,123.95	392,133.61
债券利息收入		84.65	170.69

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）		-37,957,279.09	466,215,479.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-43,227,538.77	453,646,641.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	63,505.08	405,764.51
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	5,206,754.60	12,163,073.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-149,181,397.85	6,676,811.87
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	757,769.32	1,692,128.25
减：二、费用		6,620,064.87	14,066,276.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,150,589.65	9,169,519.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	847,059.14	1,871,330.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,442,917.70	2,841,699.40
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	179,498.38	183,727.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-192,773,763.89	460,910,447.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-192,773,763.89	460,910,447.56

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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	761,211,580.78	365,971,824.33	1,127,183,405.11

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-192,773,763.89	-192,773,763.89
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）	-284,676,239.45	-44,538,479.89	-329,214,719.34
其中：1.基金申购款	202,394,553.68	74,605,114.87	276,999,668.55
2.基金赎回款	-487,070,793.13	-119,143,594.76	-606,214,387.89
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）	476,535,341.33	128,659,580.55	605,194,921.88
项目	上年度可比期间 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

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：

何伟

基金管理人负责人

熊科金

主管会计工作负责人

彭洪波

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人募集, 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: $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 + $5\% \times$ 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: $95\% \times$ 中信标普 300 指数收益率 + $5\% \times$ 银行同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 月 30 日止期间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 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

本基金于本期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金于本期未发生会计估计变更。

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、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	33,026,833.41
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	33,026,833.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	597,128,183.09	573,101,105.02	-24,027,078.07
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	597,128,183.09	573,101,105.02	-24,027,078.07

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 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,692.90
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	0.10
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	155.90
合计	6,848.90

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	277,034.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	277,034.73

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 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,155.62
预提费用	279,013.38
合计	282,169.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	761,211,580.78	761,211,580.78
本期申购	202,394,553.68	202,394,553.68
本期赎回 (以“-”号填)	-487,070,793.13	-487,070,793.13

列)		
本期末	476,535,341.33	476,535,341.33

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	-202,800,513.96	568,772,338.29	365,971,824.33
本期利润	-43,592,366.04	-149,181,397.85	-192,773,763.89
本期基金份额交易产生的变动数	90,402,848.40	-134,941,328.29	-44,538,479.89
其中：基金申购款	-54,646,820.62	129,251,935.49	74,605,114.87
基金赎回款	145,049,669.02	-264,193,263.78	-119,143,594.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-155,990,031.60	284,649,612.15	128,659,580.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	218,415.94
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	5,672.32
其他	3,035.69
合计	227,123.95

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

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	573,584,030.10
减：卖出股票成本总额	616,811,568.87
买卖股票差价收入	-43,227,538.77

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 2016年1月1日至2016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	63,505.08
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	63,505.08

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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	482,003.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	418,400.00
减：应收利息总额	98.52
买卖债券差价收入	63,505.08

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,206,754.60
基金投资产生的股利收益	-

合计	5,206,754.60
----	--------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-149,181,397.85
——股票投资	-149,181,397.85
——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	-149,181,397.85

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	755,637.41
转出基金补偿收入	2,131.91
合计	757,769.32

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,442,917.70
银行间市场交易费用	-
合计	1,442,917.70

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26

信息披露费	149,178.12
银行费用	485.00
合计	179,498.38

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	654,382,278.86	76.78%	1,546,290,037.91	99.91%
东方证券	4,502,999.09	0.53%	1,431,351.84	0.09%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	482,003.60	100.00%	1,494,935.20	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 2016年1月1日至2016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	609,424.18	76.78%	249,522.62	90.07%
东方证券	4,193.61	0.53%	3,066.96	1.11%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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
	2016年1月1日至2016年6月	2015年1月1日至2015年6月30

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	4,150,589.65	9,169,519.63
其中:支付销售机构的客户维护费	647,682.64	1,458,522.53

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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	847,059.14	1,871,330.53

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可比期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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 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	33,026,833.41	218,415.94	110,807,953.64	380,888.65

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（2016 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
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	4,602	59,733.96	59,733.96	
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	

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	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
------	------	------	-----	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

			因							
000651	格力电器	2016年2月22日	重大事项	22.07	-	-	659,466	11,926,494.50	14,554,414.62	-
000002	万科A	2015年12月18日	重大事项	18.20	2016年7月4日	21.99	705,759	8,526,366.04	12,844,813.80	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	321,304	1,893,444.93	1,574,389.60	-
000415	渤海金控	2016年2月1日	重大事项	6.82	2016年8月11日	7.5	224,500	1,961,827.80	1,531,090.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	111,331	1,239,570.70	1,384,957.64	-
600649	城投控股	2016年6月20日	重大事项	14.36	-	-	95,638	1,131,411.24	1,373,361.68	-
002065	东华软件	2015年12月22日	重大事项	18.72	2016年7月4日	22.59	72,685	1,314,246.93	1,360,663.20	-
000728	国元证券	2016年6月8日	重大事项	16.72	2016年7月8日	17.37	81,325	1,588,198.30	1,359,754.00	-
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项	8.29	-	-	90,328	1,023,757.28	748,819.12	-
600005	武钢股份	2016年6月27日	重大事项	2.76	-	-	250,854	1,307,683.79	692,357.04	-
000629	*ST钒钛	2016年5月26日	重大事项	2.39	-	-	277,037	968,972.10	662,118.43	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	15,126	52,487.22	316,435.92	-

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 2016 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 2016 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 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。对于本基金而言, 体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市, 其余亦可通过银行间同业市场交易, 期末除 6.4.12 中列示的部分券种流通暂时受限制不能自由转让外, 其余均能及时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值（所有者权益）的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	33,026,833.41	-	-	-	-	-	33,026,833.41
结算备付金	243.14	-	-	-	-	-	243.14
存出保证金	346,419.18	-	-	-	-	-	346,419.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	573,101,105.02	573,101,105.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	512,828.50	512,828.50
应收利息	-	-	-	-	-	6,848.90	6,848.90
应收申购款	-	-	-	-	-	43,733.87	43,733.87
资产总计	33,373,495.73	-	-	-	-	573,664,516.29	607,038,012.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	704,354.69	704,354.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	481,306.01	481,306.01
应付托管费	-	-	-	-	-	98,225.71	98,225.71

应付交易费用	-	-	-	-	-	277,034.73	277,034.73
其他负债	-	-	-	-	-	282,169.00	282,169.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,843,090.14	1,843,090.14
利率敏感度缺口	33,373,495.73	-	-	-	-	-	-
上年度末 2015 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	72,259,980.66	-	-	-	-	-	72,259,980.66
结算备付金	18,329.71	-	-	-	-	-	18,329.71
存出保证金	509,390.45	-	-	-	-	-	509,390.45
交易性金融资产	-	-	-	-	90,400.00	1,056,967,236.36	1,057,057,636.36
应收利息	-	-	-	-	-	18,687.53	18,687.53
应收申购款	-	-	-	-	-	16,913.53	16,913.53
资产总计	72,787,700.82	-	-	-	90,400.00	1,057,002,837.42	1,129,880,938.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,059,189.90	1,059,189.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	828,006.88	828,006.88
应付托管费	-	-	-	-	-	168,980.97	168,980.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	466,892.98	466,892.98
其他负债	-	-	-	-	-	174,462.40	174,462.40
负债总计	-	-	-	-	-	2,697,533.13	2,697,533.13
利率敏感度缺口	72,787,700.82	-	-	-	90,400.00	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末未持有交易性债券投资，于上年度末持有交易性债券投资的比例为 0.01%，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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	573,101,105.02	94.70	1,056,967,236.36	93.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	90,400.00	0.01
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	573,101,105.02	94.70	1,057,057,636.36	93.78

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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		29,801,257.46
沪深 300 指数下降 5%		-29,801,257.46	-53,376,845.44

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 2016 年 06 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 534,609,656.93 元，划分为第二层次的余额为人民币 38,491,448.09 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	573,101,105.02	94.41
	其中：股票	573,101,105.02	94.41
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	33,027,076.55	5.44
7	其他各项资产	909,830.45	0.15
8	合计	607,038,012.02	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境内股票投资组合

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	437,272.16	0.07
B	采矿业	18,747,297.67	3.10
C	制造业	186,213,738.70	30.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,402,955.34	3.70
E	建筑业	18,083,799.40	2.99
F	批发和零售业	12,328,864.87	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	16,883,018.62	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,194,269.56	5.82
J	金融业	204,813,297.78	33.84
K	房地产业	31,309,047.17	5.17
L	租赁和商务服务业	7,093,861.33	1.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,983,946.40	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	964,172.82	0.16
R	文化、体育和娱乐业	10,341,559.98	1.71
S	综合	2,702,838.22	0.45
	合计	571,499,940.02	94.43

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	662,118.43	0.11
C	制造业	531,992.15	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	316,435.92	0.05
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	70,492.40	0.01
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	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理	-	-

	业		
0	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	1,601,165.00	0.26

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	727,445	23,307,337.80	3.85
2	000651	格力电器	659,466	14,554,414.62	2.40
3	600016	民生银行	1,603,745	14,321,442.85	2.37
4	601166	兴业银行	892,826	13,606,668.24	2.25
5	000002	万科A	705,759	12,844,813.80	2.12
6	600036	招商银行	701,209	12,271,157.50	2.03
7	601328	交通银行	1,789,992	10,077,654.96	1.67
8	600519	贵州茅台	33,198	9,691,160.16	1.60
9	600000	浦发银行	596,394	9,285,854.58	1.53
10	600030	中信证券	528,003	8,569,488.69	1.42
11	600837	海通证券	545,037	8,404,470.54	1.39
12	601288	农业银行	2,577,531	8,248,099.20	1.36
13	601169	北京银行	686,869	7,122,831.53	1.18
14	601398	工商银行	1,600,615	7,106,730.60	1.17
15	600887	伊利股份	408,736	6,813,629.12	1.13
16	601601	中国太保	219,952	5,947,502.08	0.98
17	600900	长江电力	443,403	5,538,103.47	0.92
18	601766	中国中车	602,458	5,524,539.86	0.91
19	601668	中国建筑	991,238	5,273,386.16	0.87
20	000333	美的集团	212,236	5,034,237.92	0.83
21	601988	中国银行	1,406,651	4,515,349.71	0.75
22	600104	上汽集团	219,560	4,454,872.40	0.74
23	000858	五粮液	136,741	4,448,184.73	0.74
24	601688	华泰证券	218,732	4,138,409.44	0.68
25	601818	光大银行	1,066,226	4,009,009.76	0.66

26	000001	平安银行	442,248	3,847,557.60	0.64
27	601989	中国重工	604,783	3,828,276.39	0.63
28	600276	恒瑞医药	94,018	3,771,061.98	0.62
29	600048	保利地产	422,835	3,649,066.05	0.60
30	000725	京东方 A	1,495,464	3,454,521.84	0.57
31	600015	华夏银行	343,662	3,398,817.18	0.56
32	300104	乐视网	62,409	3,302,060.19	0.55
33	000776	广发证券	194,177	3,254,406.52	0.54
34	300059	东方财富	143,207	3,179,195.40	0.53
35	600028	中国石化	673,005	3,176,583.60	0.52
36	002024	苏宁云商	292,017	3,171,304.62	0.52
37	600999	招商证券	189,874	3,132,921.00	0.52
38	600958	东方证券	181,640	3,053,368.40	0.50
39	600518	康美药业	200,165	3,040,506.35	0.50
40	002450	康得新	173,119	2,960,334.90	0.49
41	002304	洋河股份	40,465	2,910,242.80	0.48
42	002736	国信证券	163,627	2,822,565.75	0.47
43	601377	兴业证券	354,818	2,622,105.02	0.43
44	002415	海康威视	120,659	2,589,342.14	0.43
45	601390	中国中铁	366,630	2,555,411.10	0.42
46	000783	长江证券	215,181	2,496,099.60	0.41
47	000166	申万宏源	295,873	2,488,291.93	0.41
48	601006	大秦铁路	385,645	2,483,553.80	0.41
49	002594	比亚迪	39,855	2,431,553.55	0.40
50	600795	国电电力	789,282	2,312,596.26	0.38
51	601009	南京银行	246,153	2,311,376.67	0.38
52	002739	万达院线	28,800	2,301,120.00	0.38
53	000063	中兴通讯	159,218	2,283,186.12	0.38
54	601336	新华保险	55,605	2,246,442.00	0.37
55	601857	中国石油	309,665	2,238,877.95	0.37
56	601186	中国铁建	224,240	2,233,430.40	0.37
57	601628	中国人寿	106,798	2,223,534.36	0.37
58	001979	招商蛇口	154,655	2,203,833.75	0.36
59	600570	恒生电子	32,842	2,192,860.34	0.36
60	601985	中国核电	314,400	2,147,352.00	0.35
61	601939	建设银行	451,976	2,146,886.00	0.35
62	000538	云南白药	33,386	2,146,719.80	0.35
63	000625	长安汽车	155,647	2,127,694.49	0.35
64	300017	网宿科技	31,625	2,125,200.00	0.35

65	601899	紫金矿业	630,609	2,125,152.33	0.35
66	600011	华能国际	277,990	2,090,484.80	0.35
67	600050	中国联通	546,848	2,083,490.88	0.34
68	002230	科大讯飞	63,364	2,081,507.40	0.34
69	601901	方正证券	270,420	2,071,417.20	0.34
70	600637	东方明珠	85,203	2,067,876.81	0.34
71	600271	航天信息	85,556	2,036,232.80	0.34
72	600111	北方稀土	148,048	1,970,518.88	0.33
73	002673	西部证券	74,801	1,934,353.86	0.32
74	002142	宁波银行	129,730	1,917,409.40	0.32
75	600547	山东黄金	47,556	1,850,403.96	0.31
76	601555	东吴证券	137,690	1,845,046.00	0.30
77	600585	海螺水泥	126,352	1,837,158.08	0.30
78	000100	TCL 集团	552,848	1,818,869.92	0.30
79	300024	机器人	71,076	1,804,619.64	0.30
80	601088	中国神华	127,702	1,796,767.14	0.30
81	000503	海虹控股	44,559	1,791,717.39	0.30
82	600010	包钢股份	624,824	1,786,996.64	0.30
83	601211	国泰君安	99,900	1,777,221.00	0.29
84	000423	东阿阿胶	33,534	1,771,601.22	0.29
85	300027	华谊兄弟	130,805	1,771,099.70	0.29
86	600690	青岛海尔	197,919	1,757,520.72	0.29
87	601099	太平洋	285,256	1,748,619.28	0.29
88	600893	中航动力	49,226	1,705,680.90	0.28
89	600153	建发股份	142,018	1,704,216.00	0.28
90	002241	歌尔股份	59,391	1,703,333.88	0.28
91	600100	同方股份	113,398	1,696,434.08	0.28
92	600066	宇通客车	85,142	1,685,811.60	0.28
93	600705	中航资本	283,554	1,667,297.52	0.28
94	600009	上海机场	62,775	1,635,288.75	0.27
95	600703	三安光电	81,876	1,635,063.72	0.27
96	600109	国金证券	121,091	1,632,306.68	0.27
97	601198	东兴证券	66,300	1,620,372.00	0.27
98	601669	中国电建	281,262	1,606,006.02	0.27
99	600029	南方航空	224,948	1,588,132.88	0.26
100	000839	中信国安	74,000	1,576,940.00	0.26
101	600019	宝钢股份	321,304	1,574,389.60	0.26
102	000415	渤海金控	224,500	1,531,090.00	0.25
103	600886	国投电力	229,741	1,516,290.60	0.25

104	600115	东方航空	228,701	1,511,713.61	0.25
105	600383	金地集团	145,205	1,504,323.80	0.25
106	000917	电广传媒	90,933	1,503,122.49	0.25
107	601727	上海电气	196,029	1,481,979.24	0.24
108	000069	华侨城 A	230,832	1,477,324.80	0.24
109	600535	天士力	41,261	1,475,493.36	0.24
110	600340	华夏幸福	60,306	1,470,260.28	0.24
111	002500	山西证券	88,532	1,466,089.92	0.24
112	002202	金风科技	96,891	1,465,960.83	0.24
113	300070	碧水源	98,355	1,463,522.40	0.24
114	002236	大华股份	111,668	1,462,850.80	0.24
115	601888	中国国旅	32,393	1,424,644.14	0.24
116	000568	泸州老窖	47,782	1,419,125.40	0.23
117	600485	信威集团	79,530	1,418,815.20	0.23
118	601607	上海医药	78,385	1,414,849.25	0.23
119	000768	中航飞机	71,416	1,406,181.04	0.23
120	600089	特变电工	164,725	1,403,457.00	0.23
121	002456	欧菲光	47,339	1,396,500.50	0.23
122	600177	雅戈尔	101,202	1,395,575.58	0.23
123	600023	浙能电力	273,139	1,390,277.51	0.23
124	600196	复星医药	73,065	1,389,696.30	0.23
125	000009	中国宝安	101,393	1,389,084.10	0.23
126	002465	海格通信	111,331	1,384,957.64	0.23
127	600085	同仁堂	46,348	1,380,706.92	0.23
128	600867	通化东宝	66,567	1,377,271.23	0.23
129	600649	城投控股	95,638	1,373,361.68	0.23
130	002065	东华软件	72,685	1,360,663.20	0.22
131	600804	鹏博士	74,636	1,360,614.28	0.22
132	000793	华闻传媒	137,697	1,360,446.36	0.22
133	000728	国元证券	81,325	1,359,754.00	0.22
134	600352	浙江龙盛	157,466	1,357,356.92	0.22
135	600369	西南证券	186,118	1,351,216.68	0.22
136	601600	中国铝业	356,340	1,343,401.80	0.22
137	600489	中金黄金	117,945	1,325,701.80	0.22
138	600660	福耀玻璃	94,623	1,324,722.00	0.22
139	002008	大族激光	57,607	1,315,743.88	0.22
140	000895	双汇发展	62,903	1,313,414.64	0.22
141	601919	中国远洋	256,825	1,304,671.00	0.22
142	600739	辽宁成大	82,564	1,285,521.48	0.21

143	600118	中国卫星	37,869	1,272,398.40	0.21
144	600309	万华化学	72,950	1,262,035.00	0.21
145	600221	海南航空	397,850	1,261,184.50	0.21
146	601018	宁波港	254,593	1,260,235.35	0.21
147	600406	国电南瑞	93,597	1,251,391.89	0.21
148	600061	国投安信	70,000	1,247,400.00	0.21
149	000623	吉林敖东	49,978	1,246,951.10	0.21
150	300124	汇川技术	64,260	1,246,644.00	0.21
151	601788	光大证券	72,788	1,233,028.72	0.20
152	600208	新湖中宝	286,486	1,211,835.78	0.20
153	600674	川投能源	144,593	1,194,338.18	0.20
154	000686	东北证券	92,457	1,193,619.87	0.20
155	600031	三一重工	235,491	1,182,164.82	0.20
156	000559	万向钱潮	75,555	1,178,658.00	0.19
157	002183	怡亚通	82,000	1,174,240.00	0.19
158	600741	华域汽车	83,631	1,171,670.31	0.19
159	601998	中信银行	206,097	1,168,569.99	0.19
160	601618	中国中冶	314,231	1,159,512.39	0.19
161	300003	乐普医疗	63,494	1,158,130.56	0.19
162	600446	金证股份	32,000	1,150,400.00	0.19
163	000338	潍柴动力	147,296	1,150,381.76	0.19
164	600663	陆家嘴	50,323	1,144,848.25	0.19
165	000157	中联重科	277,132	1,144,555.16	0.19
166	601111	中国国航	168,727	1,140,594.52	0.19
167	002385	大北农	139,979	1,128,230.74	0.19
168	000630	铜陵有色	442,244	1,123,299.76	0.19
169	000963	华东医药	16,453	1,108,932.20	0.18
170	600415	小商品城	177,048	1,094,156.64	0.18
171	000792	盐湖股份	51,607	1,088,907.70	0.18
172	603993	洛阳钼业	260,607	1,081,519.05	0.18
173	600018	上港集团	210,426	1,073,172.60	0.18
174	601933	永辉超市	258,712	1,068,480.56	0.18
175	600839	四川长虹	237,733	1,050,779.86	0.17
176	000876	新希望	126,284	1,050,682.88	0.17
177	002081	金螳螂	104,115	1,043,232.30	0.17
178	000826	启迪桑德	34,144	1,043,099.20	0.17
179	000046	泛海控股	103,168	1,043,028.48	0.17
180	300168	万达信息	40,000	1,039,600.00	0.17
181	600718	东软集团	56,420	1,033,614.40	0.17

182	000977	浪潮信息	44,000	1,031,800.00	0.17
183	300315	掌趣科技	97,800	1,025,922.00	0.17
184	002292	奥飞娱乐	33,955	1,016,952.25	0.17
185	000402	金融街	104,393	1,014,699.96	0.17
186	600816	安信信托	60,000	1,012,200.00	0.17
187	600398	海澜之家	89,312	1,009,225.60	0.17
188	600068	葛洲坝	173,144	1,007,698.08	0.17
189	601800	中国交建	94,589	996,022.17	0.16
190	600150	中国船舶	44,025	979,996.50	0.16
191	300144	宋城演艺	39,200	976,472.00	0.16
192	300015	爱尔眼科	26,394	964,172.82	0.16
193	000750	国海证券	129,621	957,899.19	0.16
194	002152	广电运通	58,000	953,520.00	0.16
195	002007	华兰生物	30,317	951,953.80	0.16
196	600583	海油工程	137,519	950,256.29	0.16
197	002475	立讯精密	48,197	947,071.05	0.16
198	000413	东旭光电	108,798	934,574.82	0.15
199	600332	白云山	37,687	928,607.68	0.15
200	600895	张江高科	50,800	918,464.00	0.15
201	601333	广深铁路	232,993	911,002.63	0.15
202	600157	永泰能源	230,804	909,367.76	0.15
203	000060	中金岭南	85,833	895,238.19	0.15
204	600074	保千里	60,000	895,200.00	0.15
205	601098	中南传媒	49,027	887,878.97	0.15
206	600688	上海石化	145,459	887,299.90	0.15
207	601106	中国一重	169,783	884,569.43	0.15
208	300058	蓝色光标	90,301	876,822.71	0.14
209	000425	徐工机械	285,326	873,097.56	0.14
210	600060	海信电器	49,243	870,616.24	0.14
211	600376	首开股份	78,000	867,360.00	0.14
212	600642	申能股份	150,929	866,332.46	0.14
213	600820	隧道股份	99,700	836,483.00	0.14
214	300002	神州泰岳	78,023	830,164.72	0.14
215	600256	广汇能源	200,110	820,451.00	0.14
216	000709	河钢股份	292,713	810,815.01	0.13
217	600252	中恒集团	183,827	797,809.18	0.13
218	601866	中海集运	200,004	792,015.84	0.13
219	002422	科伦药业	51,387	791,873.67	0.13
220	000738	中航动控	29,968	791,155.20	0.13

221	600873	梅花生物	126,485	785,471.85	0.13
222	601718	际华集团	101,400	774,696.00	0.13
223	600362	江西铜业	57,433	774,196.84	0.13
224	601991	大唐发电	197,763	769,298.07	0.13
225	600737	中粮屯河	66,427	767,231.85	0.13
226	601992	金隅股份	98,099	760,267.25	0.13
227	601117	中国化学	137,384	759,733.52	0.13
228	601021	春秋航空	15,827	758,746.38	0.13
229	600588	用友网络	38,543	754,671.94	0.12
230	002129	中环股份	90,328	748,819.12	0.12
231	600027	华电国际	151,002	747,459.90	0.12
232	002470	金正大	90,418	727,864.90	0.12
233	000039	中集集团	50,039	709,052.63	0.12
234	601179	中国西电	138,592	702,661.44	0.12
235	600666	奥瑞德	20,000	695,200.00	0.11
236	600005	武钢股份	250,854	692,357.04	0.11
237	000729	燕京啤酒	90,291	685,308.69	0.11
238	600037	歌华有线	45,000	684,450.00	0.11
239	000999	华润三九	27,937	676,634.14	0.11
240	000540	中天城投	108,600	676,578.00	0.11
241	600372	中航电子	34,683	675,278.01	0.11
242	000883	湖北能源	145,777	674,947.51	0.11
243	000778	新兴铸管	144,293	669,519.52	0.11
244	002153	石基信息	25,266	666,517.08	0.11
245	000061	农产品	54,499	662,707.84	0.11
246	300251	光线传媒	57,316	662,572.96	0.11
247	600373	中文传媒	31,542	654,496.50	0.11
248	600875	东方电气	66,588	653,894.16	0.11
249	603000	人民网	39,115	649,700.15	0.11
250	601633	长城汽车	76,727	647,575.88	0.11
251	300133	华策影视	41,288	642,854.16	0.11
252	000712	锦龙股份	30,496	633,096.96	0.10
253	002294	信立泰	23,195	630,904.00	0.10
254	600827	百联股份	51,932	627,338.56	0.10
255	601258	庞大集团	226,378	622,539.50	0.10
256	600038	中直股份	15,006	622,448.88	0.10
257	600170	上海建工	160,022	612,884.26	0.10
258	600021	上海电力	58,000	595,660.00	0.10
259	601898	中煤能源	115,294	594,917.04	0.10

260	000800	一汽轿车	54,399	591,861.12	0.10
261	002146	荣盛发展	87,033	584,861.76	0.10
262	600863	内蒙华电	192,781	582,198.62	0.10
263	601225	陕西煤业	112,093	579,520.81	0.10
264	601216	君正集团	76,753	573,344.91	0.09
265	601872	招商轮船	120,900	565,812.00	0.09
266	600600	青岛啤酒	19,181	557,591.67	0.09
267	601958	金铂股份	67,975	553,996.25	0.09
268	600704	物产中大	58,500	547,560.00	0.09
269	601928	凤凰传媒	51,882	546,836.28	0.09
270	600959	江苏有线	38,700	540,252.00	0.09
271	000156	华数传媒	28,991	537,783.05	0.09
272	600008	首创股份	135,792	528,230.88	0.09
273	002399	海普瑞	29,946	522,857.16	0.09
274	300085	银之杰	17,130	512,187.00	0.08
275	300146	汤臣倍健	37,070	501,927.80	0.08
276	000825	太钢不锈	157,390	497,352.40	0.08
277	600098	广州发展	60,000	469,200.00	0.08
278	000027	深圳能源	72,356	461,631.28	0.08
279	601808	中海油服	37,625	457,143.75	0.08
280	000898	鞍钢股份	117,272	449,151.76	0.07
281	002424	贵州百灵	26,000	447,200.00	0.07
282	002568	百润股份	20,000	440,000.00	0.07
283	601118	海南橡胶	78,224	437,272.16	0.07
284	600685	中船防务	17,000	431,120.00	0.07
285	002195	二三四五	35,000	430,150.00	0.07
286	601608	中信重工	77,400	415,638.00	0.07
287	600317	营口港	120,616	405,269.76	0.07
288	600582	天地科技	90,000	405,000.00	0.07
289	600648	外高桥	20,445	402,970.95	0.07
290	600783	鲁信创投	18,292	395,290.12	0.07
291	600998	九州通	21,425	375,151.75	0.06
292	600578	京能电力	85,660	366,624.80	0.06
293	002027	分众传媒	20,000	330,200.00	0.05
294	600606	绿地控股	30,000	324,600.00	0.05
295	600022	山东钢铁	130,000	308,100.00	0.05
296	600188	兖州煤业	26,201	286,638.94	0.05
297	603885	吉祥航空	7,300	191,625.00	0.03
298	601016	节能风电	15,300	151,929.00	0.03

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	000629	*ST 钒钛	277,037	662,118.43	0.11
2	601611	中国核建	15,126	316,435.92	0.05
3	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.03
4	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
5	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
6	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
7	601966	玲珑轮胎	4,602	59,733.96	0.01
8	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
9	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
10	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
11	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
12	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
13	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
14	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	601318	中国平安	10,859,135.78	0.96
2	600016	民生银行	8,348,552.00	0.74
3	601166	兴业银行	6,596,018.00	0.59
4	601328	交通银行	5,507,419.00	0.49
5	600036	招商银行	5,447,167.39	0.48
6	600000	浦发银行	5,433,735.58	0.48
7	600030	中信证券	3,994,386.00	0.35
8	601377	兴业证券	3,702,926.06	0.33
9	601398	工商银行	3,600,268.00	0.32
10	601288	农业银行	3,563,708.00	0.32

11	600837	海通证券	3,453,531.30	0.31
12	601169	北京银行	3,273,404.00	0.29
13	600900	长江电力	3,222,721.85	0.29
14	601766	中国中车	2,926,682.00	0.26
15	600519	贵州茅台	2,889,785.84	0.26
16	600887	伊利股份	2,779,661.00	0.25
17	000651	格力电器	2,770,192.50	0.25
18	600958	东方证券	2,674,704.00	0.24
19	601601	中国太保	2,670,395.00	0.24
20	001979	招商蛇口	2,590,894.25	0.23

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	601318	中国平安	23,906,134.36	2.12
2	600016	民生银行	22,173,126.50	1.97
3	601166	兴业银行	14,262,149.55	1.27
4	600000	浦发银行	13,590,323.93	1.21
5	600036	招商银行	11,424,627.27	1.01
6	600030	中信证券	9,282,639.79	0.82
7	601328	交通银行	9,218,363.00	0.82
8	600519	贵州茅台	8,412,127.24	0.75
9	601288	农业银行	8,279,502.00	0.73
10	600837	海通证券	7,793,782.98	0.69
11	601169	北京银行	7,489,354.30	0.66
12	601398	工商银行	6,528,878.74	0.58
13	601766	中国中车	6,439,229.50	0.57
14	600887	伊利股份	5,922,623.00	0.53
15	601668	中国建筑	5,901,499.00	0.52
16	601601	中国太保	5,685,929.79	0.50
17	601988	中国银行	5,015,205.00	0.44
18	600104	上汽集团	4,584,658.23	0.41
19	601989	中国重工	4,421,211.63	0.39
20	600637	东方明珠	4,372,181.41	0.39

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	282,126,835.38
卖出股票收入（成交）总额	573,584,030.10

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：本基金本报告期末未投资股指期货，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：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

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、招商银行外，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。

中信证券股份有限公司因涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，于 2015 年 11 月 26 日收到中国证监会立案调查通知书；中信证券泉州宝洲路证券营业部因存在员工违规为客户融资提供便利的问题，于 2016 年 3 月 16 日被福建证监局采取出具警示函的监督管理措施。

招商银行股份有限公司长春分行因基金销售业务存在问题，于 2016 年 1 月 6 日被吉林证监局采取责令改正的监督管理措施。

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，上述事项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、招商银行进行投资。

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	346,419.18
2	应收证券清算款	512,828.50
3	应收股利	-
4	应收利息	6,848.90
5	应收申购款	43,733.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	909,830.45

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	14,554,414.62	2.40	重大事项
2	000002	万科A	12,844,813.80	2.12	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000629	*ST 钒钛	662,118.43	0.11	重大事项
2	601611	中国核建	316,435.92	0.05	临时停牌

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
32,565	14,633.36	17,878,449.11	3.75%	458,656,892.22	96.25%

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	645,095.70	0.1354%

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	50~100
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	761,211,580.78
本报告期基金总申购份额	202,394,553.68
减:本报告期基金总赎回份额	487,070,793.13
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	476,535,341.33

§ 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**

①自 2016 年 2 月 1 日起，卢盛春先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

②由于工作调动，自 2016 年 7 月 1 日起，杨光裕先生不再担任长城基金管理有限公司董事长。

③自 2016 年 7 月 1 日起，何伟先生担任长城基金管理有限公司董事长。

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	654,382,278.86	76.78%	609,424.18	76.78%	-
华西证券	1	193,383,879.59	22.69%	180,098.51	22.69%	-
东方证券	2	4,502,999.09	0.53%	4,193.61	0.53%	-
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

(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	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	482,003.60	100.00%	-	-	-	-
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上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所实施熔断对旗下基金相关业务影响的公告	本基金管理人网站	2016 年 1 月 4 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、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 5 日
3	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	2016 年 1 月 6 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 8 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、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 12 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、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	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	2016 年 1 月 13 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、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 1 月 14 日
9	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持债券估值调整的公告	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	2016 年 1 月 20 日
10	长城基金管理有限公司关于参加平安证券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	2016 年 1 月 20 日
11	长城基金管理有限公司于调整旗下基金天天基金销售平台申购金额下限及最低持有金额下限的公告	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	2016 年 1 月 20 日
12	长城基金管理有限公司关于旗下基金所持固定收益品种估值调整的公告	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	2016 年 1 月 21 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	2016 年 1 月 27 日
14	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	2016 年 1 月 28 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	2016 年 1 月 29 日

16	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、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 2 日
17	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 2 月 4 日
18	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	2016 年 2 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	2016 年 3 月 1 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	2016 年 3 月 3 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	2016 年 3 月 19 日
22	关于增加陆金所资管为长城旗下开放式基金代销机构并同时实行费率优惠的公告	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	2016 年 3 月 21 日
23	长城基金关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投等业务的公告	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	2016 年 3 月 25 日
24	长城基金关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并实行费率优惠的公告	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	2016 年 3 月 30 日
25	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 6 日
26	长城基金关于大同证券有限责任公司开通旗下开放式基金定期定额投资业务的公告	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	2016 年 4 月 12 日

27	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
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	2016 年 5 月 6 日
29	长城基金关于增加富济财富为旗下开放式基金代销机构并开通转换定投等业务的公告	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	2016 年 5 月 9 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	2016 年 5 月 10 日
31	长城基金管理有限公司关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	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	2016 年 5 月 10 日
32	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2016 年 5 月 11 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	2016 年 6 月 1 日
34	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠的公告	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	2016 年 6 月 3 日
35	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司费率优惠的公告	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	2016 年 6 月 6 日
36	长城基金管理有限公司关于旗下基金参加国盛证券有限责任公司费率优惠的公告	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	2016 年 6 月 16 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	2016 年 6 月 18 日

38	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	2016 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>