

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 24 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 2017 年 08 月 22 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 2017 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合.....	48
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	65
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	67
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>68</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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.....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变.....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
10.8 其他重大事件.....	71
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	74

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>76</b>
12.1 备查文件目录.....	76
12.2 存放地点.....	76
12.3 查阅方式.....	76

## § 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	505,938,151.84 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）资产配置策略：本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。（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）债券投资策略：本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
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

### 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	18,771,852.36
本期利润	88,750,400.01
加权平均基金份额本期利润	0.1814
本期加权平均净值利润率	12.60%
本期基金份额净值增长率	12.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
期末可供分配利润	-126,882,835.30
期末可供分配基金份额利润	-0.2508
期末基金资产净值	781,747,503.13
期末基金份额净值	1.5451
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )
基金份额累计净值增长率	299.74%

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

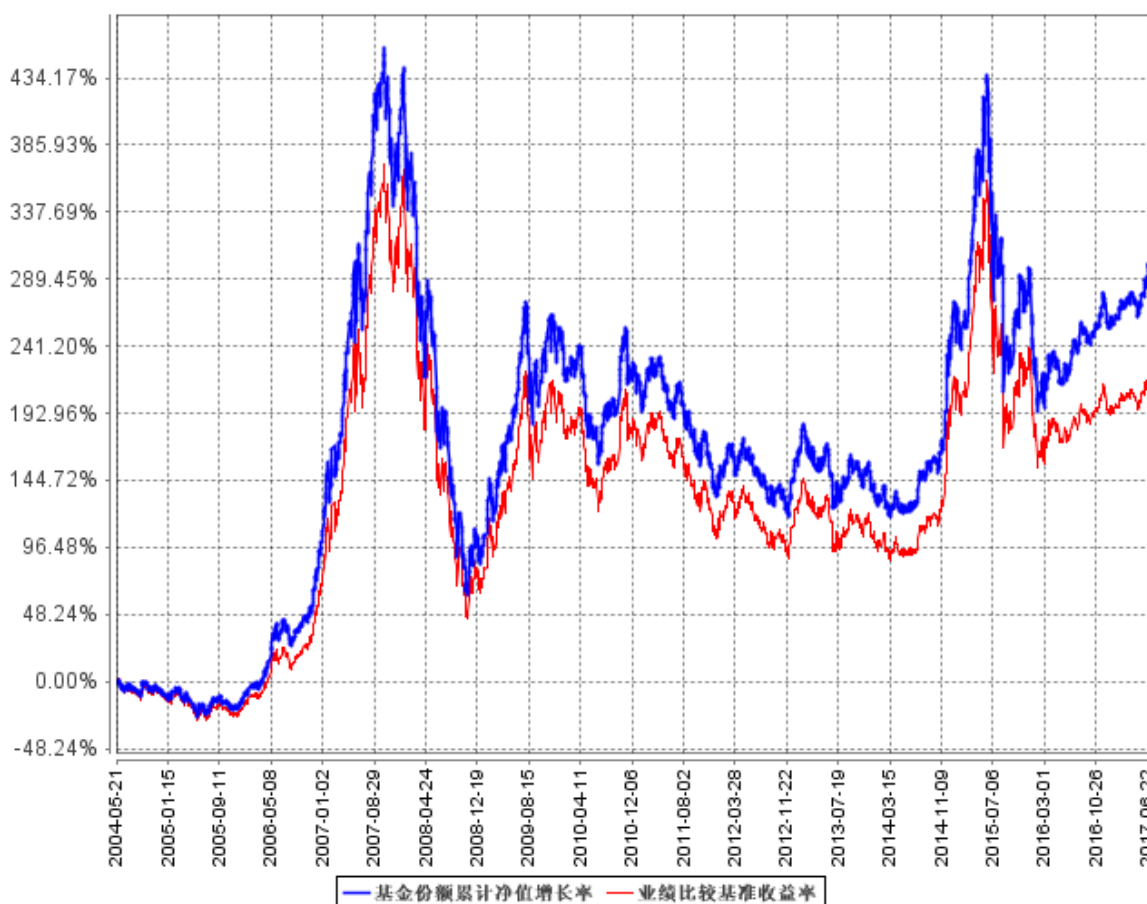
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去一个月	5.53%	0.62%	4.73%	0.64%	0.80%	-0.02%
过去三个月	7.12%	0.58%	5.80%	0.59%	1.32%	-0.01%
过去六个月	12.28%	0.54%	10.24%	0.54%	2.04%	0.00%
过去一年	21.66%	0.63%	15.46%	0.63%	6.20%	0.00%
过去三年	75.72%	1.69%	66.04%	1.66%	9.68%	0.03%
自基金合同 生效起至今	299.74%	1.68%	222.97%	1.67%	76.77%	0.01%

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

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：久嘉证券投资基金（2017 年 7 月 5 日起由封闭式基金转为开放式基金，并更名为长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金）、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、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置

混合型证券投资基金、长城创新动力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）		证券从业年限	说明
		期限			
		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、研究部总经理、长城久泰、长城品牌和长城久兆的基金经理	2004年5月21日	-	17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”，“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理、“长城久富核心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，我国面临的外部宏观经济环境稳中向好，美国经济稳健增长，欧元区经济复苏势头增强，美联储分别在三月和六月进行了预期中的二次加息，美元指数在美元加息后见顶回落，人民币对美元汇率稳中有升。国内宏观经济仍然比较平稳。尽管受到房地产调控政策不断加码、汽车购置优惠政策逐步退出、二季度金融去杠杆力度超预期等政策的影响，但是国内宏观经济表现出强大的韧性，截止 6 月末，PMI 已经连续 11 个月处于扩张区，上半年 GDP 增速更是录得超预期的 6.9%。这主要得益于三四线房地产去库存超预期，制造业投资回升、外贸形势显著改善。

证券市场也发生了深刻的制度变革，上市公司无序的资产重组和转型、以及无节制的再融资受到遏制，内幕交易、操纵股价行为受到严惩，IPO 加速发行，沪港通、深港通放开额度限制、A 股被纳入 MSCI 新兴市场指数，A 股市场国际化步伐加快，正在经历投资者结构和估值结构的重

构。上市公司的业绩被投资者摆在首要位置，纯主题炒作及忽悠式重组正逐步失去生存的土壤。A 股市场再度走向分化，处于行业龙头地位的白马蓝筹股估值获得提升，表现强劲；前些年被过度炒作的中小市值个股在 IPO 持续发行和 A 股估值国际化的双重压制下走向估值回归之路，总体看来回归过程尚未结束。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 10.24%，本基金净值增长率为 12.28%。本基金报告期内日均跟踪误差为 0.0332%，年化跟踪误差为 0.5150%。

#### 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，我们判断外需、内需、制造业投资仍能维持目前的景气态势，宏观经济仍将保持平稳。关注企业价值的投资风格仍将延续，总体判断 A 股市场仍将维持震荡分化走势。因此注重上市公司内在价值分析，挖掘具备核心竞争优势、估值与业绩增长相匹配的个股将成为我们组合构建与调整的重要出发点。在此基础上我们关注业绩稳定、分红收益率较高的蓝筹股；景气度持续、业绩稳健增长的食品饮料、家电、医药类个股；前景广阔、成长空间巨大的新材料、5G 产业链、新能源汽车产业链、人工智能领域个股。也关注得益于供给侧改革、环保硬约束环境下周期行业盈利能力恢复带来的投资机会。我们将通过对基金合同的严格遵守，对跟踪误差的严格控制，将本基金打造成为供广大投资者对 A 股市场进行投资的良好工具。本基金将继续按照基金合同的规定，努力控制跟踪偏差，争取获得适度超越目标指数的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、

行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为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

本基金本报告期末进行利润分配，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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	43,460,250.90	33,706,810.80
结算备付金		-	-
存出保证金		131,118.77	18,913.74
交易性金融资产	6.4.7.2	740,414,346.95	598,776,226.54
其中：股票投资		740,414,346.95	598,776,226.54
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		218,731.44	70,011.43
应收利息	6.4.7.5	9,077.74	7,652.81
应收股利		-	-
应收申购款		71,649.22	29,809.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		784,305,175.02	632,609,424.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		1,493,894.34	247,392.50
应付管理人报酬		607,960.94	538,297.66
应付托管费		124,073.66	109,856.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	133,278.91	77,676.24
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	198,464.04	61,357.36
负债合计		2,557,671.89	1,034,580.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	505,938,151.84	458,974,347.89
未分配利润	6.4.7.10	275,809,351.29	172,600,496.46
所有者权益合计		781,747,503.13	631,574,844.35
负债和所有者权益总计		784,305,175.02	632,609,424.79

注：截至 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5451 元，基金份额总额 505,938,151.84 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		93,876,096.90	-186,153,699.02
1.利息收入		180,537.14	227,208.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	180,468.74	227,123.95
债券利息收入		68.40	84.65
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）		23,389,351.98	-37,957,279.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,529,339.80	-43,227,538.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,039.50	63,505.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
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	5,839,972.68	5,206,754.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	69,978,547.65	-149,181,397.85
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	327,660.13	757,769.32
<b>减：二、费用</b>		5,125,696.89	6,620,064.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,438,941.54	4,150,589.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	701,824.78	847,059.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	795,283.28	1,442,917.70
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	189,647.29	179,498.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		88,750,400.01	-192,773,763.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		88,750,400.01	-192,773,763.89

### 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	458,974,347.89	172,600,496.46	631,574,844.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	88,750,400.01	88,750,400.01
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）	46,963,803.95	14,458,454.82	61,422,258.77
其中：1.基金申购款	229,030,710.96	94,518,382.78	323,549,093.74
2.基金赎回款	-182,066,907.01	-80,059,927.96	-262,126,834.97
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)	505,938,151.84	275,809,351.29	781,747,503.13
项目	上年度可比期间		
	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

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

\_\_\_\_\_  
赵永强  
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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计



入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、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。

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
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	43,460,250.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	43,460,250.90

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	661,197,068.93	740,414,346.95	79,217,278.02
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	661,197,068.93	740,414,346.95	79,217,278.02	

### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	9,018.74
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	-
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	59.00
合计	9,077.74

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 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	133,278.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	133,278.91

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 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,026.75
预提费用	188,437.29
合计	198,464.04

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	458,974,347.89	458,974,347.89
本期申购	229,030,710.96	229,030,710.96
本期赎回(以“-”号填列)	-182,066,907.01	-182,066,907.01
本期末	505,938,151.84	505,938,151.84

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	-133,570,127.43	306,170,623.89	172,600,496.46
本期利润	18,771,852.36	69,978,547.65	88,750,400.01
本期基金份额交易产生的变动数	-12,084,560.23	26,543,015.05	14,458,454.82
其中：基金申购款	-63,826,222.23	158,344,605.01	94,518,382.78
基金赎回款	51,741,662.00	-131,801,589.96	-80,059,927.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-126,882,835.30	402,692,186.59	275,809,351.29

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	176,995.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,674.53
其他	799.12
合计	180,468.74

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
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	247,090,155.86
减：卖出股票成本总额	229,560,816.06
买卖股票差价收入	17,529,339.80

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	763,107.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	743,000.00
减：应收利息总额	68.40
买卖债券差价收入	20,039.50

#### 6.4.7.13.2 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。

#### 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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	5,839,972.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,839,972.68

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	69,978,547.65
——股票投资	69,978,547.65
——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	69,978,547.65

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	323,775.94
转出基金补偿收入	3,884.19
合计	327,660.13

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	795,283.28
银行间市场交易费用	-
合计	795,283.28

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行费用	1,210.00
合计	189,647.29

**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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	186,330,797.53	34.55%	654,382,278.86	76.78%
东方证券	119,715,692.15	22.20%	4,502,999.09	0.53%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	763,107.90	100.00%	482,003.60	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 2017年1月1日至2017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	173,530.03	34.55%	-	-
东方证券	111,491.28	22.20%	46,222.10	34.68%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	3,438,941.54	4,150,589.65
其中：支付销售机构的客户维护费	697,859.44	647,682.64

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
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	701,824.78	847,059.14

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未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末

及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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	43,460,250.90	176,995.09	33,026,833.41	218,415.94

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 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
002821	凯莱英	2016 年 11 月 11 日	2017 年 11 月 20 日	新股锁定	30.53	72.97	42,818	653,616.77	3,124,429.46	-
603660	苏州科达	2016 年 11 月 21 日	2017 年 12 月 1 日	新股锁定	8.03	40.95	26,007	208,836.21	1,064,986.65	-

			日							
603823	百合花	2016 年 12 月 9 日	2017 年 12 月 20 日	新股 锁定	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 4 月 9 日	新股 锁定	29.82	73.00	6,666	198,780.12	486,618.00	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 12 日	新股 锁定	19.81	48.90	7,980	158,083.80	390,222.00	-
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股 流通 受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股 流通 受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017年4月	重大	7.47	2017年8月	8.22	528,048	2,998,931.61	3,944,518.56	-

		月 5 日	事 项 停 牌		月 21 日					
601989	中国 重工	2017 年 5 月 31 日	重 大 事 项 停 牌	6. 21	-	-	576, 983	4, 870, 074. 83	3, 583, 064. 43	-
601088	中国 神华	2017 年 6 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	22. 29	-	-	143, 802	2, 650, 816. 79	3, 205, 346. 58	-
600795	国电 电力	2017 年 6 月 5 日	重 大 事 项 停 牌	3. 60	-	-	884, 682	3, 065, 155. 70	3, 184, 855. 20	-
300104	乐视 网	2017 年 4 月 17 日	重 大 事 项 停 牌	30. 68	-	-	63, 209	3, 267, 559. 40	1, 939, 252. 12	-
601727	上海	2017	重	7. 57	2017	7. 54	231, 529	2, 388, 266. 63	1, 752, 674. 53	-

	电气	年 6 月 22 日	大 事 项 停 牌		年 7 月 03 日					
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重 大 事 项 停 牌	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	481,048	1,801,528.18	1,649,994.64	-
600100	同方 股份	2017 年 4 月 21 日	重 大 事 项 停 牌	14.12	-	-	108,298	1,449,124.27	1,529,167.76	-
601919	中远 海控	2017 年 5 月 17 日	重 大 事 项 停 牌	5.35	2017 年 7 月 26 日	5.89	245,225	2,274,138.39	1,311,953.75	-
600485	信威 集团	2016 年 12 月 26 日	重 大 事 项 停 牌	14.59	-	-	79,530	2,183,970.23	1,160,342.70	-

000503	海虹控股	2017年5月11日	重大事件停牌	24.93	-	-	46,259	1,478,780.67	1,153,236.87	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	重大事件停牌	10.57	-	-	108,610	1,346,236.88	1,148,007.70	-
002049	紫光国芯	2017年2月20日	重大事件停牌	30.82	2017年7月17日	27.74	29,900	1,016,139.00	921,518.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	重大事件停牌	7.68	-	-	110,000	1,055,420.00	844,800.00	-
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事件停	17.40	-	-	43,040	849,351.24	748,896.00	-



			牌							
002129	中环股份	2016年4月25日	重大事项停牌	8.27	-	-	90,328	1,023,757.28	747,012.56	-
600654	*ST中安	2017年6月7日	重大事项停牌	13.48	-	-	48,000	932,282.00	647,040.00	-
601872	招商轮船	2017年5月3日	重大事项停牌	5.16	-	-	115,200	746,376.37	594,432.00	-
601608	中信重工	2017年4月19日	重大事项停牌	5.54	2017年7月26日	5.26	73,900	402,519.19	409,406.00	-

### 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 2017 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 2017 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、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017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	43,460,250.90	-	-	-	-	-	43,460,250.90
存出保证金	131,118.77	-	-	-	-	-	131,118.77
交易性金融资产	-	-	-	-	-	740,414,346.95	740,414,346.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	218,731.44	218,731.44
应收利息	-	-	-	-	-	9,077.74	9,077.74
应收申购款	-	-	-	-	-	71,649.22	71,649.22
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	43,591,369.67	-	-	-	-	740,713,805.35	784,305,175.02
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	1,493,894.34	1,493,894.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	607,960.94	607,960.94
应付托管费	-	-	-	-	-	124,073.66	124,073.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	133,278.91	133,278.91
其他负债	-	-	-	-	-	198,464.04	198,464.04
负债总计	-	-	-	-	-	2,557,671.89	2,557,671.89
利率敏感度缺口	43,591,369.67	-	-	-	-	-	-
上年度末 2016 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	33,706,810.80	-	-	-	-	-	33,706,810.80
存出保证金	18,913.74	-	-	-	-	-	18,913.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	598,776,226.54	598,776,226.54
应收证券清算款	-	-	-	-	-	70,011.43	70,011.43
应收利息	-	-	-	-	-	7,652.81	7,652.81
应收申购款	-	-	-	-	-	29,809.47	29,809.47
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	33,725,724.54	-	-	-	-	598,883,700.25	632,609,424.79
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	247,392.50	247,392.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	538,297.66	538,297.66
应付托管费	-	-	-	-	-	109,856.68	109,856.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	77,676.24	77,676.24
其他负债	-	-	-	-	-	61,357.36	61,357.36
负债总计	-	-	-	-	-	1,034,580.44	1,034,580.44
利率敏感度缺口	33,725,724.54	-	-	-	-	-	-

#### 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。因此在其它变量不变的假设下，利率

发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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%。于本期末及上年度末，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	740,414,346.95	94.71	598,776,226.54	94.81
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	740,414,346.95	94.71	598,776,226.54	94.81
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 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（2017年6月 30日）	上年度末（2016年12月 31日）
	沪深 300 指数上升 5%	38,140,728.33	30,888,285.13
	沪深 300 指数下降 5%	-38,140,728.33	-30,888,285.13

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 2017 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 709,815,144.45 元，划分为第二层次的余额为人民币 30,599,202.50 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	740,414,346.95	94.40
	其中：股票	740,414,346.95	94.40
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	43,460,250.90	5.54
7	其他各项资产	430,577.17	0.05
8	合计	784,305,175.02	100.00

### 7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 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	1,851,102.32	0.24
B	采矿业	24,247,350.54	3.10
C	制造业	260,670,441.33	33.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,036,058.80	2.69



E	建筑业	33,889,069.96	4.34
F	批发和零售业	15,917,480.67	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	20,687,128.26	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,725,711.26	4.57
J	金融业	255,518,460.92	32.69
K	房地产业	37,981,329.06	4.86
L	租赁和商务服务业	6,094,789.56	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,503,723.95	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,365,100.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	8,337,944.96	1.07
S	综合	2,222,373.17	0.28
	合计	732,048,064.76	93.64

### 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	-	-
C	制造业	7,711,602.57	0.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	654,679.62	0.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,366,282.19	1.07

### 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	780,045	38,698,032.45	4.95
2	600036	招商银行	741,009	17,717,525.19	2.27
3	600519	贵州茅台	37,498	17,693,431.30	2.26
4	000651	格力电器	371,319	15,287,203.23	1.96
5	601166	兴业银行	899,866	15,171,740.76	1.94
6	000333	美的集团	325,336	14,002,461.44	1.79

7	600016	民生银行	1,699,645	13,971,081.90	1.79
8	000002	万科A	489,059	12,211,803.23	1.56
9	601328	交通银行	1,981,992	12,209,070.72	1.56
10	601668	中国建筑	1,074,438	10,400,559.84	1.33
11	600000	浦发银行	809,539	10,240,668.35	1.31
12	600030	中信证券	564,203	9,602,735.06	1.23
13	601288	农业银行	2,727,731	9,601,613.12	1.23
14	600887	伊利股份	444,536	9,597,532.24	1.23
15	600837	海通证券	600,937	8,923,914.45	1.14
16	601169	北京银行	905,643	8,304,746.31	1.06
17	000858	五粮液	146,241	8,139,774.06	1.04
18	601398	工商银行	1,546,715	8,120,253.75	1.04
19	601601	中国太保	233,052	7,893,471.24	1.01
20	600104	上汽集团	247,190	7,675,249.50	0.98
21	600900	长江电力	476,303	7,325,540.14	0.94
22	000725	京东方A	1,714,164	7,130,922.24	0.91
23	601766	中国中车	703,158	7,115,958.96	0.91
24	601211	国泰君安	320,300	6,569,353.00	0.84
25	002415	海康威视	202,938	6,554,897.40	0.84
26	600276	恒瑞医药	127,162	6,433,125.58	0.82
27	000001	平安银行	598,248	5,617,548.72	0.72
28	601988	中国银行	1,517,751	5,615,678.70	0.72
29	600048	保利地产	516,835	5,152,844.95	0.66
30	600518	康美药业	225,565	4,903,783.10	0.63
31	601390	中国中铁	540,930	4,689,863.10	0.60
32	601818	光大银行	1,136,426	4,602,525.30	0.59
33	600028	中国石化	757,905	4,494,376.65	0.57
34	601688	华泰证券	246,932	4,420,082.80	0.57

35	000063	中兴通讯	181,618	4,311,611.32	0.55
36	600015	华夏银行	464,954	4,286,875.88	0.55
37	600019	宝钢股份	636,462	4,270,660.02	0.55
38	002450	康得新	184,219	4,148,611.88	0.53
39	601186	中国铁建	331,140	3,983,614.20	0.51
40	002304	洋河股份	45,665	3,964,178.65	0.51
41	600050	中国联通	528,048	3,944,518.56	0.50
42	000776	广发证券	218,677	3,772,178.25	0.48
43	001979	招商蛇口	174,755	3,732,766.80	0.48
44	601006	大秦铁路	433,545	3,637,442.55	0.47
45	601989	中国重工	576,983	3,583,064.43	0.46
46	000538	云南白药	37,586	3,527,446.10	0.45
47	600690	青岛海尔	222,519	3,348,910.95	0.43
48	600585	海螺水泥	142,952	3,249,298.96	0.42
49	601628	中国人寿	119,898	3,234,848.04	0.41
50	601336	新华保险	62,805	3,228,177.00	0.41
51	601088	中国神华	143,802	3,205,346.58	0.41
52	600795	国电电力	884,682	3,184,855.20	0.41
53	601901	方正证券	314,320	3,121,197.60	0.40
54	601009	南京银行	277,353	3,109,127.13	0.40
55	600958	东方证券	221,240	3,077,448.40	0.39
56	002024	苏宁云商	270,417	3,042,191.25	0.39
57	600703	三安光电	148,602	2,927,459.40	0.37
58	601939	建设银行	475,076	2,921,717.40	0.37
59	600999	招商证券	168,974	2,909,732.28	0.37
60	601857	中国石油	374,665	2,881,173.85	0.37
61	002230	科大讯飞	71,464	2,851,413.60	0.36
62	600309	万华化学	99,020	2,835,932.80	0.36

63	600660	福耀玻璃	106,923	2,784,274.92	0.36
64	601985	中国核电	356,100	2,781,141.00	0.36
65	000423	东阿阿胶	38,134	2,741,453.26	0.35
66	000568	泸州老窖	53,882	2,725,351.56	0.35
67	600009	上海机场	71,175	2,655,539.25	0.34
68	002142	宁波银行	137,330	2,650,469.00	0.34
69	601899	紫金矿业	769,809	2,640,444.87	0.34
70	000069	华侨城 A	260,632	2,621,957.92	0.34
71	002236	大华股份	114,368	2,608,734.08	0.33
72	002241	歌尔股份	133,882	2,581,244.96	0.33
73	601607	上海医药	88,185	2,546,782.80	0.33
74	300070	碧水源	135,555	2,528,100.75	0.32
75	601669	中国电建	316,962	2,510,339.04	0.32
76	002736	国信证券	184,137	2,439,815.25	0.31
77	300072	三聚环保	65,500	2,426,775.00	0.31
78	000338	潍柴动力	183,096	2,416,867.20	0.31
79	600196	复星医药	76,465	2,369,650.35	0.30
80	000166	申万宏源	422,929	2,368,402.40	0.30
81	600031	三一重工	290,191	2,359,252.83	0.30
82	600089	特变电工	227,583	2,350,932.39	0.30
83	300059	东方财富	193,869	2,330,305.38	0.30
84	600886	国投电力	292,841	2,313,443.90	0.30
85	600340	华夏幸福	68,706	2,307,147.48	0.30
86	600741	华域汽车	94,831	2,298,703.44	0.29
87	000783	长江证券	242,481	2,296,295.07	0.29
88	002466	天齐锂业	42,100	2,288,135.00	0.29
89	600029	南方航空	258,048	2,245,017.60	0.29
90	002008	大族激光	64,607	2,237,986.48	0.29

91	601377	兴业证券	301,118	2,237,306.74	0.29
92	600068	葛洲坝	196,844	2,212,526.56	0.28
93	601888	中国国旅	73,186	2,205,826.04	0.28
94	601600	中国铝业	467,940	2,115,088.80	0.27
95	600010	包钢股份	965,173	2,113,728.87	0.27
96	600066	宇通客车	96,142	2,112,239.74	0.27
97	000839	中信国安	210,000	2,097,900.00	0.27
98	601099	太平洋	520,484	2,092,345.68	0.27
99	600637	东方明珠	96,003	2,080,385.01	0.27
100	002594	比亚迪	41,555	2,075,672.25	0.27
101	601788	光大证券	138,288	2,064,639.84	0.26
102	002456	欧菲光	113,597	2,064,057.49	0.26
103	601933	永辉超市	290,812	2,058,948.96	0.26
104	000625	长安汽车	141,747	2,043,991.74	0.26
105	600816	安信信托	148,600	2,019,474.00	0.26
106	300104	乐视网	63,209	1,939,252.12	0.25
107	600535	天士力	46,561	1,934,143.94	0.25
108	601618	中国中冶	384,831	1,928,003.31	0.25
109	002673	西部证券	134,703	1,915,476.66	0.25
110	002475	立讯精密	65,397	1,912,208.28	0.24
111	600383	金地集团	164,305	1,884,578.35	0.24
112	600111	北方稀土	165,548	1,875,658.84	0.24
113	002202	金风科技	120,391	1,862,448.77	0.24
114	000963	华东医药	37,206	1,849,138.20	0.24
115	300124	汇川技术	72,060	1,840,412.40	0.24
116	002739	万达电影	35,600	1,814,532.00	0.23
117	000768	中航飞机	98,016	1,807,415.04	0.23
118	600705	中航资本	319,654	1,806,045.10	0.23

119	600109	国金证券	152,091	1,782,506.52	0.23
120	601727	上海电气	231,529	1,752,674.53	0.22
121	600570	恒生电子	37,442	1,747,792.56	0.22
122	601555	东吴证券	155,290	1,743,906.70	0.22
123	600153	建发股份	133,218	1,722,508.74	0.22
124	600271	航天信息	82,756	1,708,083.84	0.22
125	601800	中国交建	107,289	1,704,822.21	0.22
126	300017	网宿科技	141,194	1,704,211.58	0.22
127	600352	浙江龙盛	177,466	1,691,250.98	0.22
128	600023	浙能电力	308,639	1,685,168.94	0.22
129	000728	国元证券	137,837	1,684,368.14	0.22
130	000895	双汇发展	70,803	1,681,571.25	0.22
131	600739	辽宁成大	93,264	1,681,549.92	0.22
132	000623	吉林敖东	73,291	1,677,630.99	0.21
133	600406	国电南瑞	93,597	1,651,987.05	0.21
134	000100	TCL 集团	481,048	1,649,994.64	0.21
135	601018	宁波港	291,193	1,645,240.45	0.21
136	600177	雅戈尔	159,603	1,615,182.36	0.21
137	603993	洛阳钼业	318,807	1,613,163.42	0.21
138	600674	川投能源	163,593	1,606,483.26	0.21
139	000793	华闻传媒	155,697	1,575,653.64	0.20
140	600547	山东黄金	54,356	1,572,519.08	0.20
141	300024	机器人	80,176	1,563,432.00	0.20
142	000413	东旭光电	137,598	1,543,849.56	0.20
143	002508	老板电器	35,400	1,539,192.00	0.20
144	600100	同方股份	108,298	1,529,167.76	0.20
145	601111	中国国航	156,727	1,528,088.25	0.20
146	600115	东方航空	224,401	1,525,926.80	0.20

147	600085	同仁堂	43,448	1,518,942.08	0.19
148	600893	航发动力	55,626	1,518,589.80	0.19
149	000157	中联重科	335,532	1,506,538.68	0.19
150	600018	上港集团	236,526	1,499,574.84	0.19
151	600804	鹏博士	82,736	1,468,564.00	0.19
152	601998	中信银行	231,697	1,457,374.13	0.19
153	600221	海航控股	448,450	1,444,009.00	0.18
154	600415	小商品城	198,848	1,439,659.52	0.18
155	002007	华兰生物	39,417	1,438,720.50	0.18
156	600522	中天科技	118,100	1,423,105.00	0.18
157	000630	铜陵有色	498,744	1,416,432.96	0.18
158	600606	绿地控股	181,100	1,416,202.00	0.18
159	601198	东兴证券	81,600	1,406,784.00	0.18
160	000540	中天金融	201,600	1,401,120.00	0.18
161	000709	河钢股份	333,813	1,398,676.47	0.18
162	002465	海格通信	127,931	1,373,978.94	0.18
163	600820	隧道股份	135,900	1,372,590.00	0.18
164	002044	美年健康	80,300	1,365,100.00	0.17
165	000826	启迪桑德	38,544	1,353,665.28	0.17
166	600008	首创股份	204,792	1,347,531.36	0.17
167	600663	陆家嘴	56,823	1,343,295.72	0.17
168	002065	东华软件	61,385	1,337,579.15	0.17
169	601919	中远海控	245,225	1,311,953.75	0.17
170	600489	中金黄金	130,645	1,310,369.35	0.17
171	002081	金螳螂	117,615	1,291,412.70	0.17
172	002310	东方园林	77,000	1,287,440.00	0.16
173	000060	中金岭南	113,733	1,273,809.60	0.16
174	600157	永泰能源	352,004	1,256,654.28	0.16



175	000009	中国宝安	154,781	1,252,178.29	0.16
176	600332	白云山	42,387	1,230,918.48	0.16
177	600061	国投安信	78,900	1,226,895.00	0.16
178	600170	上海建工	315,700	1,205,974.00	0.15
179	000425	徐工机械	320,026	1,200,097.50	0.15
180	600118	中国卫星	42,869	1,193,472.96	0.15
181	601333	广深铁路	262,293	1,185,564.36	0.15
182	600369	西南证券	209,218	1,173,712.98	0.15
183	000876	新希望	142,384	1,170,396.48	0.15
184	600718	东软集团	74,920	1,165,006.00	0.15
185	600297	广汇汽车	154,310	1,161,954.30	0.15
186	600485	信威集团	79,530	1,160,342.70	0.15
187	601633	长城汽车	87,027	1,156,588.83	0.15
188	000503	海虹控股	46,259	1,153,236.87	0.15
189	600959	江苏有线	108,610	1,148,007.70	0.15
190	600208	新湖中宝	255,086	1,147,887.00	0.15
191	600150	中国船舶	49,925	1,141,784.75	0.15
192	000750	国海证券	205,321	1,129,265.50	0.14
193	000559	万向钱潮	103,466	1,098,808.92	0.14
194	600362	江西铜业	64,833	1,093,084.38	0.14
195	600688	上海石化	164,259	1,085,751.99	0.14
196	600436	片仔癀	17,700	1,080,408.00	0.14
197	601155	新城控股	57,100	1,058,634.00	0.14
198	601225	陕西煤业	149,493	1,056,915.51	0.14
199	000686	东北证券	104,257	1,047,782.85	0.13
200	300315	掌趣科技	127,800	1,042,848.00	0.13
201	002074	国轩高科	33,000	1,041,150.00	0.13
202	000415	渤海金控	152,500	1,026,325.00	0.13

203	601718	际华集团	113,200	995,028.00	0.13
204	002385	大北农	158,079	994,316.91	0.13
205	000402	金融街	84,693	992,601.96	0.13
206	300033	同花顺	15,900	989,139.00	0.13
207	300027	华谊兄弟	122,105	987,829.45	0.13
208	000983	西山煤电	112,500	986,625.00	0.13
209	002146	荣盛发展	99,333	980,416.71	0.13
210	600895	张江高科	57,476	970,194.88	0.12
211	000917	电广传媒	85,833	969,912.90	0.12
212	600583	海油工程	155,219	968,566.56	0.12
213	600588	用友网络	56,055	959,661.60	0.12
214	600827	百联股份	58,332	947,895.00	0.12
215	600256	广汇能源	225,510	933,611.40	0.12
216	002049	紫光国芯	29,900	921,518.00	0.12
217	300144	宋城演艺	44,100	920,367.00	0.12
218	600649	城投控股	87,150	915,946.50	0.12
219	000792	盐湖股份	87,310	912,389.50	0.12
220	600704	物产中大	124,350	906,511.50	0.12
221	601229	上海银行	35,400	904,116.00	0.12
222	600074	保千里	67,600	865,956.00	0.11
223	000977	浪潮信息	49,900	864,268.00	0.11
224	600498	烽火通信	33,900	859,365.00	0.11
225	600376	首开股份	74,800	855,712.00	0.11
226	002426	胜利精密	110,000	844,800.00	0.11
227	600060	海信电器	55,543	842,587.31	0.11
228	601992	金隅股份	130,000	841,100.00	0.11
229	601216	君正集团	171,406	838,175.34	0.11
230	600373	中文传媒	35,642	837,943.42	0.11

231	601117	中国化学	118,100	825,519.00	0.11
232	002500	山西证券	86,132	825,144.56	0.11
233	002152	广电运通	98,850	821,443.50	0.11
234	601866	中远海发	225,404	811,454.40	0.10
235	002183	怡亚通	92,500	798,275.00	0.10
236	002174	游族网络	25,000	794,000.00	0.10
237	600021	上海电力	65,500	791,895.00	0.10
238	600038	中直股份	17,106	782,941.62	0.10
239	002602	世纪华通	21,200	768,712.00	0.10
240	002470	金正大	102,018	768,195.54	0.10
241	600919	江苏银行	80,000	743,200.00	0.10
242	600037	歌华有线	50,900	741,104.00	0.09
243	002714	牧原股份	27,000	734,940.00	0.09
244	600737	中粮糖业	75,127	709,198.88	0.09
245	002195	二三四五	96,650	691,047.50	0.09
246	600372	中航电子	39,283	682,345.71	0.09
247	601997	贵阳银行	42,500	671,925.00	0.09
248	300168	万达信息	45,900	667,845.00	0.09
249	000738	航发控制	33,968	664,753.76	0.09
250	600977	中国电影	35,400	662,688.00	0.08
251	002292	奥飞娱乐	38,555	651,579.50	0.08
252	002153	石基信息	28,666	651,578.18	0.08
253	600549	厦门钨业	30,300	651,147.00	0.08
254	600446	金证股份	36,500	641,670.00	0.08
255	000627	天茂集团	78,900	637,512.00	0.08
256	002027	分众传媒	45,400	624,704.00	0.08
257	002299	圣农发展	41,400	615,618.00	0.08
258	601021	春秋航空	17,927	602,885.01	0.08

259	601872	招商轮船	115,200	594,432.00	0.08
260	600482	中国动力	23,000	581,670.00	0.07
261	000938	紫光股份	9,300	568,416.00	0.07
262	601877	正泰电器	28,200	566,538.00	0.07
263	000959	首钢股份	80,000	559,200.00	0.07
264	002424	贵州百灵	29,400	554,484.00	0.07
265	002131	利欧股份	166,950	549,265.50	0.07
266	601958	金钼股份	76,475	548,325.75	0.07
267	600685	中船防务	19,600	536,648.00	0.07
268	300251	光线传媒	64,816	530,843.04	0.07
269	300133	华策影视	46,488	520,665.60	0.07
270	000671	阳光城	86,700	504,594.00	0.06
271	601118	海南橡胶	88,124	500,544.32	0.06
272	000156	华数传媒	32,691	487,422.81	0.06
273	601611	中国核建	39,800	476,406.00	0.06
274	000718	苏宁环球	78,600	460,596.00	0.06
275	000008	神州高铁	59,000	429,520.00	0.05
276	600871	石化油服	124,100	414,494.00	0.05
277	601608	中信重工	73,900	409,406.00	0.05
278	000555	神州信息	24,400	407,480.00	0.05
279	600188	兖州煤业	29,801	364,764.24	0.05
280	601163	三角轮胎	13,000	341,900.00	0.04
281	601966	玲珑轮胎	15,000	336,450.00	0.04
282	002797	第一创业	27,400	252,354.00	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	002821	凯莱英	42,818	3,124,429.46	0.40
2	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.14
3	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.10
4	600666	奥瑞德	43,040	748,896.00	0.10
5	002129	中环股份	90,328	747,012.56	0.10
6	600654	*ST 中安	48,000	647,040.00	0.08
7	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.06
8	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.05
9	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
10	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
11	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
12	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
13	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
14	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
15	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
16	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
17	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
18	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
19	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
20	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
21	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
22	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
23	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
24	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
25	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
26	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	13,025,006.69	2.06
2	601166	兴业银行	6,584,358.40	1.04
3	600016	民生银行	6,277,145.13	0.99
4	600036	招商银行	6,253,268.00	0.99
5	600519	贵州茅台	6,190,495.00	0.98
6	601328	交通银行	5,056,487.50	0.80
7	000333	美的集团	4,409,960.00	0.70
8	000651	格力电器	4,403,323.76	0.70
9	600000	浦发银行	4,362,614.20	0.69
10	000002	万科A	4,287,383.99	0.68
11	601668	中国建筑	4,068,347.00	0.64
12	600837	海通证券	4,044,382.94	0.64
13	600030	中信证券	3,888,525.00	0.62
14	601288	农业银行	3,821,283.00	0.61
15	601169	北京银行	3,645,854.00	0.58
16	600887	伊利股份	3,482,436.00	0.55
17	600019	宝钢股份	3,455,207.34	0.55
18	601766	中国中车	3,310,363.00	0.52
19	601398	工商银行	3,144,332.00	0.50
20	601601	中国太保	2,876,785.00	0.46

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	8,768,245.00	1.39
2	601166	兴业银行	5,776,321.21	0.91
3	600016	民生银行	4,716,232.32	0.75
4	600519	贵州茅台	4,428,152.58	0.70
5	600036	招商银行	4,396,809.40	0.70
6	601328	交通银行	3,841,769.00	0.61
7	000651	格力电器	3,173,174.00	0.50
8	600000	浦发银行	3,139,901.60	0.50
9	000002	万科A	3,109,661.00	0.49
10	000333	美的集团	3,099,330.75	0.49
11	600030	中信证券	2,910,691.00	0.46
12	601668	中国建筑	2,909,273.00	0.46
13	600837	海通证券	2,860,742.19	0.45
14	601288	农业银行	2,763,989.00	0.44
15	600887	伊利股份	2,723,531.00	0.43
16	601169	北京银行	2,662,778.30	0.42
17	601766	中国中车	2,233,659.00	0.35
18	601398	工商银行	2,219,894.00	0.35
19	600104	上汽集团	1,960,589.00	0.31
20	600900	长江电力	1,930,204.00	0.31

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	301,220,388.82
卖出股票收入（成交）总额	247,090,155.86

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**

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

**7.12.2**

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	131,118.77
2	应收证券清算款	218,731.44
3	应收股利	-
4	应收利息	9,077.74
5	应收申购款	71,649.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	430,577.17

**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	002821	凯莱英	3,124,429.46	0.40	新股锁定
2	603660	苏州科达	1,064,986.65	0.14	新股锁定
3	603823	百合花	778,661.52	0.10	新股锁定
4	600666	奥瑞德	748,896.00	0.10	重大事项停牌
5	002129	中环股份	747,012.56	0.10	重大事项停牌

**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
29,775	16,992.05	86,045,290.31	17.01%	419,892,861.53	82.99%

### 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	597,785.37	0.1182%

### 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

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	458,974,347.89
本报告期基金总申购份额	229,030,710.96
减:本报告期基金总赎回份额	182,066,907.01
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	505,938,151.84

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华西证券	1	1,231,687,243.85	42.96%	215,770.33	42.96%	-
长城证券	2	186,330,797.53	34.55%	173,530.03	34.55%	-
东方证券	2	119,715,692.15	22.20%	111,491.28	22.20%	-
银河证券	1	1,597,287.77	0.30%	1,487.62	0.30%	-

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，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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	763, 107. 90	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旗下部分开放式基金通过工商银行定期定额投资实行费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本 基金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	长城基金关于增加万得投顾为旗下开放式基金代销机构并开通定投和转换业务及参与其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	2017 年 1 月 4 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	2017 年 1 月 14 日
4	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资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	2017 年 2 月 23 日
5	长城基金关于增加新兰德投资咨询为旗下开放式基金代销机构并开通定投和转换业务及参与其费	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报及本基金管	2017 年 3 月 24 日

	率优惠活动的公告	理人网站	
6	长城基金管理有限公司关于参加微众银行费率优惠活动的公告（放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
7	关于增加广发银行为长城旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 10 日
8	长城基金关于旗下部分开放式基金参与广发证券开展的申购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	2017 年 4 月 10 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(华星创业)	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	2017 年 4 月 15 日
10	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资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	2017 年 4 月 24 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(海达股份)	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	2017 年 4 月 25 日
12	长城基金管理有限公司关于参加长城证券费率优惠活动的公告（含定投-放开折扣限制）	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	2017 年 5 月 15 日
13	长城基金管理有限公司关于参加中信建投证券费率优惠活动的公	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2017 年 5 月 18 日



	告（含定投-放开折扣限制）	券日报及本基金管 理人网站	
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(新疆众和)	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	2017 年 6 月 2 日
15	长城基金管理有限公司关于参加 中泰证券股份有限公司费率优惠 活动的公告（含定投-放开折扣限 制）	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	2017 年 6 月 16 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170120-20170301	-	144,549,725.35	144,549,725.35	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

#### 1、流动性风险

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

#### 2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

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

#### 3、基金净值波动风险

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

#### 4、投资受限风险

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

#### 5、基金合同终止或转型风险

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

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 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

### 12.3 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>