

长城中证 500 指数增强型
证券投资基金
(原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资
基金转型)
2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 25 日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

长城中证 500 指数增强型证券投资基金报告期自 2018 年 8 月 13 日起至 09 月 30 日止，原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金报告期自 2018 年 07 月 01 日起至 2018 年 8 月 12 日止。

长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金以通讯方式召开了长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会，于 2018 年 7 月 5 日表决通过了《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》（详见 2018 年 7 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登的《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》）。长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金于 2018 年 8 月 6 日终止上市，由上市型基金转型为非上市基金，同时名称变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金，其基金简称、交易代码、基金运作方式、基金合同存续期、投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征等均发生改变。自 2018 年 8 月 13 日起，由《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》自同日起失效。

§ 2 基金产品概况

转型后：

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长城中证 500 指数增强 |
| 基金主代码 | 006048 |
| 交易代码 | 006048 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018 年 8 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 17,304,241.74 份 |
| 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。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 |
| 投资策略 | 本基金为增强型指数基金，股票投资以中证 500 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，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，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。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

转型前：

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 长城久兆中小板 300 指数分级 |
| 基金主代码 | 162010 |
| 交易代码 | 162010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 1 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 19,420,400.59 份 |
| 投资目标 | 本基金通过投资约束和数量化监控，力求实现对中小板 300（价格）指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金净值增长率与业绩比较基准变化率之间的日平均跟踪误差控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金采用完全复制策略，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指 |

| | |
|--------|---|
| | 数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。 |
| 业绩比较基准 | 中小板 300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金的长期平均风险和预期收益率高于普通股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等，为高风险、高收益产品。 |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

注：本基金于 2018 年 8 月 13 日转型，该日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018 年 8 月 13 日 — 2018 年 9 月 30 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | -952,875.13 |
| 2. 本期利润 | -997,189.00 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0528 |
| 4. 期末基金资产净值 | 16,255,436.76 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9394 |

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018 年 7 月 1 日 — 2018 年 8 月 12 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -5,446,059.26 |
| 2. 本期利润 | -1,029,290.19 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0526 |
| 4. 期末基金资产净值 | 16,972,171.66 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8740 |

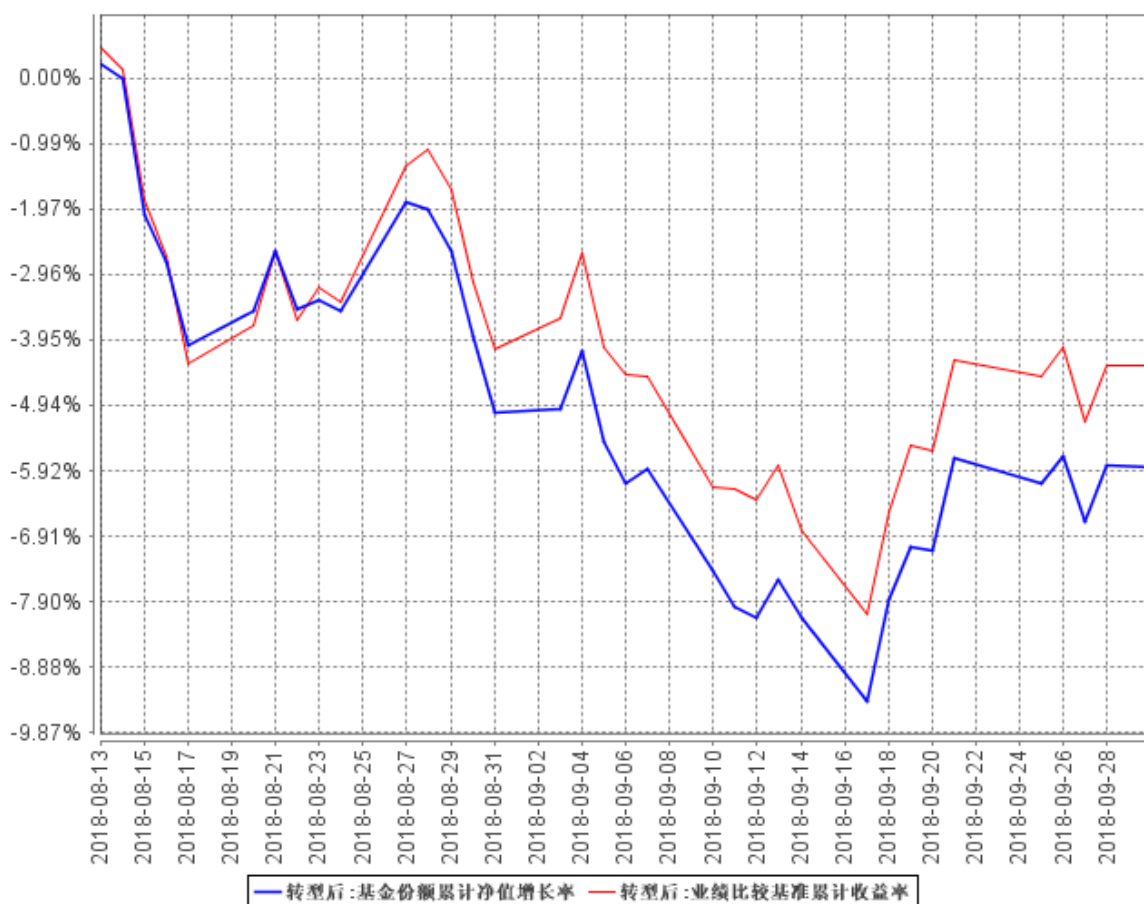
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 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 |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.85% | 0.96% | -4.33% | 1.04% | -1.52% | -0.08% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：①本基金合同规定基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金转型之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

③本基金转型日期为 2018 年 8 月 13 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

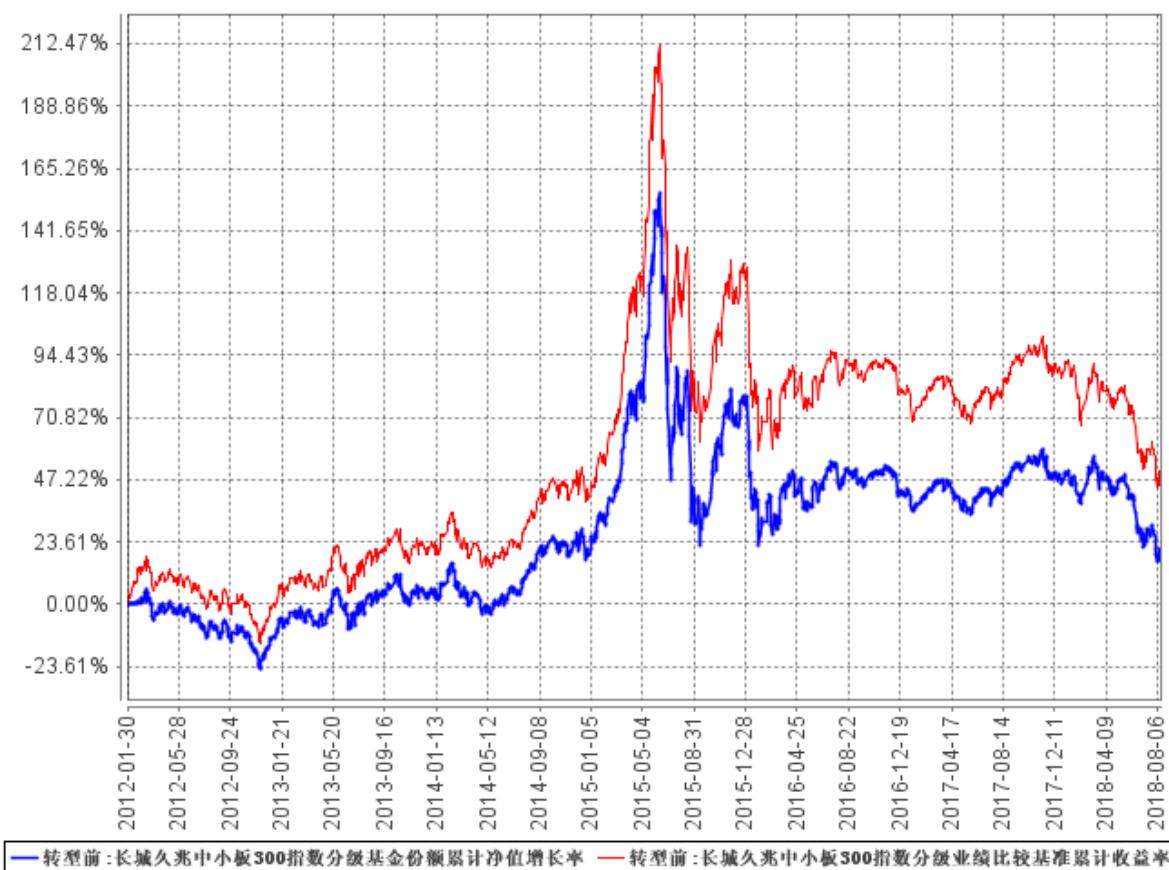
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 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 |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -5.62% | 1.48% | -5.52% | 1.51% | -0.10% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

长城久兆中小板300指数分级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：①本基金合同规定本基金投资组合为：本基金投资于股票的资产占基金资产净值的比例不低于 90%，其中将不低于 90%的股票资产投资于中小板 300（价格）指数的成份股及其备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

②自 2018 年 8 月 13 日起，由《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》修订而

成的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》自同日起失效。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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、长城品牌、长城久兆和长城久嘉创新成长混合型基金的基金经理 | 2017 年 6 月 19 日 | 2018 年 8 月 13 日 | 18 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，曾任研究部总经理和公司总经理助理，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”、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”和“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”的基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |

| | | | | | |
|------------|---|------------------------|----------|-------------|--|
| <p>杨建华</p> | <p>公司副总经理、投资总监、基金管理部总经理，长城久泰、长城品牌、长城久嘉创新成长混合型和长城中证 500 指数增强型基金的基金经理</p> | <p>2018 年 8 月 13 日</p> | <p>-</p> | <p>18 年</p> | <p>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，曾任研究部总经理和公司总经理助理，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”、“长城久富核心成长混合型证券投资基金”和“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”的基金经理。</p> |
|------------|---|------------------------|----------|-------------|--|

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》、《长城中证 500 指数增强型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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度，中美之间的贸易摩擦愈演愈烈，截止季度末，美国已经累计对中国 2500 亿美元的商品加征关税，中国也以牙还牙针对美国累计 1100 亿美元的商品加征关税。美国对华贸易关税措施及其他遏制措施，使得外贸形势变得错综复杂并充满不确定性。国内投资增速趋缓、消费信心不足，给经济带来了较大的下行压力。官方 PMI 缓步下行。证券市场对外开放步伐逐步加快，MSCI 指数考虑扩大 A 股的权重，富时罗素指数分步骤将 A 股纳入，陆港通成交活跃，北上资金增加了 A 股市场的资金供给，但是也加大了 A 股市场的波动性。受到上述因素的影响，证券市场震荡加剧，分化显著。银行、非银金融、采掘、钢铁等行业表现较好，家电、纺织服装、医药、电子等受到内需不振预期或者受贸易摩擦预期影响较大的行业表现较弱。

本基金自 2018 年 8 月 13 日正式变更成为以中证 500 指数为跟踪标的指数增强型基金，目前仍处于建仓期。本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子模型，基于上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；在组合层面上，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，转型前长城久兆 300 份额净值增长率为-5.62%，业绩比较基准收益率为-5.52%；转型后长城中证 500 份额净值增长率为-5.85%，本基金业绩比较基准收益率为-4.33%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金于 2018 年 8 月 13 日转型，该日起长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更

为长城中证 500 指数增强型证券投资基金。转型前的长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金自 2018 年 07 月 02 日起至 2018 年 08 月 10 日止连续 30 个工作日基金资产净值低于人民币五千万万元。转型后的长城中证 500 指数增强型证券投资基金自 2018 年 08 月 13 日起至 2018 年 09 月 30 日止连续 36 个工作日基金资产净值低于人民币五千万万元。

§5 投资组合报告

转型后：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 15,173,389.36 | 92.20 |
| | 其中：股票 | 15,173,389.36 | 92.20 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,265,056.52 | 7.69 |
| 8 | 其他资产 | 19,133.85 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 16,457,579.73 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 279,719.00 | 1.72 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 7,117,309.82 | 43.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 275,195.00 | 1.69 |
| E | 建筑业 | 213,860.00 | 1.32 |
| F | 批发和零售业 | 559,329.00 | 3.44 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 762,856.00 | 4.69 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,154,020.00 | 7.10 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 938,709.00 | 5.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | 184,325.00 | 1.13 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 180,942.05 | 1.11 |
| 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 | 216,808.00 | 1.33 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 11,883,072.87 | 73.10 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 38,016.00 | 0.23 |
| C | 制造业 | 2,367,927.00 | 14.57 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 106,120.00 | 0.65 |
| F | 批发和零售业 | 42,480.00 | 0.26 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 77,876.00 | 0.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 67,346.00 | 0.41 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 178,773.00 | 1.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | 112,982.00 | 0.70 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 106,219.00 | 0.65 |
| 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 | 192,577.49 | 1.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,290,316.49 | 20.24 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601717 | 郑煤机 | 41,600 | 292,448.00 | 1.80 |
| 2 | 600673 | 东阳光科 | 33,300 | 290,709.00 | 1.79 |
| 3 | 002410 | 广联达 | 10,500 | 281,190.00 | 1.73 |
| 4 | 002503 | 搜于特 | 80,304 | 248,942.40 | 1.53 |
| 5 | 300113 | 顺网科技 | 14,600 | 238,564.00 | 1.47 |
| 6 | 000598 | 兴蓉环境 | 53,300 | 237,185.00 | 1.46 |
| 7 | 000848 | 承德露露 | 26,500 | 234,260.00 | 1.44 |
| 8 | 600808 | 马钢股份 | 56,900 | 233,290.00 | 1.44 |
| 9 | 600611 | 大众交通 | 58,700 | 233,039.00 | 1.43 |
| 10 | 601000 | 唐山港 | 92,800 | 232,928.00 | 1.43 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 002450 | 康得新 | 15,073 | 211,022.00 | 1.30 |
| 2 | 002075 | 沙钢股份 | 7,800 | 153,504.00 | 0.94 |
| 3 | 002739 | 万达电影 | 6,003 | 133,506.72 | 0.82 |
| 4 | 002602 | 世纪华通 | 1,800 | 58,500.00 | 0.36 |
| 5 | 002478 | 常宝股份 | 6,800 | 42,500.00 | 0.26 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行股指期货投资，本期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，本期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期本基金投资的前十名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。

5.11.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 7,855.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 279.07 |

| | | |
|---|-------|-----------|
| 5 | 应收申购款 | 10,999.56 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,133.85 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 002450 | 康得新 | 211,022.00 | 1.30 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002602 | 世纪华通 | 58,500.00 | 0.36 | 重大事项停牌 |
| 3 | 002739 | 万达电影 | 133,506.72 | 0.82 | 重大事项停牌 |
| 4 | 002075 | 沙钢股份 | 153,504.00 | 0.94 | 重大事项停牌 |

5.11.6 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。

转型前：

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|---------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 15,896,413.81 | 66.74 |
| | 其中：股票 | 15,896,413.81 | 66.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,304,776.23 | 5.48 |
| 8 | 其他资产 | 6,618,002.41 | 27.78 |
| 9 | 合计 | 23,819,192.45 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 33,508.65 | 0.20 |
| B | 采矿业 | 157,538.24 | 0.93 |
| C | 制造业 | 2,380,125.43 | 14.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 164,135.31 | 0.97 |
| F | 批发和零售业 | 42,168.00 | 0.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 752.94 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 303,838.25 | 1.79 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 208,270.00 | 1.23 |
| L | 租赁和商务服务业 | 307,663.00 | 1.81 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 64,910.05 | 0.38 |
| 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 | 142,811.37 | 0.84 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,805,721.24 | 22.42 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 42,968.00 | 0.25 |
| B | 采掘业 | 330,770.00 | 1.95 |
| C | 制造业 | 6,931,428.80 | 40.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 660,606.00 | 3.89 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业 | 82,509.00 | 0.49 |
| F | 批发和零售业 | 747,534.00 | 4.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 536,899.00 | 3.16 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 655,556.00 | 3.86 |
| J | 金融业 | 496,985.00 | 2.93 |
| K | 房地产业 | 794,408.00 | 4.68 |
| L | 租赁和商务服务业 | 209,470.00 | 1.23 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 165,788.00 | 0.98 |
| 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 | 435,770.77 | 2.57 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 12,090,692.57 | 71.24 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 002450 | 康得新 | 15,073 | 257,446.84 | 1.52 |
| 2 | 002503 | 搜于特 | 76,204 | 256,045.44 | 1.51 |
| 3 | 002110 | 三钢闽光 | 10,900 | 217,782.00 | 1.28 |
| 4 | 002701 | 奥瑞金 | 38,943 | 214,186.50 | 1.26 |
| 5 | 002233 | 塔牌集团 | 15,400 | 208,516.00 | 1.23 |
| 6 | 002244 | 滨江集团 | 34,274 | 171,370.00 | 1.01 |
| 7 | 002180 | 纳思达 | 5,600 | 166,768.00 | 0.98 |
| 8 | 002075 | 沙钢股份 | 7,800 | 166,218.00 | 0.98 |
| 9 | 002517 | 恺英网络 | 28,600 | 166,166.00 | 0.98 |
| 10 | 002818 | 富森美 | 6,500 | 162,955.00 | 0.96 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

| | | | | | |
|---|--------|------|--------|------------|------|
| 1 | 600578 | 京能电力 | 65,700 | 212,868.00 | 1.25 |
| 2 | 000519 | 中兵红箭 | 26,400 | 211,200.00 | 1.24 |
| 3 | 603025 | 大豪科技 | 10,800 | 206,604.00 | 1.22 |
| 4 | 000078 | 海王生物 | 48,800 | 206,424.00 | 1.22 |
| 5 | 600801 | 华新水泥 | 9,600 | 205,824.00 | 1.21 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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，本期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 5,562.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,610,788.51 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,651.28 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,618,002.41 |

5.11.4 报告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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 002450 | 康得新 | 257,446.84 | 1.52 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002075 | 沙钢股份 | 166,218.00 | 0.98 | 重大事项停牌 |

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

| | |
|----------------------------------|---------------|
| 基金转型日（2018年8月13日）基金份额总额 | 19,420,400.59 |
| 基金转型日起至报告期期末基金总申购份额 | 794,172.14 |
| 减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额 | 500,948.33 |
| 基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -2,409,382.66 |
| 报告期期末基金份额总额 | 17,304,241.74 |

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 19,690,207.83 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 357,867.04 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 627,673.28 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -1.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 19,420,400.59 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细（转型后）

注：本报告期本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 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。

§9 备查文件目录

备查文件目录

1. 中国证监会批准长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金设立的文件
2. 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》
3. 《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金托管协议》
4. 中国证监会准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的文件
5. 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
6. 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
7. 法律意见书
8. 基金管理人业务资格批件 营业执照
9. 基金托管人业务资格批件 营业执照
10. 中国证监会规定的其他文件

10.2 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

10.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn