

# 长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 27 日

## §1 重要提示

### 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 2019 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

为了更好地为投资者提供理财服务，经与本基金基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人自 2019 年 1 月 18 日起为本基金增设 C 类基金份额。同时，本基金管理人对基金合同进行了相应的修改，修改的具体内容详见本管理人于 2019 年 1 月 18 日发布的《关于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类份额并相应修改基金合同条款的公告》。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长城久泰沪深 300 指数	
基金主代码	200002	
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	510,897,065.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码:	200002	006912
下属分级基金的前端交易代码	200002	-
下属分级基金的后端交易代码	201002	-
报告期末下属分级基金的份额总额	508,232,412.14 份	2,664,653.77 份

注: 本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额。

### 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	<p>(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%。</p> <p>(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。</p>
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。

注: 本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额。

### 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

## 2.4 信息披露方式

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

### §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

基金级别	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	84,607,309.32	388,670.18
本期利润	191,807,559.10	279,291.72
加权平均基金份额本期利润	0.3714	0.1388
本期基金份额净值增长率	25.62%	20.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0098	0.5897
期末基金资产净值	867,861,135.51	4,552,272.85
期末基金份额净值	1.7076	1.7084

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。

#### 3.2 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

长城久泰沪深 300 指数 A

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	6.38%	1.20%	5.13%	1.10%	1.25%	0.10%
过去三个月	2.12%	1.47%	-1.10%	1.45%	3.22%	0.02%
过去六个月	25.62%	1.44%	25.66%	1.47%	-0.04%	-0.03%
过去一年	11.58%	1.41%	8.68%	1.45%	2.90%	-0.04%
过去三年	34.46%	1.04%	20.52%	1.05%	13.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	341.78%	1.62%	237.13%	1.62%	104.65%	0.00%

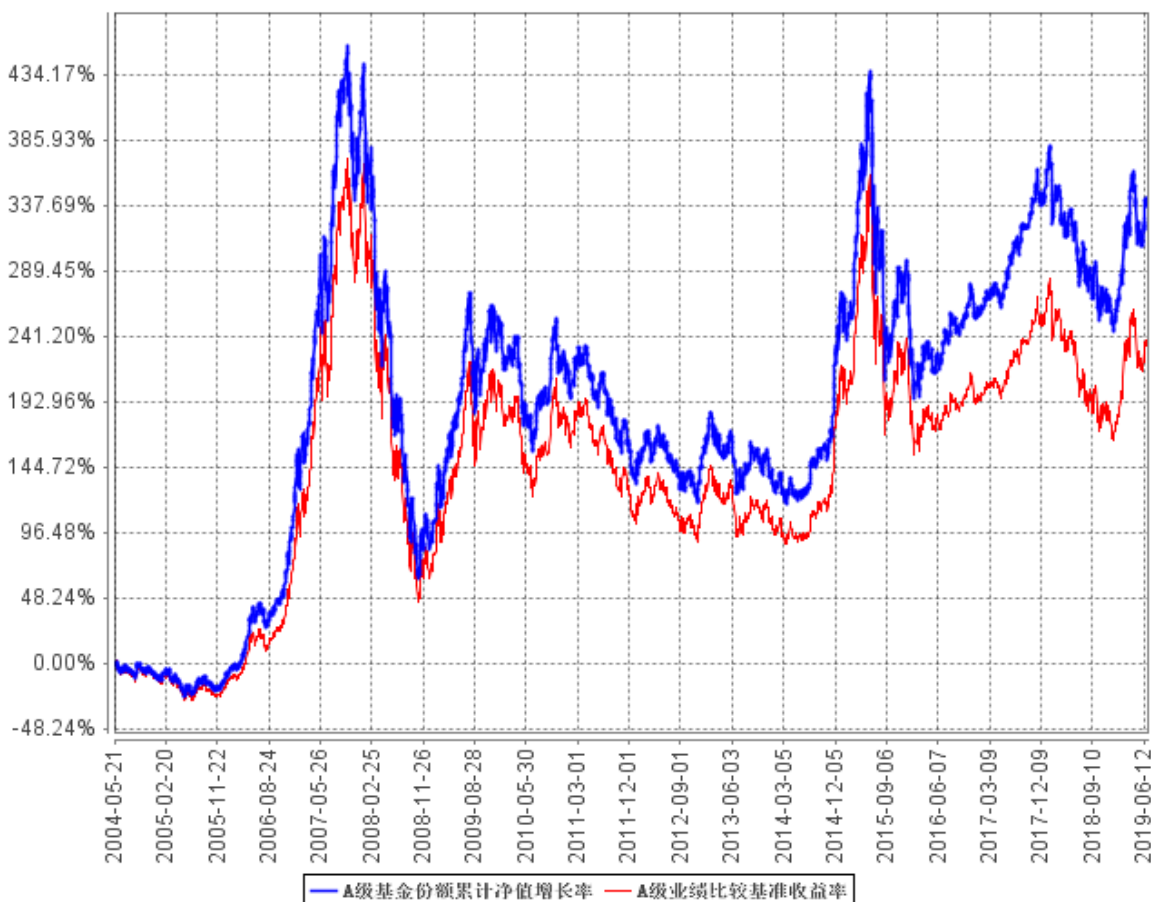
长城久泰沪深 300 指数 C

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	6.36%	1.20%	5.13%	1.10%	1.23%	0.10%
过去三个月	2.09%	1.47%	-1.10%	1.45%	3.19%	0.02%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.86%	1.48%	21.79%	1.52%	-0.93%	-0.04%

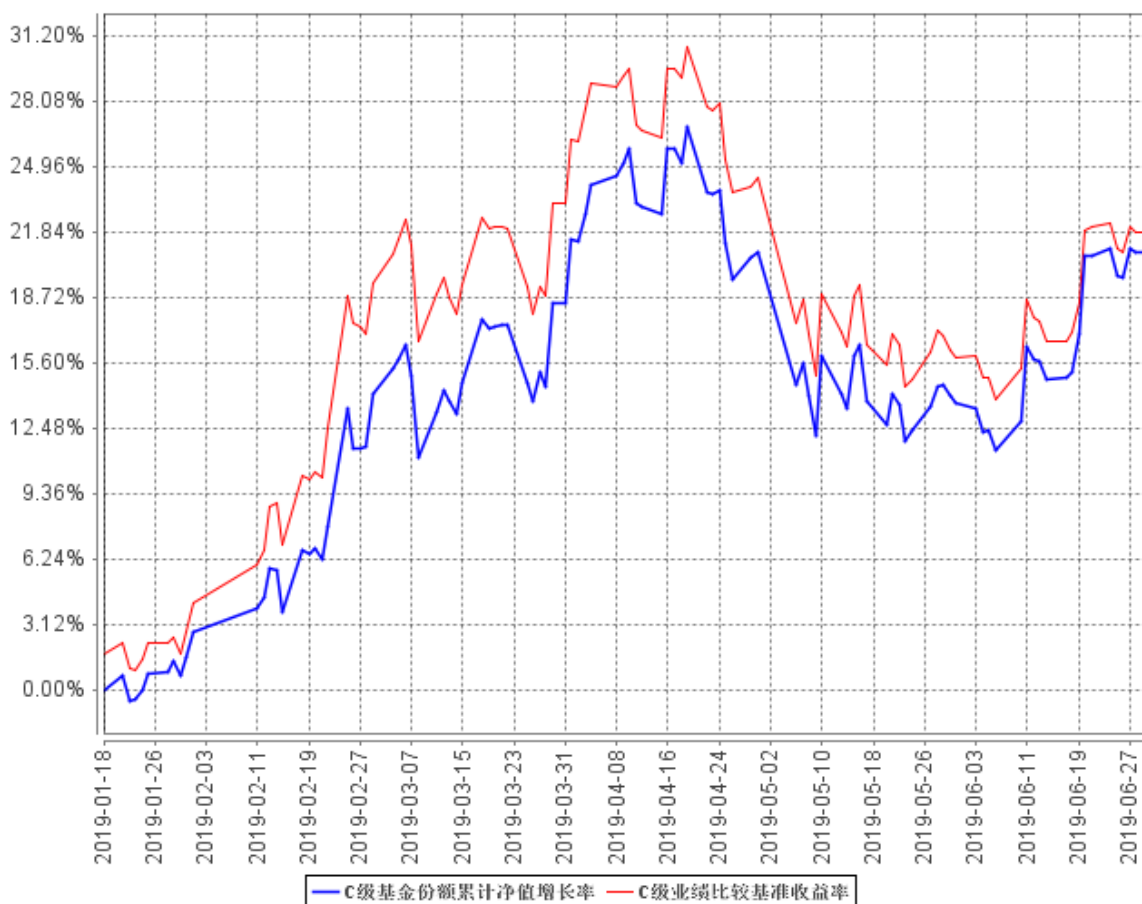
注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

### 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

A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



C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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。②本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额。

## §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：长城品牌优选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)、长城安心回报混合型证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、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、长城久嘉创新成长灵活配置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、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置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、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、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、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置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、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资



基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略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、长城品牌、长城核心优势的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	19 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”、“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”、“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”和“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”的基金经理。
雷俊	量化与指数投资部总经理，长城中证 500 指数增强型、长城久泰沪深 300 指数、长城创业	2018 年 11 月 30 日	-	11 年	北京大学理学学士、工学硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017 年 11 月进入长城基金管理有限公司，现任量化与指数投资部总经理。

	板指数、 长城核 心优选 混合、 长城量 化精选 股票的 基金经 理				
王卫林	长城久 泰沪深 300 指 数和长 城中证 500 指 数增强 基金的 基金经 理助理	2018 年 6 月 8 日	-	3 年	男，华中科技大学船舶与海洋工程学士、北京大学金融信息工程硕士。曾就职于南方基金管理有限公司。2018 年 1 月进入长城基金管理有限公司，曾任量化研究员、“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”的基金经理助理。

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 A 股波动较去年明显放大，在一季度单边上涨后二季度开始调整，A 股市场窄幅震荡；但市场关注点聚焦上市公司基本面，好公司涨幅较大；本基金产品运作坚持指数价值增强的投资风格，获取价值回归与业绩驱动下的长期超额回报。

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。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末长城久泰沪深 300 指数 A 份额净值为 1.7076，净值增长率为 25.62%；本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 份额净值为 1.7084，净值增长率为 20.86%；同期业绩比较基准收益率 A 级为 25.66%，C 级从成立之日起至本报告期末同期业绩比较基准收益率为 21.79%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一方面由于中美贸易摩擦的长期性，下半年的经济走势也有很大的不确定性，未来短期一段时间继续震荡的可能性更大，上涨和下跌的空间都比较有限，基本面优质的个股有结构性的机会；另一方面，随着逐渐与国际市场接轨，增量的海外资金配置需求增大，从更长的周期看，A 股的长期投资价值凸现，中长期有很大的投资机会。

本基金在投资运作时将继续坚持定量化指数增强投资风格，力争在保持较低跟踪误差的同时获取更大的超额回报。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金

所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人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、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。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。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

#### **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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		13,616,110.90	3,449,970.72
结算备付金		589,985.80	1,729,007.37
存出保证金		276,656.86	259,977.95
交易性金融资产		859,019,974.32	712,291,214.18
其中：股票投资		827,045,574.32	679,241,793.38
基金投资		-	-
债券投资		31,974,400.00	33,049,420.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	7,060,053.44
应收利息		337,198.87	924,426.88
应收股利		-	-
应收申购款		298,122.93	195,437.66
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		874,138,049.68	725,910,088.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		341.97	5,015,976.24
应付赎回款		510,366.58	279,842.60
应付管理人报酬		662,500.48	585,759.48
应付托管费		135,204.19	119,542.74
应付销售服务费		1,139.50	-
应付交易费用		304,495.17	271,966.32

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		110,593.43	351,485.85
负债合计		1,724,641.32	6,624,573.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		510,897,065.91	529,161,664.45
未分配利润		361,516,342.45	190,123,850.52
所有者权益合计		872,413,408.36	719,285,514.97
负债和所有者权益总计		874,138,049.68	725,910,088.20

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 A 级 1.7076，C 级 1.7084；基金份额 A 级 508,232,412.14 份，C 级 2,664,653.77 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		199,529,282.88	-68,589,766.05
1.利息收入		567,419.57	151,615.91
其中：存款利息收入		76,973.25	151,555.76
债券利息收入		490,446.32	60.15
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）		91,478,314.16	74,420,412.38
其中：股票投资收益		81,829,882.38	67,533,834.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-130,281.81	772.61
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,778,713.59	6,885,805.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		107,090,871.32	-143,246,488.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）		392,677.83	84,693.71
<b>减：二、费用</b>		<b>7,442,432.06</b>	<b>6,088,823.25</b>
1. 管理人报酬		3,978,053.68	3,268,168.36
2. 托管费		811,847.65	666,973.09
3. 销售服务费		4,373.29	-
4. 交易费用		2,537,287.73	1,979,511.31
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.20
7. 其他费用		110,869.71	174,170.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>192,086,850.82</b>	<b>-74,678,589.30</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>192,086,850.82</b>	<b>-74,678,589.30</b>

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	529,161,664.45	190,123,850.52	719,285,514.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	192,086,850.82	192,086,850.82
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）	-18,264,598.54	-20,694,358.89	-38,958,957.43
其中：1.基金申购款	176,750,870.15	97,982,936.42	274,733,806.57
2.基金赎回款	-195,015,468.69	-118,677,295.31	-313,692,764.00



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）	510,897,065.91	361,516,342.45	872,413,408.36
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	399,805,494.14	285,619,024.08	685,424,518.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,678,589.30	-74,678,589.30
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）	49,737,261.66	27,489,429.67	77,226,691.33
其中：1.基金申购款	88,137,560.06	54,926,503.59	143,064,063.65
2.基金赎回款	-38,400,298.40	-27,437,073.92	-65,837,372.32
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）	449,542,755.80	238,429,864.45	687,972,620.25

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：

\_\_\_\_\_ 王军

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

#### 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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. 增值税、企业所得税

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（以下简称“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，资管产品管理人未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的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
东方证券	-	-	194,681,312.86	10.15%
长城证券	3,067,836,187.70	100.00%	1,692,061,575.24	88.18%

#### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
长城证券	52,908,675.60	100.00%	161,020.76	96.40%
东方证券	-	-	6,013.68	3.60%

### 6.4.8.1.3 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。

### 6.4.8.1.4 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。

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
东方证券	-	-	-	-
长城证券	709,585.38	100.00%	304,495.17	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
东方证券	181,307.06	20.47%	258.62	0.08%
长城证券	674,329.14	76.15%	299,065.31	95.45%

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
----	--	---

当期发生的基金应支付的管理费	3,978,053.68	3,268,168.36
其中：支付销售机构的客户维护费	671,143.15	707,536.43

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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	811,847.65	666,973.09

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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金	-	95.05	95.05
合计	-	95.05	95.05

注：1) 销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服

务等。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

本基金于 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额，无上年度可比期间数据。

### 6.4.8.3 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。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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。

#### 6.4.8.4.2 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。

### 6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	13,616,110.90	55,360.08	35,540,692.47	138,695.15

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。

### 6.4.8.6 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。

## 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 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



601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	*ST 信威	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	6.28	2019 年 7 月 12 日	13.86	92,368	2,183,970.23	580,071.04	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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。

#### 6.4.10 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 2019 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 826,408,526.74 元，划分为第二层次的余额为人民币 32,611,447.58 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，本基金本报告期末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	827,045,574.32	94.61
	其中：股票	827,045,574.32	94.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,974,400.00	3.66
	其中：债券	31,974,400.00	3.66
	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	14,206,096.70	1.63
8	其他各项资产	911,978.66	0.10
9	合计	874,138,049.68	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	1,178,148.64	0.14
B	采矿业	2,079,503.65	0.24
C	制造业	236,924,871.34	27.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,928,995.39	2.86
E	建筑业	21,003,914.61	2.41
F	批发和零售业	20,885,940.75	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	17,077,390.82	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,462,846.10	2.12
J	金融业	305,237,718.04	34.99
K	房地产业	34,787,847.44	3.99

L	租赁和商务服务业	10,476,020.23	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,207.45	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,252.18	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,997,003.20	0.23
S	综合	-	-
	合计	695,048,659.84	79.67

## 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	采矿业	11,048,958.85	1.27
C	制造业	76,674,045.90	8.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,243,348.96	0.37
E	建筑业	3,493,477.19	0.40
F	批发和零售业	3,585,236.72	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	10,846,273.08	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,545,935.76	0.41
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	8,591,131.64	0.98
L	租赁和商务服务业	1,001.25	0.00
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	7,303,010.19	0.84
S	综合	3,630,625.00	0.42
	合计	131,996,914.48	15.13

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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前十名股票投资明细

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	767,546	68,012,251.06	7.80
2	600519	贵州茅台	66,630	65,563,920.00	7.52
3	601166	兴业银行	1,658,547	30,334,824.63	3.48
4	000333	美的集团	582,058	30,185,527.88	3.46
5	600036	招商银行	660,912	23,779,613.76	2.73
6	000858	五粮液	191,552	22,593,558.40	2.59
7	601328	交通银行	3,660,492	22,402,211.04	2.57
8	601398	工商银行	2,871,215	16,911,456.35	1.94
9	600000	浦发银行	1,423,252	16,623,583.36	1.91
10	600837	海通证券	1,148,087	16,291,354.53	1.87

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

#### 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前五名股票投资明细

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	300014	亿纬锂能	152,000	4,629,920.00	0.53
2	000999	华润三九	138,400	4,060,656.00	0.47
3	601100	恒立液压	126,274	3,962,478.12	0.45
4	002092	中泰化学	480,400	3,823,984.00	0.44
5	002128	露天煤业	440,644	3,811,570.60	0.44

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站

（www.ccfund.com.cn）的半年度报告正文。

### 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	600519	贵州茅台	78,426,755.73	10.90
2	600030	中信证券	33,007,460.00	4.59
3	000858	五粮液	32,834,501.32	4.56
4	000333	美的集团	31,377,773.96	4.36
5	600837	海通证券	26,286,559.92	3.65
6	601318	中国平安	23,213,798.00	3.23
7	601169	北京银行	23,178,304.93	3.22
8	600276	恒瑞医药	21,045,250.42	2.93
9	000651	格力电器	19,835,004.21	2.76
10	600309	万华化学	16,153,228.00	2.25
11	600000	浦发银行	16,045,557.16	2.23
12	600900	长江电力	15,767,219.77	2.19
13	000776	广发证券	15,434,508.96	2.15
14	000538	云南白药	15,105,349.72	2.10
15	601166	兴业银行	15,077,139.34	2.10
16	600048	保利地产	14,561,165.71	2.02
17	000166	申万宏源	14,268,306.00	1.98
18	600015	华夏银行	13,406,941.98	1.86
19	002146	荣盛发展	13,278,836.00	1.85
20	000001	平安银行	12,772,011.91	1.78

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	000651	格力电器	46,725,424.82	6.50
2	600519	贵州茅台	39,463,227.95	5.49
3	000858	五粮液	33,692,680.00	4.68
4	600030	中信证券	25,814,628.17	3.59
5	601318	中国平安	25,270,094.00	3.51
6	600104	上汽集团	22,670,168.71	3.15
7	601688	华泰证券	22,141,772.85	3.08
8	601288	农业银行	21,614,340.00	3.00
9	000166	申万宏源	21,109,207.75	2.93
10	000002	万科A	21,013,351.13	2.92

11	000333	美的集团	18,506,289.14	2.57
12	002415	海康威视	18,123,436.45	2.52
13	600276	恒瑞医药	17,681,572.80	2.46
14	000776	广发证券	16,753,949.60	2.33
15	600028	中国石化	16,595,440.70	2.31
16	600900	长江电力	16,395,456.86	2.28
17	002146	荣盛发展	14,399,048.70	2.00
18	000538	云南白药	14,361,694.71	2.00
19	600741	华域汽车	13,799,220.84	1.92
20	601818	光大银行	13,550,158.86	1.88

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	1,514,415,317.43
卖出股票收入（成交）总额	1,555,484,353.58

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	31,974,400.00	3.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,974,400.00	3.67

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019611	19 国债 01	320,000	31,974,400.00	3.67
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

**7.7 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。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末投资股指期货，本期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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



## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期本基金投资的前十名证券除交通银行和浦发银行外，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。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）于 2018 年 12 月 7 日公布的行政处罚信息公开表，交通银行股份有限公司（简称交通银行）因内控管理不严、违规经营等案由，于 2018 年 11 月 9 日被中国银保监会处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚公示：

交通银行股份有限公司（简称交通银行）因反洗钱相关违法行为，于 2018 年 7 月 26 日被中国人民银行处以罚款。

上海浦东发展银行股份有限公司（简称浦发银行）因反洗钱相关违法行为，于 2018 年 7 月 26 日被中国人民银行处以罚款。

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交通银行和浦发银行进行投资。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	276,656.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	337,198.87
5	应收申购款	298,122.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	911,978.66

#### 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

注：本基金本报告期末未持有积极类股票。

#### 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

份额级别	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
长城久泰沪深 300 指数 A	27,865	18,239.10	144,960,962.64	28.52%	363,271,449.50	71.48%
长城久泰沪深 300 指数 C	1,399	1,904.68	-	-	2,664,653.77	100.00%
合计	29,264	17,458.21	144,960,962.64	28.37%	365,936,103.27	71.63%

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长城久泰沪深 300 指数 A	415,289.90	0.0817%
	长城久泰沪深 300 指数 C	75,791.92	2.8443%
	合计	491,081.82	0.0961%

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金

份额总额)。

### 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	份额级别	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	长城久泰沪深 300 指数 A	10~50
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城久泰沪深 300 指数 A	0
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	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

项目	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2004 年 5 月 21 日）基 基金份额总额	1,512,020,891.32	-
本报告期期初基金份额总额	529,161,664.45	-
本报告期期间基金总申购份额	169,696,670.83	7,054,199.32
减：本报告期期间基金总赎回份额	190,625,923.14	4,389,545.55
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	508,232,412.14	2,664,653.77

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

自 2019 年 4 月 2 日起，沈阳女士担任长城基金管理有限公司副总经理，卢盛春先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2019 年 5 月 16 日起，赵建兴先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元 数量	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	备注
长城证券		23,067,836,187.70	100.00%	709,585.38	100.00%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内无交易单元增减变化，截止本报告期末共计六个交易单元。

## 2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，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	52,908,675.60	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-



## **§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**

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。

### **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。