

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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

报告送出日期：2022 年 1 月 24 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。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 21 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。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 709,464,394.68 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。 |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 278,593,656.99 份 | 430,870,737.69 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 长城久泰沪深 300 指数 A | 长城久泰沪深 300 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | -14,410,944.94 | -15,295,323.72 |
| 2. 本期利润 | 2,480,266.72 | 2,116,256.66 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0089 | 0.0054 |
| 4. 期末基金资产净值 | 686,163,886.11 | 711,013,862.44 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.4630 | 1.6502 |

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 | 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 | 0.35% | 0.74% | 1.46% | 0.75% | -1.11% | -0.01% |
| 过去六个月 | -5.40% | 1.04% | -5.13% | 0.97% | -0.27% | 0.07% |
| 过去一年 | -1.62% | 1.17% | -4.85% | 1.11% | 3.23% | 0.06% |
| 过去三年 | 81.20% | 1.22% | 60.69% | 1.22% | 20.51% | 0.00% |
| 过去五年 | 78.98% | 1.13% | 47.14% | 1.14% | 31.84% | -0.01% |

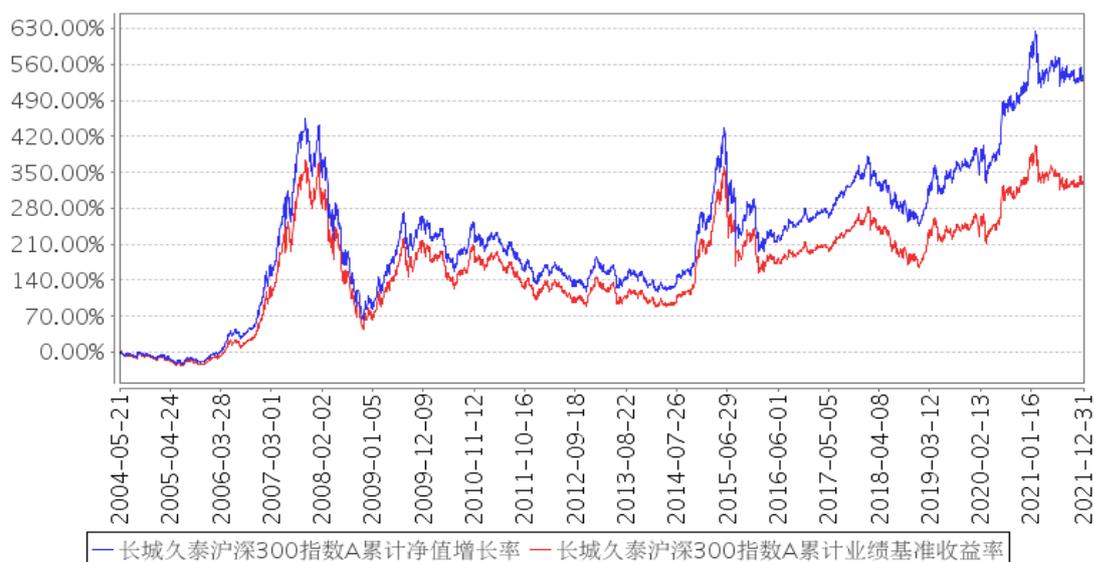
| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 自基金合同 生效起至今 | 537.22% | 1.57% | 331.08% | 1.56% | 206.14% | 0.01% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|

长城久泰沪深 300 指数 C

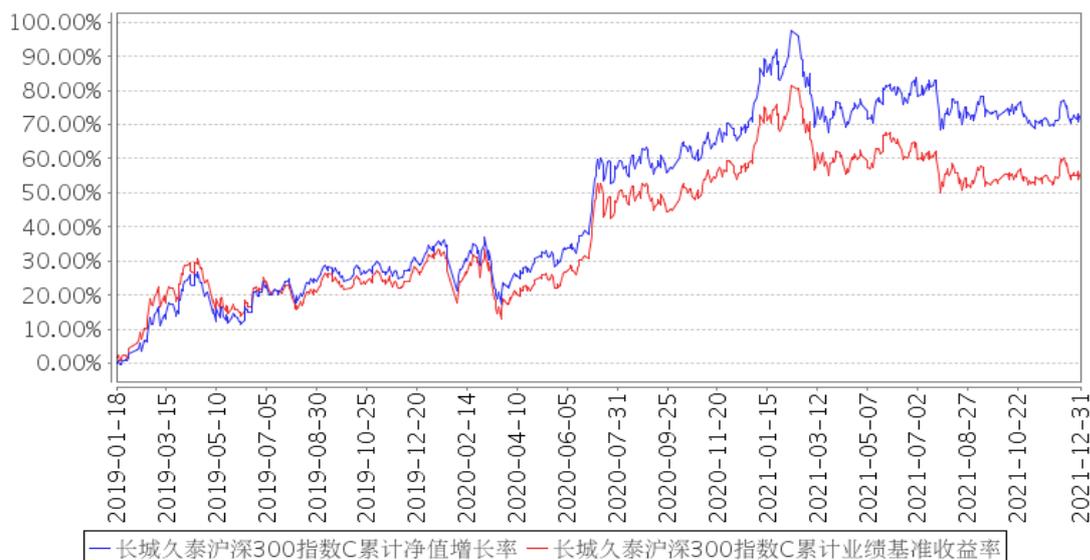
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.22% | 0.74% | 1.46% | 0.75% | -1.24% | -0.01% |
| 过去六个月 | -5.72% | 1.04% | -5.13% | 0.97% | -0.59% | 0.07% |
| 过去一年 | -2.05% | 1.17% | -4.85% | 1.11% | 2.80% | 0.06% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 72.79% | 1.22% | 55.73% | 1.23% | 17.06% | -0.01% |

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

长城久泰沪深300指数A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



长城久泰沪深300指数C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%，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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 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、权益投资部总经理、本基金的基金经理 | 2004年5月21日 | - | 21年 | 男，中国籍，硕士，注册会计师。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳市和君创业投资公司、长城证券有限责任公司投资银行部。2001年10月加入长城基金管理有限公司，历任权益投资部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自2007年9月至2009年1月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自2011年1月至2013年6月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自2009年9月至2016年9月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，自2017年6月至2018年11月任“长城中证500指数增强型证券投资基金”基金经理，自2017年8月至2019年2月任“长城久嘉创新成长灵活配置混 |

| | | | | | |
|----|-------------------------------------|------------------|---|------|--|
| | | | | | 合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 4 月至今任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航混合型证券投资基金”基金经理。 |
| 雷俊 | 公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理、兼任投资经理 | 2018 年 11 月 30 日 | - | 13 年 | 男，中国籍，硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总助、量化与指数投资部总经理、基金经理兼投资经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2019 年 1 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城基金-量化 1 号单一资产管理计划”投资经理。 |

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|------------------|------------------|
| 雷俊 | 公募基金 | 6 | 3,645,731,639.13 | 2014 年 12 月 23 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 201,187,357.11 | 2021 年 4 月 7 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 7 | 3,846,918,996.24 | - |

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度大盘弱势上涨，元宇宙、军工等板块表现强势，周期类板块回撤较大，市场总的趋势性不强。本基金产品运作坚持指数增强的投资思路，均衡各个风险因子，策略四季度略偏在价值和动量上，因子表现弱势，产品小幅跑输业绩基准。

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

截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 A 的基金份额净值为 2.4630 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%；截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 1.6502 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.22%。同期业绩比较基准收益率为 1.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 投资组合报告

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 | 1,318,000,720.64 | 93.99 |
| | 其中：股票 | 1,318,000,720.64 | 93.99 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 292,918.60 | 0.02 |
| | 其中：债券 | 292,918.60 | 0.02 |
| | 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 | 74,146,680.69 | 5.29 |
| 8 | 其他资产 | 9,857,034.15 | 0.70 |
| 9 | 合计 | 1,402,297,354.08 | 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 | 8,163.12 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 37,253,421.90 | 2.67 |
| C | 制造业 | 664,544,267.09 | 47.56 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 17,300,621.24 | 1.24 |
| E | 建筑业 | 19,865,994.12 | 1.42 |
| F | 批发和零售业 | 10,124.93 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 13,007,073.46 | 0.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 16,823,855.55 | 1.20 |
| J | 金融业 | 264,319,227.02 | 18.92 |
| K | 房地产业 | 15,692,610.98 | 1.12 |
| L | 租赁和商务服务业 | 18,190,728.31 | 1.30 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 19,894.80 | 0.00 |
| 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 | 786.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,830,020.56 | 0.42 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,437.40 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,072,872,226.48 | 76.79 |

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 | 189.28 | 0.00 |
| B | 采矿业 | 13,254,982.29 | 0.95 |
| C | 制造业 | 182,650,269.08 | 13.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,392.66 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 715.20 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 46,394.88 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,400,857.86 | 0.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,776,312.60 | 1.70 |
| J | 金融业 | 3,140.75 | 0.00 |
| K | 房地产业 | 1,380.62 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 516.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 735,036.11 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 12,281,474.84 | 0.88 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,195.35 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,953,028.64 | 0.28 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 245,128,494.16 | 17.54 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 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

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 | 600519 | 贵州茅台 | 43,906 | 90,007,300.00 | 6.44 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 989,542 | 48,200,590.82 | 3.45 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 1,048,866 | 38,923,417.26 | 2.79 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 59,100 | 34,750,800.00 | 2.49 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 1,271,100 | 33,569,751.00 | 2.40 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 391,821 | 28,920,308.01 | 2.07 |
| 7 | 600309 | 万华化学 | 282,343 | 28,516,643.00 | 2.04 |
| 8 | 600436 | 片仔癀 | 62,750 | 27,431,162.50 | 1.96 |
| 9 | 002129 | 中环股份 | 625,600 | 26,118,800.00 | 1.87 |
| 10 | 600438 | 通威股份 | 552,600 | 24,844,896.00 | 1.78 |

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 | 600779 | 水井坊 | 116,950 | 14,032,830.50 | 1.00 |
| 2 | 601689 | 拓普集团 | 223,900 | 11,866,700.00 | 0.85 |
| 3 | 000733 | 振华科技 | 94,000 | 11,682,320.00 | 0.84 |
| 4 | 603444 | 吉比特 | 25,500 | 10,757,175.00 | 0.77 |
| 5 | 600765 | 中航重机 | 210,800 | 10,643,292.00 | 0.76 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 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） | 292,918.60 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 292,918.60 | 0.02 |

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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1 | 113633 | 科沃转债 | 2,260 | 292,918.60 | 0.02 |
| 2 | - | - | - | - | - |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

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：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期本基金投资的前十名证券除招商银行和中信证券发行主体外，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）公布的行政处罚信息公开表：

招商银行股份有限公司（简称招商银行）因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等相关违法违规行为，于 2021 年 5 月 17 日被中国银保监会处以罚款。

国家外汇管理局深圳市分局行政处罚信息公示表：

中信证券股份有限公司（简称中信证券）因 QDII 超额度汇出等案由，于 2021 年 11 月 22 日被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 295,111.75 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,369,633.27 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 10,819.43 |
| 5 | 应收申购款 | 181,469.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,857,034.15 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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：无。

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：无。

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

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 |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 281,143,386.95 | 410,303,228.01 |

| | | |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 6,352,309.46 | 94,224,515.21 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 8,902,039.42 | 73,657,005.53 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 278,593,656.99 | 430,870,737.69 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

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

| 投资者类别 | 序号 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----|--------------------------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------|
| | | 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 | 20211001-20211117, 20211217-20211222 | 174,398,690.77 | 14,529,624.64 | 60,000,000.00 | 128,928,315.41 | 18.1726 |
| 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 本基金在短期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。

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

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城久泰沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- (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

9.2 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

9.3 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