

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:2013年8月9日

§ 1 重要提示

基金管理人、董事会、监事会对本基金的报告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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签署并报中国证监会备案。

基金管理人、基金托管人和股份有限公司根据基金合同规定，于2013年08月07日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核后的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本基金资产，但不保证本基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资须谨慎。投资者欲了解详细的产品、风险请阅读相关招募说明书及定期报告。

本报告期未对财务数据未经审计。

本报告期自2013年01月01日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金简称:长城久泰沪深300指数证券投资基金

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:3,139,605,530.36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，分享中国经济的增长长期，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

投资策略:（1）本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深300指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持对固定的股票投资比例，通过运用深入的基本分析及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基准指数的90%-95%，现金或现金等价物的比例不超过5%。（2）被动投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，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通过量化的方法确定，股票投资以沪深300指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成分股的其他股票，并基于基本面研究进行有限的优化调整。（3）本基金将投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益率为主要目标，主要投资于到期日在一年内的政府债券。

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:长城基金管理有限公司

名称:长城基金管理有限公司 招商银行股份有限公司

姓名:车君 张燕

信息披露负责人:联系电话:0755-23982338 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 相关服务机构

基金半年度报告正文本互联网网址: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

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日) 金额单位:人民币元

本期实现营业收入 -17,482,906.27

本期利润 -356,128,659.35

加权平均基金份额本期利润 -0.1490

本期基金份额净值增长率 -11.33%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.7833

期末基金份额净值 2,784,064,797.68

基金份额净值增长率 0.8868

注:本基金已实现收益按基金本期已实现收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)减去相关费用后的余额,计算入账时实际收益水平要低于所列数字。(2)上述基金净值指标不包括持有人交易基金的各项费用,计算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

阶段:份额净值增长率① 份额净值增长率差额② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差额④

过去一个月 -14.08% 1.77% 0.75% 0.00%

过去三个月 -10.55% 1.37% 0.66% -0.01%

过去六个月 -11.33% 1.42% -12.11% 0.78% 0.00%

过去一年 -9.21% 1.29% -9.97% 0.76% -0.01%

过去三年 -12.34% 1.30% -13.44% 1.30% 0.00%

自基金合同生效日起至今 129.43% 1.73% 97.31% 1.73% 32.12% 0.00%

注:从D1到D10的区间业绩比较基准收益率为:0.4*D1业绩比较基准收益率×(0.01*D2业绩比较基准收益率+0.01*D3业绩比较基准收益率+0.01*D4业绩比较基准收益率+0.01*D5业绩比较基准收益率+0.01*D6业绩比较基准收益率+0.01*D7业绩比较基准收益率+0.01*D8业绩比较基准收益率+0.01*D9业绩比较基准收益率+0.01*D10业绩比较基准收益率)。

注:本基金业绩比较基准收益率为:0.4*D1业绩比较基准收益率×(0.01*D2业绩比较基准收益率+0.01*D3业绩比较基准收益率+0.01*D4业绩比较基准收益率+0.01*D5业绩比较基准收益率+0.01*D6业绩比较基准收益率+0.01*D7业绩比较基准收益率+0.01*D8业绩比较基准收益率+0.01*D9业绩比较基准收益率+0.01*D10业绩比较基准收益率)。

注:本基金业绩比较基准收益率为:0.4*D1业绩比较基准收益率×(0.01*D2业绩比较基准收益率+0.01*D3