长城久兆中小板300指数分级证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年08月27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2018年01月01日起至06月30日止。

经中国证监会证监许可[2018]820号文批复,本基金管理人以通讯方式组织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,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》)。本基金于2018年08月13日转型为长城中证500指数增强型证券投资基金,其基金简称、投资目标、投资范围、投资策略和限制、基金费用、收益分配方式、估值方法、风险收益特征等均发生改变,详见2018年08月13日登载于本基金管理人网站的《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》。

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	长城久兆中小板300指数分级		
基金主代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	19,690,207.83份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年2月21日		
下属分级基金的基金简称	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
下属分级基金场内简称:	长城久兆	中小300A	中小300B
下属分级基金的交易代码	162010	150057	150058
报告期末下属分级基金份额总额	15,139,412.83份	1,820,318.00份	2,730,477.00份

注:本基金于2018年08月13日转型为长城中证500指数增强型证券投资基金。

2.2基金产品说明

投资目标	本基金通过投资纪律和数量化监控,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复制和跟踪标的指数时,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。		
下属三级基金的风险收益特征	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。	长城久兆稳健具有低风险、收益相对稳定的特征。	长城久兆积极具有高风险、高预期收益的特征。

注:本基金于2018年08月13日转型为长城中证500指数增强型证券投资基金,其变更后的投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征详见2018年08月13日登载于本基金管理人网站的《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275853

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

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,295,931.07
本期利润	-3,606,385.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1544
本期基金份额净值增长率	-12.96%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0717
期末基金资产净值	18,240,690.33
期末基金份额净值	0.926

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。

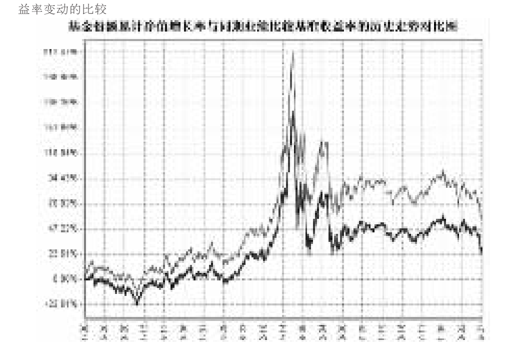
②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	-9.39%	1.65%	-8.90%	1.63%	-0.49%	0.02%
过去三个月	-14.65%	1.27%	-13.70%	1.25%	-0.95%	0.02%
过去六个月	-12.96%	1.24%	-15.22%	1.32%	2.26%	-0.08%
过去一年	-10.91%	1.06%	-12.06%	1.12%	1.15%	-0.06%
过去三年	-33.89%	1.82%	-33.99%	1.72%	0.10%	0.10%
自基金合同生效起至今	27.93%	1.65%	59.15%	1.61%	-31.22%	0.04%

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



注: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。

§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(2018年8月13日起转型为长城中证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、长城久鑫灵活配置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(2018年8月2日起转型为长城久惠灵活配置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、长城久源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、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。

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	-	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、长城证券有限公司投资银行部,2001年10月进入长城基金管理有限公司,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,公司总经理助理和研究部总经理。
王卫林	长城久泰沪深300指数和长城久兆中小板300指数分级基金的基金经理助理	2018年6月8日	-	2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,现任基金经理助理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久兆中小板300指数分级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。本基金报告期报告认为,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

本基金之母基金是跟踪标的为中小板300指数的标准指数基金,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。本基金报告期内严格遵守基金合同,控制跟踪误差,策略基本得当。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为-12.96%,本基金比较基准收益率为-15.22%。

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,我们判断在中美贸易摩擦延续、国内货币、财政政策出现微调、减税效应逐步显现的作用下,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。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。

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

根据《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定:本基金(包括久兆300份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)不进行收益分配。

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,本基金自2018年01月02日起至2018年01月31日止连续22个工作日基金资产净值低于人民币五千万元,自2018年02月05日起至2018年06月29日止连续99个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金管理人已取得证监会同意转型的批复,并以通讯方式组织召开了本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》,在履行相应程序后转型为长城中证500指数增强型证券投资基金。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

根据《长城久兆中小板300指数分级证券投资基金基金合同》,本基金(包括久兆300份额、久兆稳健份额、久兆积极份额)不进行收益分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:长城久兆中小板300指数分级证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		1,555,328.28	2,331,907.54
结算备付金		-	-
存出保证金		2,462.07	1,107.34
交易性金融资产		16,912,281.92	21,540,695.96
其中:股票投资		16,912,281.92	21,540,695.96
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		253.24	520.39
应收股利		-	-
应收申购款		6,758.52	943.67
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,477,084.03	23,875,174.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
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		-	-
应付赎回款		24,063.42	89,201.83
应付管理人报酬		22,978.90	23,842.10
应付托管费		5,055.36	5,245.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		15,232.43	1,528.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		169,063.59	240,329.23
负债合计		236,393.70	360,147.35
所有者权益:			
实收基金		14,250,744.62	16,002,610.57
未分配利润		3,989,945.71	7,512,416.98
所有者权益合计		18,240,690.33	23,515,027.55
负债和所有者权益总计		18,477,084.03	23,875,174.90

注:报告截止日2018年6月30日,长城久兆中小板300指数分级份额净值0.926元,长城久兆稳健指数的参考份额净值1.025元,长城久兆积极指数的参考份额净值0.861元。基金份额总额为19,690,207.83份,其中长城久兆中小板300指数分级份额15,139,412.83份,长城久兆稳健指数份额1,820,318.00份,长城久兆积极指数份额2,730,477.00份。

6.2利润表

会计主体:长城久兆中小板300指数分级证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-3,196,055.71	607,445.39
1.利息收入		18,496.50	14,957.76
其中:存款利息收入		18,496.50	14,957.30
债券利息收入		-	0.46
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)		-978,984.66	-1,520,459.50
其中:股票投资收益		-1,100,852.43	-1,661,538.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	521.84
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		121,867.77	140,557.29
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,310,454.66	2,047,141.88
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		74,887.11	65,805.25
减:二、费用		410,330.02	421,497.70
1. 管理人报酬		121,690.02	143,580.65
2. 托管费		26,771.82	31,587.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		41,616.31	21,355.18
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		220,251.87	224,974.14
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-3,606,385.73	185,947.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-3,606,385.73	185,947.69

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长城久兆中小板300指数分级证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	16,002,610.57	7,512,416.98	23,515,027.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-3,606,385.73	-3,606,385.73
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)	-1,751,865.95	83,914.46	-1,667,951.49
其中:1.基金申购款	42,171,862.72	17,740,712.81	59,912,575.53
2.基金赎回款	-43,923,728.67	-17,656,798.35	-61,580,527.02
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)	14,250,744.62	3,989,945.71	18,240,690.33
项目	上年度可比期间 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)	20,299,917.77	8,331,476.35	28,631,394.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	185,947.69	185,947.69
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)	-2,064,223.78	-571,678.38	-2,635,902.16
其中:1.基金申购款	36,249,819.52	14,579,892.15	50,829,711.67
2.基金赎回款	-38,314,043.30	-15,151,570.53	-53,465,613.83
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)	18,235,693.99	7,945,745.66	26,181,439.65

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______ ______熊科金______ ______赵永强___
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")2011年9月15日下发的证监许可[2011]1474号文"关于核准长城久兆中小板300指数分级证券投资基金募集的批复"的核准,由长城基金管理有限公司作为管理人自2011年12月19日至2012年1月17日止向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2012)验字第60737541_H01号验资报告。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币965,751,817.91元,折合965,751,817.91份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币190,967.22元,折合190,967.22份基金份额。其中场外已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币919,615,817.91元,折合919,615,817.91份基金份额,场外有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币181,884.22元,折合181,884.22份基金份额;场内已收到的首次发售募集的有效认购资金认购金额为人民币46,136,000.00元,折合46,136,000.00份基金份额,场内有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币9,083.00元,折合9,083.00份基金份额。以上实收基金(本息)合计人民币965,942,785.13元,折合965,942,785.13份基金份额。本基金的基金合同于2012年01月30日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")。

本基金的基金份额包括长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之基础份额(简称"久兆300份额")、"久兆稳健份额"与"久兆积极份额"。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为久兆300份额;场内认购的全部份额将按照基金合同约定比例确认为久兆稳健份额与久兆积极份额。久兆300份额设置单独的基金代码,只接受场外与场内申购和赎回;久兆稳健份额、久兆积极份额交易代码不同,只上市交易,不接受申购和赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及基金合同等法律文件的规定,长城基金管理有限公司决定自2015年6月8日起将长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之稳健份额的场内简称由"久兆稳健"(代码:150057)变更为"中小300A",将长城久兆中小板300指数分级证券投资基金之积极份额的场内简称"久兆积极"(代码:150058)变更为"中小300B"。

本基金四份中小300A份额与六份中小300B份额的参考净值之和将等于十份久兆300份额的净值。中小300A份额的约定年收益率为5.8%。中小300A份额的约定年收益率除以365得到中小300A份额的约定日简单收益率。中小300A份额的基金份额参考净值以基金合同生效日或前一份额折算日经折算后的份额净值为基准采用中小300A份额的约定日简单收益率单利进行计算。计算出中小300A份额的份额参考净值后,根据久兆300份额、中小300A份额、中小300B份额净值的关系,可以计算出中小300B份额的份额参考净值。

定期份额折算:自基金合同生效日或前一定期份额折算日次日起至满一年的最后一个工作日止,本基金将按照基金合同规定进行基金的定期份额折算。本基金进行定期份额折算后,中小300A份额期末的约定应得收益将折算为场内久兆300份额分配给中小300A份额持有人,中小300A份额的份额参考净值调整为1.000元;久兆300份额持有人持有的每十份久兆300份额将按四份中小300A份额获得新增久兆300份额的分配,持有场外久兆300份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆300份额的分配,持有场内久兆300份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆300份额的分配。

经过定期份额折算,久兆300份额的份额净值相应进行调整。定期份额折算前后,中小300B份额的份额参考净值及其份额数未发生变化,中小300A份额和中小300B份额的份额配比始终保持4:6的比例不变。折算所产生的场内久兆300份额不进行自动分离。

不定期份额折算:本基金运作期间,如久兆300份额的份额净值达到2.000元或中小300B份额的份额参考净值达到0.250元,本基金将按照基金合同规定进行基金的不定期份额折算。

当久兆300份额的份额净值达到2.000元时,不定期份额折算后,久兆300份额的基金份额净值以及中小300A份额与中小300B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元。不定期份额折算后,持有人持有的久兆300份额的份额数按照久兆300份额折算比例相应增加,持有场外久兆300份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场外久兆300份额的分配,持有场内久兆300份额的基金份额持有人将按前述方式获得新增场内久兆300份额的分配。持有人持有的中小300A份额和中小300B份额的份额数在折算前后均保持不变,因折算新增的份额将全部折算成久兆300份额的场内份额。

当中小300B份额的份额参考净值达到0.250元时,不定期份额折算后,久兆300份额的基金份额净值以及中小300A份额与中小300B份额的基金份额参考净值均调整为1.000元;持有人持有的久兆300份额的份额数按照久兆300份额折算比例相应减少,中小300B份额持有人持有的中小300B份额数按照中小300B份额的折算比例相应减少。为保持中小300A份额和中小300B份额比例不变,中小300A份额的折算比例与中小300B份额相同,中小300A份额持有人持有的中小300A份额数同比例相应减少,超出份额数将全部折算成久兆300份额的场内份额。

不定期份额折算前后,中小300A份额和中小300B份额的份额配比始终保持4:6的比例不变。折算所产生的场内久兆300份额不进行自动分离。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中小板300(价格)指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、资产支持证券、权证,以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,进行组合资产管理。

本基金的业绩比较基准为:中小板300(价格)指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至6月30日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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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征增值税试点的通知》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

本基金本报告期无与对本基金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。

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、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、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

注:本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2债券交易

注:本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3债券回购交易

注:本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

注:本基金于本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

注:本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	121,690.02	143,580.65
其中:支付销售机构的客户维护费	33,969.13	38,538.13

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%/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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,771.82	31,587.73

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.22%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.22%/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

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国建设银行	1,555,328.28	17,940.41	1,816,258.75	13,903.69

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行间同业利率计息。

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末有在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.9期末(2018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

注:本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

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
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项停牌	17.08	-	-	15,073	274,327.34	257,446.84	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项停牌	38.03	-	-	4,002	303,820.06	152,196.06	-
002075	沙钢股份	2016年9月19日	重大事项停牌	19.12	-	-	7,800	112,008.00	149,136.00	-
002408	齐翔腾达	2018年6月21日	重大事项停牌	12.28	-	-	6,729	56,410.85	82,632.12	-
002310	东方园林	2018年5月25日	重大事项停牌	15.03	2018年8月27日	13.47	5,333	68,109.86	80,154.99	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项停牌	11.55	-	-	5,669	117,677.51	65,476.95	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项停牌	32.50	-	-	1,800	35,010.00	58,500.00	-
002665	首航节能	2018年6月15日	重大事项停牌	5.80	-	-	9,459	89,848.65	54,862.20	-
002630	华西能源	2018年6月20日	重大事项停牌	6.54	-	-	8,080	64,649.15	52,843.20	-
002051	中工国际	2018年6月14日	重大事项停牌	15.27	-	-	3,331	61,474.61	50,864.37	-
002716	金贵银业	2018年5月3日	重大事项停牌	16.84	-	-	2,702	34,419.10	45,501.68	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项停牌	6.20	2018年8月13日	5.57	7,019	69,284.64	43,517.80	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项停牌	3.60	2018年7月3日	3.26	12,000	69,861.65	43,200.00	-
002263	*ST东南	2018年2月26日	重大事项停牌	2.96	-	-	14,318	62,781.64	42,381.28	-
002699	美盛文化	2018年2月5日	重大事项停牌	18.76	2018年7月2日	16.88	2,080	38,440.73	39,020.80	-
002089	新海宜	2018年4月20日	重大事项停牌	6.05	2018年7月20日	5.45	6,300	63,377.68	38,115.00	-
002005	德豪润达	2018年1月2日	重大事项停牌	4.36	2018年7月2日	3.92	8,624	94,681.23	37,600.64	-
002147	新光圆成	2018年1月18日	重大事项停牌	14.76	-	-	2,500	29,788.46	36,900.00	-
002477	雏鹰农牧	2018年6月14日	重大事项停牌	3.31	-	-	10,185	57,078.56	33,712.35	-
002431	棕榈股份	2018年6月12日	重大事项停牌	6.71	-	-	4,983	49,864.24	33,435.93	-
002121	科陆电子	2018年6月7日	重大事项停牌	6.49	2018年8月6日	5.84	5,110	57,566.58	33,163.90	-
002512	达华智能	2018年6月19日	重大事项停牌	9.70	-	-	3,200	51,232.00	31,040.00	-
002436	兴森科技	2018年6月14日	重大事项停牌	4.29	-	-	7,021	53,734.34	30,120.09	-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大事项停牌	4.07	-	-	7,100	32,442.74	28,897.00	-
002143	印纪传媒	2018年2月2日	重大事项停牌	12.09	2018年7月9日	10.88	1,799	30,499.62	21,749.91	-
002502	骅威文化	2018年6月5日	重大事项停牌	5.82	-	-	3,501	42,450.44	20,375.82	-
002011	盾安环境	2018年5月2日	重大事项停牌	6.40	-	-	2,800	22,073.94	17,920.00	-
002610	爱康科技	2018年6月5日	重大事项停牌	2.10	-	-	900	2,899.91	1,890.00	-

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2018年6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15,329,626.99元,划分为第二层次的余额为人民币1,582,654.93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(包括涨跌停时的交易不活跃)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	16,912,281.92	91.53
	其中:股票	16,912,281.92	91.53
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	1,555,328.28	8.42
7	其他各项资产	9,473.83	0.05
8	合计	18,477,084.03	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	213,973.70	1.17
B	采矿业	72,013.44	0.39
C	制造业	11,821,290.57	64.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,257.65	0.24
E	建筑业	371,718.07	2.04
F	批发和零售业	505,629.78	2.77
G	交通运输、仓储和邮政业	120,790.39	0.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,935,554.63	10.61
J	金融业	523,285.90	2.87
K	房地产业	237,607.45	1.30
L	租赁和商务服务业	496,884.03	2.72
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	65,476.95	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	189,388.00	1.04
R	文化、体育和娱乐业	258,517.68	1.42
S	综合	-	-
	合计	16,856,388.24	92.41

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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	37,600.64	0.21
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,293.04	0.10
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	55,893.68	0.31

7.3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

7.3.1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	002399	海普瑞	27,310	604,643.40	3.31
2	002032	苏泊尔	10,390	535,085.00	2.93
3	002384	东山精密	21,532	516,768.00	2.83
4	002410	广联达	17,926	497,087.98	2.73
5	002304	洋河股份	3,610	475,076.00	2.60
6	002110	三钢闽光	25,800	413,574.00	2.27
7	002230	科大讯飞	9,582	307,294.74	1.68
8	002027	分众传媒	31,176	298,354.32	1.64
9	002024	苏宁易购	21,049	296,369.92	1.62
10	002450	康得新	15,073	257,446.84	1.41

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积极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	002005	德豪润达	8,624	37,600.64	0.21
2	002344	海宁皮城	3,764	18,293.04	0.10

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	002035	华帝股份	1,365,854.00	5.81
2	002027	分众传媒	1,190,408.00	5.06
3	002475	立讯精密	960,043.00	4.08
4	002236	大华股份	750,474.00	3.19
5	002572	索菲亚	727,951.00	3.10
6	002008	大族激光	720,857.00	3.07
7	002399	海普瑞	714,047.00	3.04
8	002110	三钢闽光	621,969.00	2.64
9	002032	苏泊尔	568,702.05	2.42
10	002384	东山精密	566,030.00	2.41
11	002410	广联达	554,767.00	2.36
12	002415	海康威视	415,828.00	1.77
13	002202	金风科技	169,986.00	0.72
14	002304	洋河股份	162,081.00	0.69
15	002456	欧菲科技	158,460.00	0.67
16	002508	老板电器	138,388.00	0.59
17	002050	三花智控	133,372.00	0.57
18	002271	东方雨虹	132,320.00	0.56
19	002074	国轩高科	126,482.00	0.54
20	002709	天赐材料	119,797.98	0.51

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	002415	海康威视	1,241,037.00	5.28
2	002475	立讯精密	1,039,022.00	4.42
3	002035	华帝股份	1,028,570.33	4.37
4	002027	分众传媒	1,005,611.00	4.28
5	002008	大族激光	934,634.00	3.97
6	002572	索菲亚	806,252.00	3.43
7	002236	大华股份	776,046.00	3.30
8	002304	洋河股份	228,941.00	0.97
9	002410	广联达	219,300.00	0.93
10	002110	三钢闽光	175,756.00	0.75
11	002456	欧菲科技	172,209.00	0.73
12	002202	金风科技	166,150.00	0.71
13	002271	东方雨虹	150,904.00	0.64
14	002050	三花智控	149,915.00	0.64
15	002074	国轩高科	143,272.70	0.61
16	002230	科大讯飞	137,063.00	0.58
17	002508	老板电器	132,045.00	0.56
18	002024	苏宁易购	129,099.00	0.55
19	002709	天赐材料	117,386.00	0.50
20	002399	海普瑞	94,778.00	0.40

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	12,880,661.25
卖出股票收入(成交)总额	14,097,768.20

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:本基金本报告期未投资股指期货,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

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	2,462.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	253.24
5	应收申购款	6,758.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,473.83

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

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	002450	康得新	257,446.84	1.41	重大事项停牌

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	002005	德豪润达	37,600.64	0.21	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

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
长城久兆中小板300指数分级	2,031	7,454.17	47,826.00	0.32%	15,091,586.83	99.68%
长城久兆稳健指数	161	11,306.32	7,916.00	0.43%	1,812,402.00	99.57%
长城久兆积极指数	625	4,368.76	13,404.00	0.49%	2,717,073.00	99.51%
合计	2,817	6,989.78	69,146.00	0.35%	19,621,061.83	99.65%

注:①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)。

②以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2期末上市基金前十名持有人

长城久兆稳健指数

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	徐平	1,085,024.00	59.61%
2	王丽春	330,289.00	18.14%
3	李惠霞	154,000.00	8.46%
4	常兰网	20,294.00	1.11%
5	王友泰	18,277.00	1.00%
6	黄辉	17,068.00	0.94%
7	胡勇	15,589.00	0.86%
8	汪晓岩	15,000.00	0.82%
9	谌文武	11,800.00	0.65%
10	徐凤霞	9,293.00	0.51%

长城久兆积极指数

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	陈朝阳	406,900.00	14.90%
2	黄添胜	88,009.00	3.22%
3	金燕	58,363.00	2.14%
4	吴肇月	52,062.00	1.91%
5	杨玉锋	50,000.00	1.83%
6	陈利宁	49,700.00	1.82%
7	曹凤琴	47,000.00	1.72%
8	袁晓增	42,560.00	1.56%
9	徐晓颖	39,033.00	1.43%
10	伍徐远	38,932.00	1.43%

注:①持有人为场内持有人,占上市总份额比例=场内持有人持有场内份额/场内总份额比例×100%。

②对于长城久兆稳健指数、长城久兆积极指数前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别份额总数。

③以基金账户为统计口径。

④以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注:期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.4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	长城久兆中小板300指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城久兆中小板300指数分级	0
	长城久兆稳健指数	0
	长城久兆积极指数	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	长城久兆中小板300指数分级	长城久兆稳健指数	长城久兆积极指数
基金合同生效日(2012年1月30日)基金份额总额	919,797,702.13	18,458,033.00	27,687,050.00
本报告期期初基金份额总额	16,479,110.21	2,063,626.00	3,095,439.00
本报告期基金总申购份额	58,249,498.02	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	60,620,231.58	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,031,036.18	-243,308.00	-364,962.00
本报告期期末基金份额总额	15,139,412.83	1,820,318.00	2,730,477.00

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和基金定期份额折算中新增的份额。

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本基金管理人以通讯方式组织召开了长城久兆中小板300指数分级证券投资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》,长城久兆中小板300指数分级证券投资基金转型为长城中证500指数增强型证券投资基金,调整基金的投资目标、投资范围和投资策略等,并修订基金合同、托管协议和招募说明书等法律文件,具体内容详见本基金管理人于2018年7月6日发布的《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》及2018年8月13日发布的《长城中证500指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件。

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2018年2月13日起,桑煜先生不再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。本基金于2018年08月13日转型为长城中证500指数增强型证券投资基金,其基金投资策略变更为"(1)资产配置策略: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。(2)股票投资策略:本基金股票投资主要通过量化模型,选取预期相对基准收益较好的股票构建投资组合,在控制组合跟踪误差的基础上,力争获取超越基准的业绩回报。本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果,采用量化多因子股票模型进行投资。多因子模型基于A股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,通过回测研究各个因子的历史表现,寻找收益稳定、互补性强的因子对股票进行综合评分,根据评分结果精选各个行业的优质股票构成组合。(3)股指期货投资策略:本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。"

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	
兴业证券	1	26,978,429.45	100.00%	25,124.88	100.00%	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	3	-	-	-	-	-

注:1.报告期内租用证券公司席位的变更情况:

本报告期内共新增太平洋证券2个专用交易单元,截止本报告期末共计56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,具备健全的合法、合规需求;

(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要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(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

注:本基金本报告期未发生租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况。

§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	20180531-20180606	-	11,821,662.00	11,821,662.00	-	-
	2	20180201-20180211	-	19,285,438.77	19,285,438.77	-	-
个人	1	20180607-20180613	-	5,910,332.00	5,910,332.00	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
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,基金会面临调整困难,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
大额赎回会导致基金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标及投资策略;
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。