长城久泰沪深300指数证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

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
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	449,542,755.80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。
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	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

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	68,567,898.75
本期利润	-74,678,589.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1864
本期基金份额净值增长率	-10.73%
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	0.0008
期末基金资产净值	687,972,620.25
期末基金份额净值	1.5304

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。

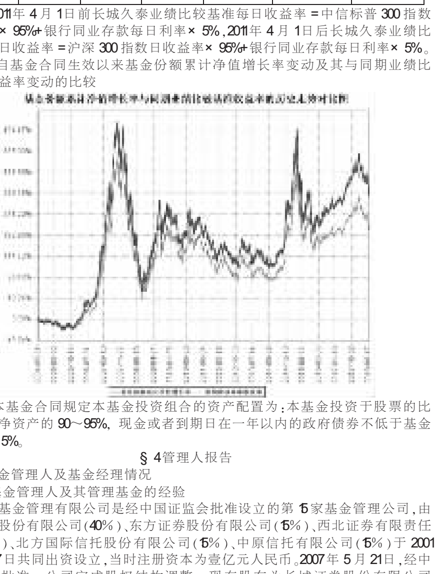
3.2 基金净值表现

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	-5.67%	1.28%	-7.28%	1.22%	1.61%	0.06%
过去三个月	-7.30%	1.11%	-9.44%	1.08%	2.14%	0.03%
过去六个月	-10.73%	1.11%	-12.24%	1.10%	1.51%	0.01%
过去一年	-0.95%	0.91%	-3.95%	0.90%	3.00%	0.01%
过去三年	-12.30%	1.44%	-20.15%	1.41%	7.85%	0.03%
自基金合同生效起至今	295.94%	1.64%	210.20%	1.63%	85.74%	0.01%

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



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%。

§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、长城久安保本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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	2004年5月21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"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，我国面临的外部宏观经济环境变得错综复杂，一方面，欧美等主要经济体增长势头强劲，美联储连续加息，美元指数震荡走高，外需形势总体向好，另一方面，自3月份开始，美国政府频繁舞动关税大棒，对包括中国在内的主要经济体挑起贸易争端，引发对全球经济产生动荡的担忧，人民币汇率也出现较大幅度的波动。国内宏观经济仍然比较平稳，但是下行压力有所显现。投资、外需、国内消费都有放缓的迹象，最新公布的6月份PMI数据为51.5，环比有所回落，但仍处于扩张区间。证券市场受到国内宏观经济预期走弱、汇率波动、中美贸易摩擦、CDR扩容预期等因素作用，投资者风险偏好下行，市场震荡走低。汇率波动也引发对外资跨市场流动的担忧。指数波动有所加大。

本基金报告期内严格遵守基金合同，基于长城基金量化投资研究平台的研究成果严控跟踪误差，谋求适度超额收益，总体操作基本得当。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.5304元；业绩比较基准收益率为-12.24%，本基金净值增长率为-10.73%。本基金报告期内日均跟踪误差为0.1293%，年化跟踪误差为2.0024%。

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，我们判断中美贸易摩擦仍将持续发酵，但是对市场的影响会逐步减弱。货币政策已经出现逐步放松的迹象，资管新规的实施、去杠杆的进程都可能会微调，财政政策也有望边际放松，减税政策的效应会逐步显现。综上所述，宏观经济仍将保持平稳运行的态势。证券市场随着对外开放步伐的加快，与国际市场的联动正在加强，受到国际市场波动的影响也在所难免。而把握公司的核心价值、关注企业的核心竞争能力，挖掘在中国增长方式转变过程中能够最终胜出的公司是未来获取更好的投资收益的关键。

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。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

本基金本报告期未进行利润分配，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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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：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		35,540,692.47	37,668,446.54
结算备付金		4,020,170.00	72,128.01
存出保证金		92,518.74	70,091.69
交易性金融资产		649,849,034.34	649,130,171.04
其中：股票投资		649,849,034.34	649,130,171.04
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		9,350.93	8,765.13
应收股利		-	-
应收申购款		285,421.90	192,416.04
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		689,797,188.38	687,142,018.45
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		638,306.18	569,718.92
应付管理人报酬		577,623.21	572,136.95
应付托管费		117,882.29	116,762.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		313,307.35	76,410.00
应交税费		0.09	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		177,449.01	382,471.73
负债合计		1,824,568.13	1,717,500.23
所有者权益：			
实收基金		449,542,755.80	399,805,494.14
未分配利润		238,429,864.45	285,619,024.08
所有者权益合计		687,972,620.25	685,424,518.22
负债和所有者权益总计		689,797,188.38	687,142,018.45

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.5304元，基金份额总额449,542,755.80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：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		-68,589,766.05	93,876,096.90
1.利息收入		151,615.91	180,537.14
其中：存款利息收入		151,555.76	180,468.74
债券利息收入		60.15	68.40
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)		74,420,412.38	23,389,351.98
其中：股票投资收益		67,533,834.60	17,529,339.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		772.61	20,039.50
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		6,885,805.17	5,839,972.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-143,246,488.05	69,978,547.65
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		84,693.71	327,660.13
减：二、费用		6,088,823.25	5,125,696.89
1. 管理人报酬		3,268,168.36	3,438,941.54
2. 托管费		666,973.09	701,824.78
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,979,511.31	795,283.28
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		174,170.29	189,647.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-74,678,589.30	88,750,400.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-74,678,589.30	88,750,400.01

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：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)	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

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)	458,974,347.89	172,600,496.46	631,574,844.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	88,750,400.01	88,750,400.01
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)	46,963,803.95	14,458,454.82	61,422,258.77
其中：1.基金申购款	229,030,710.96	94,518,382.78	323,549,093.74
2.基金赎回款	-182,066,907.01	-80,059,927.96	-262,126,834.97
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)	505,938,151.84	275,809,351.29	781,747,503.13

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%×沪深300指数收益率+5%×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%×中信标普300指数收益率+5%×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2018年06月30日的财务状况以及自2018年01月01日至2018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.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 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	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
长城证券	1,692,061,575.24	88.18%	186,330,797.53	34.55%
东方证券	194,681,312.86	10.15%	119,715,692.15	22.20%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期债券成交总额的比例
长城证券	161,020.76	96.40%	-	-
东方证券	6,013.68	3.60%	763,107.90	100.00%

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 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
长城证券	674,329.14	76.15%	299,065.31	95.45%
东方证券	181,307.06	20.47%	258.62	0.08%

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
长城证券	173,530.03	34.55%	-	-
东方证券	111,491.28	22.20%	46,222.10	34.68%

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 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	3,268,168.36	3,438,941.54
其中：支付销售机构的客户维护费	707,536.43	697,859.44

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×0.98%/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 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	666,973.09	701,824.78

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×0.2%/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。

6.4.8.3 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 期末余额	当期利息收入	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
招商银行	35,540,692.47	138,695.15	43,460,250.90	176,995.09

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(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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 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
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
002892	科力尔	2017年8月10日	2018年8月17日	新股锁定	17.56	29.90	11,000	193,160.00	328,900.00	-
603156	养元饮品	2018年2月2日	2019年2月12日	新股锁定	78.73	54.86	52,804	2,969,459.41	2,896,827.44	-

注：根据养元饮品2017年年度权益分派实施公告，以方案实施前的公司总股本538,050,000股为基数，向全体股东每股派发现金红利2.60元(含税)，每股派送红股0.40股。除权除息日为2018年5月8日。本基金所持有的养元饮品获得转增股15,087股。

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
601727	上海电气	2018年6月7日	重大事项停牌	6.34	2018年8月7日	5.71	1,029,929	6,368,231.73	6,529,749.86	-
000603	盛达矿业	2018年6月11日	重大事项停牌	10.83	2018年8月21日	9.75	564,300	6,408,674.00	6,111,369.00	-
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项停牌	7.47	2018年8月20日	7.25	381,530	3,094,338.82	2,850,029.10	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项停牌	32.50	-	-	46,451	1,625,572.45	1,509,657.50	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项停牌	38.03	-	-	35,600	2,614,774.66	1,353,868.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	4.87	-	-	257,100	1,382,616.72	1,252,077.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.59	-	-	79,530	2,183,970.23	1,160,342.70	-
600221	海航控股	2018年1月11日	重大事项停牌	3.23	2018年7月20日	2.91	354,550	1,199,107.66	1,145,196.50	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项停牌	5.84	2018年7月17日	5.26	120,600	965,549.07	704,304.00	-
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	61	1,134.28	916.83	-
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项停牌	17.08	-	-	19	296.14	324.52	-
601118	海南橡胶	2018年5月25日	重大事项停牌	6.62	-	-	24	166.36	158.88	-

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623,917,282.86元，划分为第二层次的余额为人民币25,931,751.48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	649,849,034.34	94.21
	其中：股票	649,849,034.34	94.21
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	39,560,862.47	5.74
7	其他各项资产	387,291.57	0.06
8	合计	689,797,188.38	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	5,335.20	0.00
B	采矿业	12,094,003.23	1.76
C	制造业	191,332,241.60	27.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,647,463.27	0.82
E	建筑业	24,561,901.71	3.57
F	批发和零售业	10,327,395.88	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	15,480,507.71	2.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,234,227.78	1.49
J	金融业	195,155,732.34	28.37
K	房地产业	32,859,104.94	4.78
L	租赁和商务服务业	13,894,674.38	2.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,990.91	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	5,489.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,907,129.34	0.86
S	综合	-	-
	合计	517,510,197.29	75.22

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	158.88	0.00
B	采掘业	10,659,160.11	1.55
C	制造业	78,135,553.00	11.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,908,071.53	1.15
E	建筑业	6,389,108.00	0.93
F	批发和零售业	12,788,965.00	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	7,887,940.00	1.15
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	440.34	0.00
K	房地产业	3,203,208.00	0.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	5,284,132.05	0.77
S	综合	874.00	0.00
	合计	132,338,837.05	19.24

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	601318	中国平安	750,734	43,977,997.72	6.39
2	000651	格力电器	477,010	22,491,021.50	3.27
3	600036	招商银行	652,909	17,262,913.96	2.51
4	600016	民生银行	2,340,645	16,384,515.00	2.38
5	000858	五粮液	189,941	14,435,516.00	2.10
6	000333	美的集团	268,436	14,017,727.92	2.04
7	601288	农业银行	3,784,531	13,018,786.64	1.89
8	600104	上汽集团	346,990	12,141,180.10	1.76
9	000002	万科A	484,759	11,925,071.40	1.73
10	601398	工商银行	2,219,115	11,805,691.80	1.72

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。

7.3.2 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	600270	外运发展	309,300	6,482,928.00	0.94
2	600681	百川能源	479,600	6,215,616.00	0.90
3	000603	盛达矿业	564,300	6,111,369.00	0.89
4	300476	胜宏科技	395,200	6,086,080.00	0.88
5	002737	葵花药业	280,400	6,065,052.00	0.88

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	19,625,934.70	2.86
2	601318	中国平安	19,366,563.68	2.83
3	601288	农业银行	19,261,638.00	2.81
4	600036	招商银行	18,445,258.98	2.69
5	601398	工商银行	17,714,892.30	2.58
6	600887	伊利股份	16,411,269.23	2.39
7	000002	万科A	14,486,616.82	2.11
8	601601	中国太保	14,156,672.22	2.07
9	000333	美的集团	13,795,843.70	2.01
10	600094	大名城	13,287,881.16	1.94
11	600828	茂业商业	13,153,574.94	1.92
12	600030	中信证券	12,616,018.40	1.84
13	000923	河北宣工	12,344,595.00	1.80
14	002416	爱施德	12,059,716.85	1.76
15	002016	世荣兆业	11,810,307.09	1.72
16	600380	健康元	11,792,499.45	1.72
17	000830	鲁西化工	11,596,836.00	1.69
18	000651	格力电器	11,170,708.00	1.63
19	002415	海康威视	10,740,331.84	1.57
20	600104	上汽集团	10,223,665.00	1.49

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	600519	贵州茅台	29,990,999.00	4.38
2	600887	伊利股份	24,960,407.20	3.64
3	600030	中信证券	21,865,566.34	3.19
4	600036	招商银行	18,472,851.61	2.70
5	601166	兴业银行	17,930,793.47	2.62
6	000333	美的集团	15,983,777.98	2.33
7	601328	交通银行	14,998,179.80	2.19
8	002016	世荣兆业	14,625,682.92	2.13
9	000830	鲁西化工	14,060,137.00	2.05
10	601288	农业银行	12,652,481.00	1.85
11	600094	大名城	12,488,308.00	1.82
12	600828	茂业商业	12,041,796.53	1.76
13	600380	健康元	11,832,492.67	1.73
14	601398	工商银行	11,196,153.00	1.63
15	002416	爱施德	11,133,888.03	1.62
16	000002	万科A	10,593,932.00	1.55
17	000923	河北宣工	10,513,755.00	1.53
18	600900	长江电力	9,778,418.51	1.43
19	601601	中国太保	9,575,472.84	1.40
20	600580	卧龙电气	9,564,390.80	1.40

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	1,000,179,121.98
卖出股票收入(成交)总额	923,747,605.23

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

本报告期本基金投资的前十名证券除招商银行外，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于2018年5月4日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)因内控管理不严、违规经营等，于2018年2月12日被银监会处以罚款。

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招商银行进行投资。

7.12.2

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	92,518.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,350.93
5	应收申购款	285,421.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	387,291.57

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

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	000603	盛达矿业	6,111,369.00	0.89	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

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
28,030	16,037.91	82,985,853.54	18.46%	366,556,902.26	81.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	423,681.02	0.0942%

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	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

基金合同生效日(2004年5月21日)基金份额总额	1,512,020,891.32
本报告期期初基金份额总额	399,805,494.14
本报告期基金总申购份额	88,137,560.06
减：本报告期基金总赎回份额	38,400,298.40
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	449,542,755.80

§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。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
长城证券	2	1,692,061,575.24	88.18%	674,329.14	76.15%	-
东方证券	2	194,681,312.86	10.15%	181,307.06	20.47%	-
华西证券	1	30,549,667.75	1.59%	28,451.00	3.21%	-
银河证券	1	1,560,625.39	0.08%	1,453.40	0.16%	-

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	161,020.76	96.40%	-	-	-	-
东方证券	6,013.68	3.60%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

§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

为了更好地满足投资者的理财需求，本报告期本基金管理人根据本基金合同的相关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，对本基金基金合同中"申购与赎回数额限制"等内容进行修改，修订后的基金合同自2018年4月3日起生效。修订的具体内容详见本管理人于2018年3月29日发布的《关于修改〈长城久泰沪深300指数证券投资基金基金合同〉"申购与赎回数额限制"等内容的公告》。