长城品牌优选股票型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:2014年7月18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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年07月15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2014年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城品牌优选股票
基金主代码	200008
交易代码	200008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月6日
报告期末基金份额总额	11,485,209,189.08份
投资目标	充分挖掘具有品牌优势上市公司持续成长产生的投资机会,追求基金资产的长期增值。
投资策略	采用“自下而上、个股优选”的投资策略,运用长城基金成长优势评估系统在具备品牌优势的上市公司中挑选拥有创造超额利润能力的公司,构建并动态优化投资组合。运用综合市场占有率、超过行业平均水平的盈利能力及潜在并购价值等三项主要指标判断品牌企业创造超额利润的能力,采用PEG等指标考察企业的持续成长价值,重点选择各行业中的优势品牌企业,结合企业的持续成长预期,优选具备估值潜力的公司构建投资组合。
业绩比较基准	75%×中信标普300指数收益率+25%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为成长型股票基金,主要投资于具有超额盈利能力的品牌优势上市公司,风险高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,低于积极成长型股票基金,属于较高风险的证券投资基金产品。
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

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	22,178,879.49
2.本期利润	72,621,393.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金资产净值	7,672,709,614.62
5.期末基金份额净值	0.6681

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 本报告期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	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	0.95%	0.84%	0.85%	0.64%	0.10%	0.20%

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

注:本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为:股票资产60%-95%,权证投资0%-3%,债券0%-35%,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2013年6月18日	-	14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、长城证券有限责任公司投资银行部,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”和“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。

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》、《长城品牌优选股票型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

A股市场2季度迎来了小反弹,上证指指和沪深300指数均上涨1%,同期久兆基金所跟踪的中小板300价格指数上涨了4%。2季度上涨幅度最大的板块是创业板,以创业板综合指数计,2季度上涨了11%,但创业板的估值水平也上涨至平均动态市盈率62倍。

我们观察到5月宏观数据显示经济略有反弹,但中微观许多行业的需求和价格数据却与宏观数据改善并不匹配。根据从中观对宏观的印证分析,消费近期强改善和出口2季度稍向好较为确定,而固定资产投资的微幅反弹与多个中上游行业走弱相背离。6月汇丰PMI由上月49.4升至本月50.8,为今年来首次突破荣枯平衡线,且是7个月来的最高水平,显示制造业景气度进一步好转。6月中观数据显示经济反弹存隐忧,地产销售继续下滑,库存状况转差,工业增速短期反弹或后继无力。物价方面,猪价继续回落,通胀短期稳定。国内流动性方面,正回购首次暂停,包括此前的定向降准、再贷款等,再加上本次正回购暂停,以及未来逆回购可能的重启,均标志央行宽松货币政策基调未变。本轮经济反弹的另一个悬疑现象是,大多工业品价格依然萎靡不振。我们认为,PPI环比反弹主要受国际油价上涨所带动,但油价更多反映的是海外经济因素,而大多数工业品更受国内因素影响,在需求暂稳背景下,价格萎靡不振续于供给端压力仍大,宏观和中观数据显示当前库存状况差于去年同期。

对3季度的市场,我们认为仍然从经济基本面和政策面两方面去观察。未来经济继续回升仍存在去年3季度高基数、库存偏高压制供需改善和地产仍无改观等三大隐忧。近日全国各地纷纷出台微刺激政策,稳增长似有全面加码,但与以往相比,今年最大的区别在于影子银行的全面监管,加上防控地方债务风险,因而资金来源将成为全面刺激的最大制约。除非政府开闸放水解决投资资金来源问题,否则经济反弹容易衰竭。

中小板块将受益于市场反弹。长城久兆中小板300指数分级基金作为交易型投资工具,适合于投资者作为交易品种投资。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。

4.5 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0.95%,本基金业绩比较基准收益率为0.85%。

§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	6,629,147,249.57	85.54
	其中:股票	6,629,147,249.57	85.54
2	固定收益投资	350,326,140.00	4.52
	其中:债券	350,326,140.00	4.52
	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	207,400,861.10	2.68
	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	546,963,619.49	7.06
7	其他资产	15,591,050.20	0.20
8	合计	7,749,428,920.36	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,811,512,428.62	62.71
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	140,995,700.00	1.84
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	322,460,802.67	4.20
J	金融业	1,078,241,990.74	14.05
K	房地产业	187,526,955.79	2.44
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,040,000.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	85,369,371.75	1.11
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	6,629,147,249.57	86.40

5.3 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	601299	中国北车	146,228,048	663,875,337.92	8.65
2	601766	中国南车	126,915,415	571,119,367.50	7.44
3	601318	中国平安	9,870,445	388,303,306.30	5.06
4	600887	伊利股份	9,800,516	324,593,089.92	4.23
5	601166	兴业银行	30,445,427	305,367,632.81	3.98
6	600519	贵州茅台	1,980,880	281,245,342.40	3.67
7	000895	双汇发展	6,019,126	215,424,519.54	2.81
8	600406	国电南瑞	15,981,847	213,038,020.51	2.78
9	000651	格力电器	7,222,061	212,689,696.45	2.77
10	000400	许继电气	9,877,987	198,053,639.35	2.58

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	290,218,140.00	3.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,078,000.00	0.39
	其中:政策性金融债	30,078,000.00	0.39
4	企业债券	30,030,000.00	0.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	350,326,140.00	4.57

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	019407	14国债07	2,000,000	200,800,000.00	2.62
2	019411	14国债11	500,000	49,974,700.00	0.65
3	140327	14进出27	300,000	30,078,000.00	0.39
4	122277	13华域01	300,000	30,030,000.00	0.39
5	010107	21国债(7)	291,800	29,413,440.00	0.38

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期末未持有股指期货。

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: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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,037,342.89
2	应收证券清算款	10,717,812.01
3	应收股利	-
4	应收利息	3,729,343.57
5	应收申购款	106,551.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,591,050.20

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	11,833,949,373.15
报告期期间基金总申购份额	33,012,160.93
减:报告期期间基金总赎回份额	381,752,345.00
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	11,485,209,189.08

§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:本基金的基金管理人于本报告期未运用固有资金投资于本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准长城品牌优选股票型证券投资基金设立的文件

2.《长城品牌优选股票型证券投资基金基金合同》

3.《长城品牌优选股票型证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

7.中国证监会规定的其他文件

8.2 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

8.3 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

公司网址:http://www.ccfund.com.cn

长城久泰沪深300指数证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:2014年7月18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2014年07月15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2014年04月01日起至06月30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
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
报告期末基金份额总额	1,465,600,931.95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)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,本基金将保持相对固定的股票投资比例,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。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指数的成分股为主,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度的优化调整。 (3)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

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-9,440,605.92
2.本期利润	18,447,395.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0141
4.期末基金资产净值	1,288,739,761.89
5.期末基金份额净值	0.8793

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 本报告期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	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	1.51%	0.83%	0.85%	0.83%	0.66%	0.00%

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

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、基金管理部总经理、长城久泰、长城久富和长城品牌的基金经理	2004年5月21日	-	14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、长城证券有限责任公司投资银行部,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”和“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理、公司总经理助理。

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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,外部宏观经济环境有所改善,美联储继续缩减QE规模,但是加息预期有所减弱,美国经济一季度受天气影响GDP增速调整为负数,但是二季度预计会有不错的增长,欧元区进一步降息以提振经济,隔夜存款利率甚至已经调整到负利率。国内经济则面临房地产投资增速下滑、社会消费品零售总额同比仍保持低速增长以及进口低迷等内需不足问题的困扰。政府和央行不断推出微刺激政策和定向宽松(放松存贷比、定向降准、再贷款)等政策以保持GDP增长达到调控目标,二季度各月数据有效果有所显现,但是增长动力仍然较弱。在宏观经济有所企稳的环境中,A股市场仍然呈现冰火两重天的走势。IPO在6月份再度重启,年内100家左右的预计发行数量大大低于市场此前的预期。在宏观经济未显示新的增长动力,市场存量资金博弈态势依旧的格局下,中小市值个股和新兴产业个股仍然成为市场资金关注的重点。大市值、传统经济相关的个股继续成为被抛弃的对象,蕴含新兴产业主题的信息安全、信息消费、军工、互联网(游戏、教育)、新能源汽车成为市场持续的热点。报告期内本基金少量增持了部分机械设备、信息技术、医药和食品饮料个股,减持了金融股。受到电力设备市场投资进度慢于预期以及国内消费不振的影响,本基金持仓的大市值电力设备、大众品牌消费品股以及部分家电股表现较弱,本基金净值表现较为一般。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金日标指数沪深 300 指数收益率0.88%,本基金比较基准收益率为0.85%,本基金报告期净值收益率为1.51%。本基金年初至报告期末日均跟踪误差为 0.0357%,年化跟踪误差为0.5525%,控制在比较低的水平。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。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	1,214,861,912.59	84.92
	其中:股票	1,214,861,912.59	84.92
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	215,489,867.28	15.06
7	其他资产	316,221.27	0.02
8	合计	1,430,668,001.14	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	3,882,317.29	0.30
B	采矿业	74,017,108.83	5.74
C	制造业	444,224,714.28	34.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,097,953.59	3.19
E	建筑业	36,338,965.04	2.82
F	批发和零售业	30,893,609.41	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	30,764,270.72	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,498,416.48	3.69
J	金融业	411,836,365.98	31.96
K	房地产业	56,814,871.36	4.41
L	租赁和商务服务业	10,681,105.97	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	11,006,498.84	0.85
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	10,842,463.25	0.84
S	综合	4,947,941.55	0.38
	合计	1,214,846,602.59	94.27

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	15,310.00	0.00
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	-	-
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	15,310.00	0.00

5.3 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	600016	民生银行	7,707,515	47,863,668.15	3.71
2	601318	中国平安	1,171,423	46,083,780.82	3.58
3	601166	兴业银行	3,729,471	37,406,594.13	2.90
4	600000	浦发银行	3,148,052	28,489,870.60	2.21
5	600030	中信证券	1,919,737	22,000,186.02	1.71
6	000002	万 科A	2,384,443	19,719,343.61	1.53
7	000001	平安银行	1,942,050	19,245,715.50	1.49
8	600837	海通证券	1,973,464	18,057,195.60	1.40
9	601288	农业银行	6,948,644	17,510,582.88	1.36
10	000651	格力电器	590,485	17,389,783.25	1.35

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	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.00

注:本基金本报告期末仅持有上述积极类股票。

5.4 报告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。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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:本基金本报告期末未持有贵金属。

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:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期末进行股指期货投资,期末未持有股指期货。

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: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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内本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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	186,415.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,998.20
5	应收申购款	113,808.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,221.27

5.11.4 报告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。

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: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。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603328	依顿电子	15,310.00	0.00	新股中签

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

报告期期初基金份额总额	1,332,654,529.61
报告期期间基金总申购份额	190,558,097.45
减:报告期期间基金总赎回份额	57,611,695.11
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	1,465,600,931.95

§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:本基金的基金管理人于本报告期期初及本报告期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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.本基金设立等相关批准文件

2.《长城久泰沪深300 指数证券投资基金基金合同》

3.《长城久泰沪深300 指数证券投资基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

7.中国证监会规定的其他文件

8.2 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

8.3 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

长城久兆中小板300指数分级证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014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
报告送出日期:2014年7月18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。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年07月15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2014年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	19,007,682.44份
投资目标	本基金通过投资约束和数量化监控,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