

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:2015年3月28日

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告内容未虚假记载、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法律责任。
基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2015年03月26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。

长城久泰沪深300指数证券投资基金

2014年度报告摘要

2014年12月31日

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes details like fund name, type, and dates.

2.2 基金产品说明

Table with 2 columns: Item and Value. Includes investment objectives and strategies.

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Item and Value. Lists management and custody details.

2.4 基金业绩说明

本基金为增强型指数基金,自基金合同生效之日起至2011年3月31日以前以恒信标300指数为跟踪标的指数,自2011年4月1日起,本基金跟踪的标的指数变更为沪深300指数。

3 主要财务指标和财务指标

3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 3 columns: Item, 2014, 2013, 2012. Shows financial performance metrics.

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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

注:①由D1-Dn期间区间业绩比较基准收益率由D1-Dn期间每个交易日收盘基金份额的复合计算而来,计算公式如下:
从D1到Dn期间区间业绩比较基准收益率=(1+D1日业绩比较基准收益率)×(1+D2日业绩比较基准收益率)×...×(1+Dn日业绩比较基准收益率)

注: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。

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 基金净值表现

3.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.1 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

Table with 5 columns: Period, A, B, C, D. Compares fund performance with benchmarks.

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,在发生影响估值政策的有效性或有误适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。

4. 报告期内净值变动对基金资产净值变动情况的说明

本报告期内,本基金基金份额净值变动情况如下:
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值为1.3992元,基金份额总额为1,498,398,195.48份。

5 托管人报告

报告期内,本基金托管人严格遵守法律法规,切实履行了托管人职责,保证了基金资产的安全,维护了基金份额持有人的合法权益。

6 审计报告

安永华明会计师事务所为基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 基金投资组合

7.1 资产组合

资产组合:长城久泰沪深300指数证券投资基金
报告截止日期:2014年12月31日

Table with 2 columns: Item and Value. Shows asset breakdown.

7.2 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.3 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.4 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.5 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.6 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.7 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.8 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.9 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.10 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.11 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.12 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.13 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.14 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.15 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.16 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.17 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.18 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.19 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.20 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.21 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.22 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.23 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.24 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.25 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.26 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.27 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.28 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.29 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.30 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.31 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.32 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.33 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.34 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.35 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.36 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.37 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.38 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.39 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

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,在发生影响估值政策的有效性或有误适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。

4. 报告期内净值变动对基金资产净值变动情况的说明

本报告期内,本基金基金份额净值变动情况如下:
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值为1.3992元,基金份额总额为1,498,398,195.48份。

5 托管人报告

报告期内,本基金托管人严格遵守法律法规,切实履行了托管人职责,保证了基金资产的安全,维护了基金份额持有人的合法权益。

6 审计报告

安永华明会计师事务所为基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 基金投资组合

7.1 资产组合

资产组合:长城久泰沪深300指数证券投资基金
报告截止日期:2014年12月31日

Table with 2 columns: Item and Value. Shows asset breakdown.

7.2 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.3 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.4 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.5 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.6 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.7 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.8 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.9 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.10 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.11 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.12 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.13 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.14 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.15 投资组合

本基金投资组合如下:
截至2014年12月31日,本基金投资组合如下:
股票: 115,109,577.99
债券: 87,240,807.41

7.16 投资组合