

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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 2024 年 03 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	20
4.10 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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27

§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 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	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
8.8 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	74
8.9 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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
8.12 投资组合报告附注	74
§ 9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
9.3 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情况	76
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	76
§ 10 开放式基金份额变动	76
§ 11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	78
11.8 其他重大事件	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	80
12.1 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	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	长城久泰沪深 300 指数	
基金主代码	200002	
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	665,246,401.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	200002	006912
报告期末下属分级基金的份额总额	284,368,425.63 份	380,877,975.61 份

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	<p>(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%。</p> <p>(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。</p> <p>(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等。</p>
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 姓名	祝函	张姗

负责人	联系电话	0755-29279006	0755-83077987
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95555
传真		0755-29279000	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518046	518040
法定代表人		王军	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年	
	长城久泰沪 深 300 指数 A	长城久泰沪 深 300 指数 C	长城久泰沪 深 300 指数 A	长城久泰沪 深 300 指数 C	长城久泰沪 深 300 指数 A	长城久泰沪 深 300 指数 C
本期 已 实 现 收	-64,840,342 .43	-55,364,566 .88	-141,634,93 0.91	-116,158,19 7.19	76,526,611. 01	4,202,984.8 4

益						
本期利润	-73,865,044 .68	-73,231,953 .31	-153,726,61 6.55	-145,106,22 5.79	-10,054,895 .73	-23,060,953 .77
加权平均基金份额本期利润	-0.2459	-0.1540	-0.5114	-0.4347	-0.0339	-0.1102
本期加权平均净值利润率	-13.24%	-15.23%	-24.36%	-32.74%	-1.35%	-5.85%
本期基金份额净值增长率	-13.50%	-13.75%	-21.60%	-21.93%	-1.62%	-2.05%
3.1 .2 期末数据	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

和指标						
期末可供分配利润	77,025,491.04	-35,534,560.19	155,556,972.57	27,139,227.71	270,887,081.01	280,143,124.75
期末可供分配基金份额利润	0.2709	-0.0933	0.4946	0.0513	0.9723	0.6502
期末基金资产净值	474,994,808.90	345,343,415.42	607,306,277.55	555,693,393.32	686,163,886.11	711,013,862.44
期末基金份额净值	1.6704	0.9067	1.9310	1.0513	2.4630	1.6502
3.1.3 累计期末	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

指标						
基金份额累计净值增长率	332.16%	16.35%	399.58%	34.91%	537.22%	72.79%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

长城久泰沪深 300 指数 A

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
过去三个月	-8.21%	0.91%	-6.65%	0.75%	-1.56%	0.16%
过去六个月	-8.76%	0.98%	-10.17%	0.81%	1.41%	0.17%
过去一年	-13.50%	0.88%	-10.79%	0.80%	-2.71%	0.08%
过去三年	-33.28%	1.09%	-32.59%	1.06%	-0.69%	0.03%
过去五年	22.89%	1.16%	13.85%	1.15%	9.04%	0.01%
自基金合同生效起至今	332.16%	1.52%	205.42%	1.52%	126.74%	0.00%

长城久泰沪深 300 指数 C

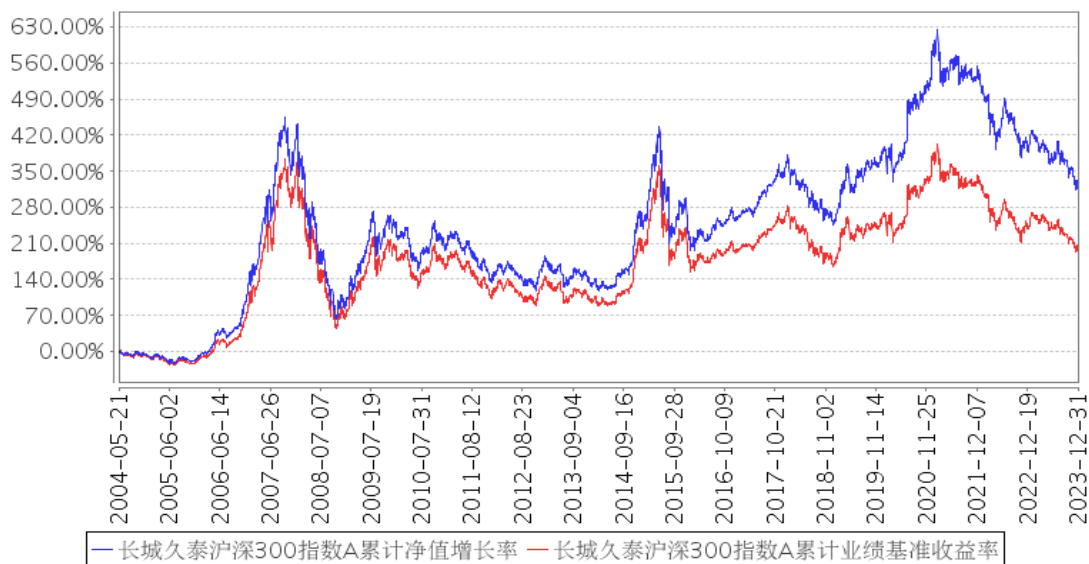
阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-8.28%	0.91%	-6.65%	0.75%	-1.63%	0.16%
过去六个月	-8.89%	0.98%	-10.17%	0.81%	1.28%	0.17%
过去一年	-13.75%	0.88%	-10.79%	0.80%	-2.96%	0.08%
过去三年	-34.05%	1.09%	-32.59%	1.06%	-1.46%	0.03%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	16.35%	1.16%	10.34%	1.15%	6.01%	0.01%

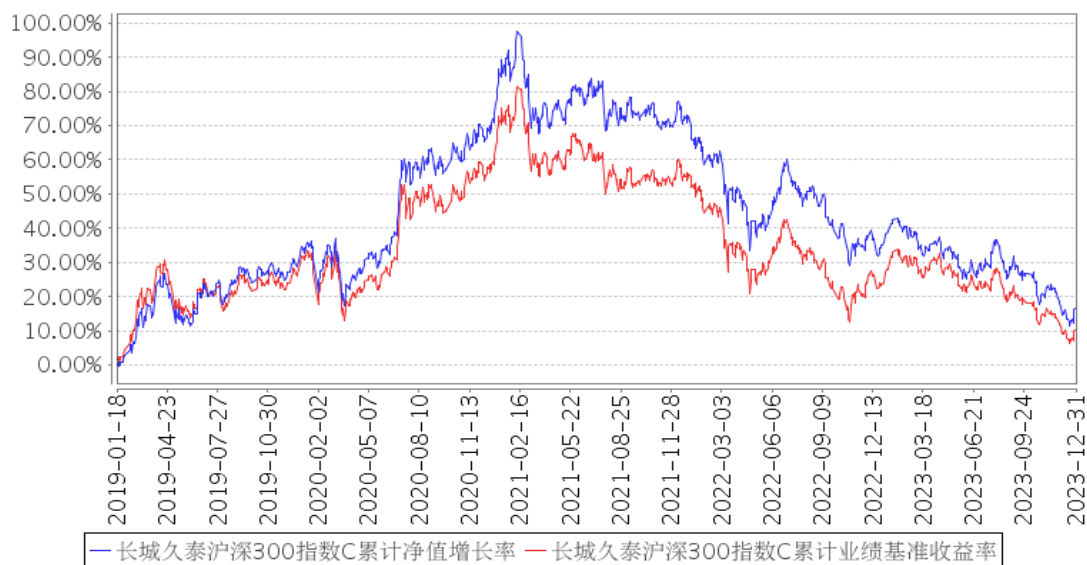
注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

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

长城久泰沪深300指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长城久泰沪深300指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

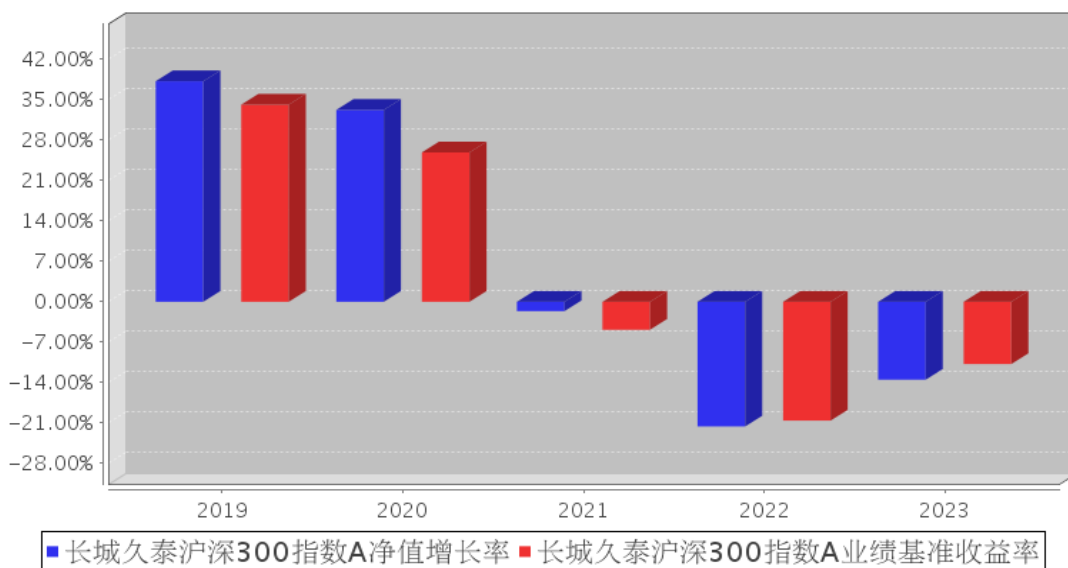


注：①本基金合同规定本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的90%~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

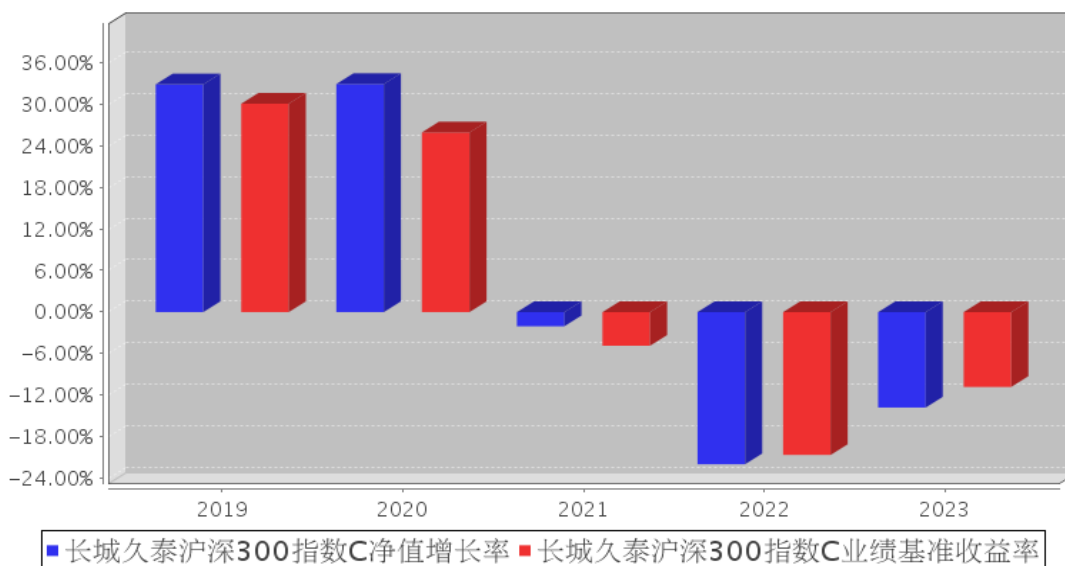
②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城久泰沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城久泰沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	2.3760	80,359,716.24	35,359,592.27	115,719,308.51	-
2021 年	4.6200	104,612,956.53	56,215,708.92	160,828,665.45	-
合计	6.9960	184,972,672.77	91,575,301.19	276,547,973.96	-

§ 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。截至本报告期末，公司管理的基金有：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、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置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、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动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、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益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、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳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、长城悦享增利债券型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长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、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合

型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金 (QDII-LOF)、长城创新成长混合型证券投资基金、长城锦利三个月定期开放债券型证券投资基金、长城裕利纯债债券型发起式证券投资基金、长城景气成长混合型证券投资基金、长城集利债券型发起式证券投资基金、长城国企优选混合型发起式证券投资基金、长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城均衡成长混合型证券投资基金、长城智盈添益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、权益投资一部总经理、本基金的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	23 年	男，中国籍，硕士，注册会计师（CPA）。1991 年 7 月-1996 年 8 月曾就职于大庆石油管理局，1998 年 6 月-1999 年 10 月曾就职于华为技术有限公司，1999 年 10 月-2000 年 5 月曾就职于深圳市和君创业投资公司，2000 年 5 月-2001 年 9 月曾就职于长城证券有限责任公司投资银行部。2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资一部总经理、投委会委员兼基金经理。自 2007 年 9 月至 2009 年 1 月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2011 年 1 月至 2013 年 6 月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自 2009 年 9 月至 2016

				<p>年 9 月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)”基金经理, 自 2017 年 6 月至 2018 年 8 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理, 自 2018 年 8 月至 2018 年 11 月任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”基金经理, 自 2017 年 8 月至 2019 年 2 月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理, 自 2019 年 4 月至 2022 年 10 月任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理, 自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理, 自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理, 自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理, 自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理, 自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航混合型证券投资基金”基金经理, 自 2022 年 4 月至今任“长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金”基金经理, 自 2023 年 2 月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理。</p>	
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理	2018 年 11 月 30 日	-	15 年	<p>男, 中国籍, 硕士。2008 年 7 月-2017 年 11 月曾就职于南方基金管理有限公司, 历任研究员、基金经理。2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司, 现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理兼基金经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理, 自 2022 年 6 月至 2023 年 9 月任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理, 自 2021 年 4 月至 2023 年 7 月兼任专户投资经理。自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理, 自 2019 年 1 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理, 自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理, 自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金</p>

					经理，自 2023 年 12 月至今任“长城智盈添益债券型发起式证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	--

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从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
雷俊	公募基金	-	-	-
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	-	-	-

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 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相关法律法规和公司制度的规定，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，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3 日内、5 日内、7 日内、9 日内、11 日内、13 日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个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。

4.3.3 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

2023 年 A 股市场总体较弱，多数大型宽基指数表现不佳。受预期波动影响，蓝筹指数沪深 300 在年初快速反弹后持续下跌，全年下跌超 10%，弱势下中证 1000 等小市值指数相对较好。风格来看，小微市值、红利、价值、低波动因子表现突出，成长性指数跌幅较大；与之对应的低估值行业表现较好，银行、煤炭、电力等传统行业获得资金持续关注，以人工智能为主要投资标签的 TMT 产业链上下半年波动巨大，难有稳定赚钱效应，消费类行业受经济修复预期影响资金流出。资金面看，外资在年初快速流入后持续流出，全年北向资金流动对市场扰动较大，影响了交易情绪。

报告期内，市场股以存量博弈为主，缺乏持续的增量资金，在少部分缺乏基本面支撑的个股上资金比较聚集，基本面因子动能不够，使得增强指数的超额收益因子较往年变化巨大，估值的波动远远大于业绩波动，虽然个股权重约束较为严格，但区间内相关个股相对劣势明显，因此区间内跑输业绩基准；随着市场信息消化速度提高，行业、风格轮动较快，为更好的捕捉广度投资机会，本基金在 α 因子上全面转向了人工智能研究因子；在风险因子部分，风格上低配了市值因子，考虑到市场总体估值偏低，组合加大了对于 β 因子的暴露。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.6704 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.50%，同期业绩比较基准收益率为-10.79%；

截至本报告期末长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额净值为 0.9067 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.75%，同期业绩比较基准收益率为-10.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场未来的波动主要从估值、盈利、流动性三方面考虑。估值面总体估值仍然处在过去十年中枢以下位置，下行风险预计较小，从大类资产比较的角度，权益市场已经进入价值区间；盈利的角度看，宏观经济复苏偏弱带来的问题已经充分反映在股价上，进一步的利空事件较为有限，当前的政策环境积极正面，预计降息会大幅降低居民与企业的负债成本，但微观层面个股的盈利修复扭转仍然需要一些时间；流动性部分受全球地缘政治博弈和信心影响较大，不排除少数时点存在尾部交易风险，但这部分变量更多来自于对未来预期判断，无法线性外推，辩证来看一旦风险释放也将对市场形成较好的底部支撑。

从上市公司个体角度层面，市场可能会关注盈利稳定性强的个股；更加成熟的市场环境的建立对于各个风险因子风险定价将更为充分，传统因子挖掘超额收益的难度将会继续增大，但深度学习与人工智能等新的复杂算法对于中小市值选股因子仍有较大的潜力空间，有利于在均衡行业配置的基础上在抓住阶段性的价差投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展日常工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持

有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“规范、专业、高效、拼搏”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 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、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015735_H03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动

	情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督长城久泰沪深 300 指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获

	<p>取的审计证据，就可能对导致对长城久泰沪深 300 指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城久泰沪深 300 指数证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	11,538,661.93	37,471,555.02
结算备付金		2,279,347.83	1,260,474.10
存出保证金		236,689.54	263,283.69
交易性金融资产	7.4.7.2	809,278,261.86	1,126,140,781.87
其中：股票投资		775,303,129.39	1,101,565,423.85
基金投资		-	-
债券投资		33,975,132.47	24,575,358.02
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		5,177,927.01	124,371.41
应收股利		-	-
应收申购款		402,963.11	199,492.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		828,913,851.28	1,165,459,958.43
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		6,298,497.57	-
应付赎回款		786,195.81	483,004.27
应付管理人报酬		721,384.51	987,377.17
应付托管费		147,221.34	201,505.55
应付销售服务费		101,525.61	147,470.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	520,802.12	640,929.98
负债合计		8,575,626.96	2,460,287.56
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	665,246,401.24	843,056,718.81
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	155,091,823.08	319,942,952.06
净资产合计		820,338,224.32	1,162,999,670.87
负债和净资产总计		828,913,851.28	1,165,459,958.43

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 665,246,401.24 份，其中长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额总额 284,368,425.63 份，基金份额净值 1.6704 元；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额总额 380,877,975.61 份，基金份额净值 0.9067 元。

7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

一、营业总收入		-133,151,520.03	-284,574,158.78
1. 利息收入		207,203.39	235,568.37
其中：存款利息收入	7.4.7.13	207,203.39	235,568.37
债券利息收入		-	-
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）		-106,581,768.22	-243,832,964.16
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-128,084,909.12	-262,562,439.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	350,394.52	1,169,480.18
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	21,152,746.38	17,559,995.04
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-26,892,088.68	-41,039,714.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	115,133.48	62,951.25
减：二、营业总支出		13,945,477.96	14,258,683.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,218,687.51	10,567,285.74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,085,446.51	2,156,588.96
3. 销售服务费		1,449,107.42	1,341,518.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,906.71	7,852.97
其中：卖出回购金融资产支出		6,906.71	7,852.97
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.41	1.15
8. 其他费用	7.4.7.23	185,329.40	185,436.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-147,096,997.99	-298,832,842.34
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-147,096,997.99	-298,832,842.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-147,096,997.99	-298,832,842.34

7.3 净资产变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	843,056,718.81	-	319,942,952.06	1,162,999,670.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	843,056,718.81	-	319,942,952.06	1,162,999,670.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,810,317.57	-	-164,851,128.98	-342,661,446.55
(一)、综合收益总额	-	-	-147,096,997.99	-147,096,997.99
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-177,810,317.57	-	-17,754,130.99	-195,564,448.56
其中：1. 基金申购款	199,953,990.19	-	8,897,086.52	208,851,076.71
2. 基金赎回款	-377,764,307.76	-	-26,651,217.51	-404,415,525.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	665,246,401.24	-	155,091,823.08	820,338,224.32
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	709,464,394.68	-	687,713,353.87	1,397,177,748.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	709,464,394.68	-	687,713,353.87	1,397,177,748.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	133,592,324.13	-	-367,770,401.81	-234,178,077.68
（一）、综合收益总额	-	-	-298,832,842.34	-298,832,842.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	133,592,324.13	-	46,781,749.04	180,374,073.17
其中：1. 基金申购款	650,385,890.64	-	226,657,632.61	877,043,523.25
2. 基金赎回款	-516,793,566.51	-	-179,875,883.57	-696,669,450.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-115,719,308.51	-115,719,308.51

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	843,056,718.81	-	319,942,952.06	1,162,999,670.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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”）。

根据 2019 年 1 月 18 日《关于长城久泰沪深 300 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金自 2019 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类份额。同时，本基金管理人将对《基金合同》进行相应修改。本基金根据申购、赎回、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。长城久泰沪深 300 指数 A 类和长城久泰沪深 300 指数 C 类的基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值。投资者可自行选择申购基金份额类别。

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。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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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。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。

7.4.2 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集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 2 号《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〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特

征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内的每份基金单位享有同等分配权；

(2) 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(3) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(4) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

(5) 在符合有关分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益可以不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(6) 投资者可以选择现金分红方式或红利再投资方式，默认方式为现金分红方式，投资者分

红方式的变更须在分红权益登记日前向销售机构提出申请；

(7) 红利分配时所发生的银行转帐或其它注册登记费用由投资者自行承担。基金管理人若收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书中规定；

(8) 法律法规以及中国证监会的其它规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税及附加

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）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，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

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。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	11,538,661.93	37,471,555.02
等于：本金	11,537,240.07	37,467,592.27
加：应计利息	1,421.86	3,962.75
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	11,538,661.93	37,471,555.02

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	841,503,194.04	-	775,303,129.39	-66,200,064.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	33,708,070.00	234,362.47	33,975,132.47	32,700.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	33,708,070.00	234,362.47	33,975,132.47	32,700.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	875,211,264.04	234,362.47	809,278,261.86	-66,167,364.65	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,140,816,480.82	-	1,101,565,423.85	-39,251,056.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	24,220,979.00	378,598.02	24,575,358.02	-24,219.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,220,979.00	378,598.02	24,575,358.02	-24,219.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,165,037,459.82	378,598.02	1,126,140,781.87	-39,275,275.97	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,356.84	460.07
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	459,445.28	460,469.91
其中：交易所市场	459,445.28	460,469.91
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费用	-	120,000.00
合计	520,802.12	640,929.98

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	314,502,553.20	314,502,553.20
本期申购	16,805,257.87	16,805,257.87
本期赎回（以“-”号填列）	-46,939,385.44	-46,939,385.44
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	284,368,425.63	284,368,425.63

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	528,554,165.61	528,554,165.61
本期申购	183,148,732.32	183,148,732.32
本期赎回（以“-”号填列）	-330,824,922.32	-330,824,922.32
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	380,877,975.61	380,877,975.61

注：本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	155,556,972.57	137,246,751.78	292,803,724.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	155,556,972.57	137,246,751.78	292,803,724.35
本期利润	-64,840,342.43	-9,024,702.25	-73,865,044.68
本期基金份额交易产生的变动数	-13,691,139.10	-14,621,157.30	-28,312,296.40
其中：基金申购款	7,385,705.48	7,077,007.56	14,462,713.04
基金赎回款	-21,076,844.58	-21,698,164.86	-42,775,009.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,025,491.04	113,600,892.23	190,626,383.27

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,818,664.74	-56,679,437.03	27,139,227.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	83,818,664.74	-56,679,437.03	27,139,227.71
本期利润	-55,364,566.88	-17,867,386.43	-73,231,953.31
本期基金份额交易产生的变动数	-15,505,394.31	26,063,559.72	10,558,165.41
其中：基金申购款	17,690,538.10	-23,256,164.62	-5,565,626.52
基金赎回款	-33,195,932.41	49,319,724.34	16,123,791.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,948,703.55	-48,483,263.74	-35,534,560.19

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	154,979.08	181,457.15
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	48,652.41	49,257.20
其他	3,571.90	4,854.02
合计	207,203.39	235,568.37

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-128,084,909.12	-262,562,439.38
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-128,084,909.12	-262,562,439.38

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,710,358,300.56	4,218,803,648.21
减：卖出股票成本总额	4,831,616,620.57	4,474,452,533.08
减：交易费用	6,826,589.11	6,913,554.51
买卖股票差价收入	-128,084,909.12	-262,562,439.38

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	270,843.18	215,079.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	79,551.34	954,401.13

券到期兑付) 差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	350,394.52	1,169,480.18

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,259,243.71	6,302,947.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	27,647,169.00	5,347,500.00
减：应计利息总额	532,502.28	1,002.92
减：交易费用	21.09	43.26
买卖债券差价收入	79,551.34	954,401.13

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	21,152,746.38	17,559,995.04
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	21,152,746.38	17,559,995.04

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-26,892,088.68	-41,039,714.24
股票投资	-26,949,007.68	-40,948,576.64
债券投资	56,919.00	-91,137.60
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-

其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-26,892,088.68	-41,039,714.24

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	115,133.48	62,951.25
合计	115,133.48	62,951.25

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	5,329.40	5,436.14
合计	185,329.40	185,436.14

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	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（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构

长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司(“东方证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
北方国际信托股份有限公司(“北方国际”)	基金管理人的股东
中原信托有限公司(“中原信托”)	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司(“长城嘉信”)	基金管理人的控股子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
长城证券	9,234,906,860.74	100.00	8,503,926,341.24	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
长城证券	37,227,623.71	100.00	30,523,926.31	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
长城证券	91,850,000.00	100.00	72,340,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	2,179,022.77	100.00	459,445.28	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,966,964.33	100.00	460,469.91	100.00

注：(1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	10,218,687.51
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,966,732.89	1,693,264.41
应支付基金管理人的净管理费	8,251,954.62	8,874,021.33

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.98%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	2,085,446.51

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{托管费率} \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	850,282.83	850,282.83
招商银行	-	22,754.46	22,754.46
合计	-	873,037.29	873,037.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	1,192,748.80	1,192,748.80
招商银行	-	980.14	980.14
合计	-	1,193,728.94	1,193,728.94

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3%年费率计提。计算公式如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	11,538,661.93	154,979.08	37,471,555.02	181,457.15

注：本基金的活期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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301421	波长	2023年8月	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-

	光电	16 日									
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁定	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-	
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-	
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁定	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-	
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁定	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	

	机									
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股锁定	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股锁定	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋	2023年12月6日	6个月	新股锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

	白									
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

7.4.12.2 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
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年01月10日	9.33	130	1,377.66	1,102.40	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，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人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存

款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息

资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	11,538,661.93	-	-	-	-	-	11,538,661.93
结算备付金	2,279,347.83	-	-	-	-	-	2,279,347.83
存出保证金	236,689.54	-	-	-	-	-	236,689.54
交易性金融资产	5,097,645.21	-	28,877,487.26	-	-	775,303,129.39	809,278,261.86
应收申购款	-	-	-	-	-	402,963.11	402,963.11
应收清算款	-	-	-	-	-	5,177,927.01	5,177,927.01
资产总计	19,152,344.51	-	28,877,487.26	-	-	780,884,019.51	828,913,851.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	786,195.81	786,195.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	721,384.51	721,384.51
应付托管费	-	-	-	-	-	147,221.34	147,221.34
应付清算款	-	-	-	-	-	6,298,497.57	6,298,497.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	101,525.61	101,525.61
其他负债	-	-	-	-	-	520,802.12	520,802.12
负债总计	-	-	-	-	-	8,575,626.96	8,575,626.96
利率敏感度缺口	19,152,344.51	-	28,877,487.26	-	-	-	-
上年度末 2022年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	37,471,555.02	-	-	-	-	-	37,471,555.02
结算备付金	1,260,474.10	-	-	-	-	-	1,260,474.10
存出保证金	263,283.69	-	-	-	-	-	263,283.69
交易性金融资产	8,162,476.71	-	16,412,881.31	-	-	1,101,565,423.85	1,126,140,781.87
应收申购款	-	-	-	-	-	199,492.34	199,492.34
应收清算款	-	-	-	-	-	124,371.41	124,371.41
资产总计	47,157,789.52	-	16,412,881.31	-	-	1,101,889,287.60	1,165,459,958.43

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	483,004.27	483,004.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	987,377.17	987,377.17
应付托管费	-	-	-	-	-	201,505.55	201,505.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	147,470.59	147,470.59
其他负债	-	-	-	-	-	640,929.98	640,929.98
负债总计	-	-	-	-	-	2,460,287.56	2,460,287.56
利率敏感度缺口	47,157,789.52	-16,412,881.31	-	-	-		

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	56,107.26	13,778.67
	市场利率上升 25 个基点	-55,891.77	-13,758.02

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	775,303,129.39	94.51	1,101,565,423.85	94.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	33,975,132.47	4.14	24,575,358.02	2.11
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	809,278,261.86	98.65	1,126,140,781.87	96.83

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		41,564,000.77
沪深 300 指数下降 5%		-41,564,000.77	-55,012,177.27

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	774,808,573.28	1,101,365,354.49
第二层次	33,976,234.87	24,575,358.02
第三层次	493,453.71	200,069.36
合计	809,278,261.86	1,126,140,781.87

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	200,069.36	200,069.36
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00

转入第三层次	-	433,217.07	433,217.07
转出第三层次	-	404,795.72	404,795.72
当期利得或损失总额	-	264,963.00	264,963.00
其中：计入损益的利得或损失	-	264,963.00	264,963.00
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	493,453.71	493,453.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	115,442.48	115,442.48
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,178,309.87	1,178,309.87
转出第三层次	-	2,723,519.68	2,723,519.68
当期利得或损失总额	-	1,745,279.17	1,745,279.17
其中：计入损益的利得或损失	-	1,745,279.17	1,745,279.17
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	200,069.36	200,069.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-89,928.12	-89,928.12

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	493,453.71	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		

	允价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	200,069.36	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~0.5680	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	775,303,129.39	93.53
	其中：股票	775,303,129.39	93.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,975,132.47	4.10
	其中：债券	33,975,132.47	4.10
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,818,009.76	1.67
8	其他各项资产	5,817,579.66	0.70
9	合计	828,913,851.28	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	8,973.00	-
B	采矿业	14,944,631.00	1.82
C	制造业	408,547,951.10	49.80
D	电力、热力、燃气	5,701,055.70	0.69

	及水生产和供应业		
E	建筑业	6,663.70	-
F	批发和零售业	8,140.76	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,816,818.23	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,751,883.05	1.55
J	金融业	146,186,772.95	17.82
K	房地产业	5,624.02	-
L	租赁和商务服务业	9,617,535.52	1.17
M	科学研究和技术服务业	19,032,694.75	2.32
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	4,967.48	-
R	文化、体育和娱乐业	1,764.00	-
S	综合	-	-
	合计	627,635,475.26	76.51

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	5,989,539.21	0.73
C	制造业	89,834,594.95	10.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,324,206.27	0.16
E	建筑业	7,803,715.80	0.95
F	批发和零售业	4,572,642.24	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	18,326.12	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,370,808.14	1.51
J	金融业	2,148,205.25	0.26
K	房地产业	2,565,002.84	0.31
L	租赁和商务服务	2,600,338.00	0.32

	业		
M	科学研究和技术服务业	8,363,273.24	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	3,971,114.12	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,261.95	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,103,626.00	0.74
	合计	147,667,654.13	18.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	34,922	60,275,372.00	7.35
2	600030	中信证券	1,004,508	20,461,827.96	2.49
3	603259	药明康德	250,475	18,224,561.00	2.22
4	002142	宁波银行	758,100	15,245,391.00	1.86
5	002709	天赐材料	599,900	15,045,492.00	1.83
6	300122	智飞生物	244,931	14,967,733.41	1.82
7	000338	潍柴动力	1,078,500	14,721,525.00	1.79
8	300750	宁德时代	90,120	14,712,991.20	1.79
9	002129	TCL 中环	937,562	14,663,469.68	1.79
10	601138	工业富联	966,794	14,617,925.28	1.78
11	601939	建设银行	2,129,661	13,864,093.11	1.69
12	002920	德赛西威	103,800	13,443,138.00	1.64
13	601881	中国银河	1,081,133	13,027,652.65	1.59
14	600132	重庆啤酒	194,900	12,951,105.00	1.58
15	300999	金龙鱼	387,700	12,941,426.00	1.58
16	601838	成都银行	1,140,434	12,841,286.84	1.57
17	002410	广联达	741,475	12,708,881.50	1.55
18	002821	凯莱英	109,266	12,685,782.60	1.55
19	603290	斯达半导	69,300	12,543,300.00	1.53
20	002415	海康威视	358,604	12,450,730.88	1.52
21	002180	纳思达	544,224	12,315,789.12	1.50
22	002938	鹏鼎控股	532,700	11,889,864.00	1.45

23	600036	招商银行	426,142	11,855,270.44	1.45
24	600809	山西汾酒	49,460	11,411,905.80	1.39
25	603799	华友钴业	336,454	11,079,430.22	1.35
26	000661	长春高新	75,910	11,067,678.00	1.35
27	601688	华泰证券	783,953	10,936,144.35	1.33
28	601318	中国平安	270,693	10,908,927.90	1.33
29	688599	天合光能	364,710	10,405,176.30	1.27
30	000408	藏格矿业	403,100	10,214,554.00	1.25
31	603486	科沃斯	237,700	9,850,288.00	1.20
32	300450	先导智能	377,900	9,674,240.00	1.18
33	601888	中国中免	114,904	9,616,315.76	1.17
34	000063	中兴通讯	341,000	9,029,680.00	1.10
35	601328	交通银行	1,570,313	9,013,596.62	1.10
36	601225	陕西煤业	416,399	8,698,575.11	1.06
37	603659	璞泰来	415,300	8,692,229.00	1.06
38	002916	深南电路	121,500	8,625,285.00	1.05
39	601211	国泰君安	525,907	7,825,496.16	0.95
40	002466	天齐锂业	128,485	7,168,178.15	0.87
41	000001	平安银行	740,300	6,951,417.00	0.85
42	600019	宝钢股份	1,136,365	6,738,644.45	0.82
43	601288	农业银行	1,780,231	6,480,040.84	0.79
44	601898	中煤能源	618,302	5,991,346.38	0.73
45	601006	大秦铁路	774,095	5,581,224.95	0.68
46	002352	顺丰控股	129,100	5,215,640.00	0.64
47	002459	晶澳科技	239,197	4,956,161.84	0.60
48	601633	长城汽车	195,800	4,938,076.00	0.60
49	600900	长江电力	191,969	4,480,556.46	0.55
50	000858	五粮液	30,374	4,261,775.94	0.52
51	002841	视源股份	87,606	4,008,850.56	0.49
52	601398	工商银行	714,200	3,413,876.00	0.42
53	300957	贝泰妮	44,850	3,057,424.50	0.37
54	601012	隆基绿能	125,506	2,874,087.40	0.35
55	300896	爱美客	9,300	2,737,269.00	0.33
56	000977	浪潮信息	78,596	2,609,387.20	0.32
57	601615	明阳智能	172,032	2,157,281.28	0.26
58	300014	亿纬锂能	50,900	2,147,980.00	0.26
59	600919	江苏银行	318,661	2,131,842.09	0.26
60	000786	北新建材	86,380	2,017,836.80	0.25
61	600732	爱旭股份	103,800	1,831,032.00	0.22
62	002460	赣锋锂业	38,280	1,638,384.00	0.20
63	000568	泸州老窖	8,307	1,490,441.94	0.18
64	002601	龙佰集团	81,800	1,401,234.00	0.17
65	601985	中国核电	161,000	1,207,500.00	0.15

66	601901	方正证券	145,920	1,176,115.20	0.14
67	300759	康龙化成	27,774	804,890.52	0.10
68	603288	海天味业	16,640	631,488.00	0.08
69	000333	美的集团	8,621	470,965.23	0.06
70	300661	圣邦股份	3,116	277,355.16	0.03
71	002475	立讯精密	7,700	265,265.00	0.03
72	601088	中国神华	7,300	228,855.00	0.03
73	000938	紫光股份	7,074	136,881.90	0.02
74	300760	迈瑞医疗	268	77,880.80	0.01
75	600436	片仔癀	150	36,298.50	0.00
76	600941	中国移动	200	19,896.00	0.00
77	002594	比亚迪	100	19,800.00	0.00
78	605499	东鹏饮料	100	18,251.00	0.00
79	688036	传音控股	129	17,853.60	0.00
80	300033	同花顺	100	15,687.00	0.00
81	601799	星宇股份	100	13,111.00	0.00
82	600760	中航沈飞	308	12,991.44	0.00
83	600085	同仁堂	236	12,673.20	0.00
84	002049	紫光国微	180	12,141.00	0.00
85	600309	万华化学	143	10,985.26	0.00
86	600745	闻泰科技	240	10,154.40	0.00
87	300124	汇川技术	140	8,839.60	0.00
88	002714	牧原股份	214	8,812.52	0.00
89	603833	欧派家居	121	8,422.81	0.00
90	000596	古井贡酒	36	8,380.80	0.00
91	688012	中微公司	54	8,294.40	0.00
92	600188	兖矿能源	400	7,924.00	0.00
93	600276	恒瑞医药	166	7,508.18	0.00
94	600600	青岛啤酒	100	7,475.00	0.00
95	688396	华润微	155	6,926.95	0.00
96	605117	德业股份	80	6,712.00	0.00
97	000963	华东医药	156	6,467.76	0.00
98	601021	春秋航空	127	6,375.40	0.00
99	300751	迈为股份	46	5,957.46	0.00
100	600150	中国船舶	200	5,888.00	0.00
101	002648	卫星化学	399	5,885.25	0.00
102	002050	三花智控	200	5,880.00	0.00
103	000625	长安汽车	348	5,856.84	0.00
104	600009	上海机场	174	5,703.72	0.00
105	600570	恒生电子	192	5,521.92	0.00
106	600660	福耀玻璃	143	5,346.77	0.00
107	688363	华熙生物	78	5,220.54	0.00
108	601336	新华保险	165	5,136.45	0.00

109	600674	川投能源	336	5,080.32	0.00
110	603392	万泰生物	67	5,033.71	0.00
111	000999	华润三九	100	4,973.00	0.00
112	300015	爱尔眼科	314	4,967.48	0.00
113	000538	云南白药	100	4,915.00	0.00
114	600886	国投电力	360	4,744.80	0.00
115	600893	航发动力	126	4,709.88	0.00
116	002230	科大讯飞	100	4,638.00	0.00
117	688065	凯赛生物	80	4,398.40	0.00
118	600690	海尔智家	199	4,179.00	0.00
119	600547	山东黄金	176	4,025.12	0.00
120	600406	国电南瑞	175	3,906.00	0.00
121	601689	拓普集团	53	3,895.50	0.00
122	601877	正泰电器	171	3,678.21	0.00
123	600887	伊利股份	136	3,638.00	0.00
124	300347	泰格医药	59	3,243.23	0.00
125	601628	中国人寿	114	3,231.90	0.00
126	000651	格力电器	100	3,217.00	0.00
127	601601	中国太保	134	3,186.52	0.00
128	603260	合盛硅业	62	3,162.00	0.00
129	601808	中海油服	200	2,924.00	0.00
130	600111	北方稀土	148	2,862.32	0.00
131	600332	白云山	100	2,860.00	0.00
132	300059	东方财富	195	2,737.80	0.00
133	000895	双汇发展	100	2,671.00	0.00
134	600031	三一重工	191	2,630.07	0.00
135	600196	复星医药	100	2,503.00	0.00
136	601857	中国石油	344	2,428.64	0.00
137	002252	上海莱士	300	2,400.00	0.00
138	601699	潞安环能	109	2,388.19	0.00
139	600741	华域汽车	146	2,376.88	0.00
140	601166	兴业银行	146	2,366.66	0.00
141	002603	以岭药业	100	2,307.00	0.00
142	601919	中远海控	240	2,299.20	0.00
143	600585	海螺水泥	100	2,256.00	0.00
144	000768	中航西飞	100	2,237.00	0.00
145	002007	华兰生物	100	2,213.00	0.00
146	603806	福斯特	90	2,184.30	0.00
147	601872	招商轮船	367	2,157.96	0.00
148	002074	国轩高科	100	2,150.00	0.00
149	600015	华夏银行	379	2,129.98	0.00
150	002241	歌尔股份	100	2,101.00	0.00
151	600588	用友网络	117	2,081.43	0.00

152	002236	大华股份	106	1,955.70	0.00
153	000002	万科 A	181	1,893.26	0.00
154	002555	三七互娱	100	1,881.00	0.00
155	600845	宝信软件	38	1,854.40	0.00
156	600028	中国石化	330	1,841.40	0.00
157	601878	浙商证券	175	1,825.25	0.00
158	601899	紫金矿业	146	1,819.16	0.00
159	600362	江西铜业	100	1,786.00	0.00
160	300413	芒果超媒	70	1,764.00	0.00
161	603369	今世缘	36	1,755.00	0.00
162	601100	恒立液压	32	1,749.76	0.00
163	600999	招商证券	124	1,691.36	0.00
164	601607	上海医药	100	1,673.00	0.00
165	002304	洋河股份	15	1,648.50	0.00
166	000776	广发证券	112	1,600.48	0.00
167	000792	盐湖股份	100	1,595.00	0.00
168	601788	光大证券	100	1,542.00	0.00
169	600011	华能国际	200	1,540.00	0.00
170	600089	特变电工	100	1,380.00	0.00
171	600958	东方证券	156	1,357.20	0.00
172	601009	南京银行	181	1,335.78	0.00
173	002001	新和成	78	1,322.88	0.00
174	600372	中航机载	100	1,318.00	0.00
175	688111	金山办公	4	1,264.80	0.00
176	000708	中信特钢	90	1,263.60	0.00
177	600048	保利发展	127	1,257.30	0.00
178	600233	圆通速递	100	1,229.00	0.00
179	600926	杭州银行	122	1,221.22	0.00
180	002027	分众传媒	193	1,219.76	0.00
181	601155	新城控股	106	1,209.46	0.00
182	600795	国电电力	282	1,173.12	0.00
183	601186	中国铁建	151	1,149.11	0.00
184	601728	中国电信	200	1,082.00	0.00
185	603501	韦尔股份	10	1,067.10	0.00
186	002202	金风科技	129	1,032.00	0.00
187	300628	亿联网络	34	1,004.70	0.00
188	600489	中金黄金	100	996.00	0.00
189	601169	北京银行	219	992.07	0.00
190	601390	中国中铁	174	988.32	0.00
191	000983	山西焦煤	100	988.00	0.00
192	601117	中国化学	152	966.72	0.00
193	002271	东方雨虹	50	960.00	0.00
194	001979	招商蛇口	100	953.00	0.00

195	600837	海通证券	100	937.00	0.00
196	000876	新希望	100	932.00	0.00
197	600176	中国巨石	92	904.36	0.00
198	600050	中国联通	200	876.00	0.00
199	600000	浦发银行	132	873.84	0.00
200	002736	国信证券	100	854.00	0.00
201	601800	中国交建	111	843.60	0.00
202	601668	中国建筑	175	841.75	0.00
203	601669	中国电建	162	792.18	0.00
204	601600	中国铝业	140	789.60	0.00
205	000301	东方盛虹	82	787.20	0.00
206	601111	中国国航	100	734.00	0.00
207	600183	生益科技	40	732.40	0.00
208	600346	恒力石化	54	711.18	0.00
209	600061	国投资本	104	700.96	0.00
210	601377	兴业证券	119	698.53	0.00
211	600016	民生银行	185	691.90	0.00
212	000425	徐工机械	126	687.96	0.00
213	000157	中联重科	100	653.00	0.00
214	000725	京东方 A	164	639.60	0.00
215	601988	中国银行	158	630.42	0.00
216	601238	广汽集团	69	603.75	0.00
217	601229	上海银行	100	597.00	0.00
218	600219	南山铝业	196	576.24	0.00
219	600029	南方航空	100	576.00	0.00
220	000100	TCL 科技	130	559.00	0.00
221	601998	中信银行	105	555.45	0.00
222	600426	华鲁恒升	20	551.80	0.00
223	300433	蓝思科技	41	541.20	0.00
224	601766	中国中车	100	526.00	0.00
225	603993	洛阳钼业	100	520.00	0.00
226	002493	荣盛石化	50	517.50	0.00
227	600018	上港集团	100	490.00	0.00
228	600023	浙能电力	100	461.00	0.00
229	600606	绿地控股	199	457.70	0.00
230	000166	申万宏源	100	444.00	0.00
231	601989	中国重工	100	413.00	0.00
232	601319	中国人保	83	401.72	0.00
233	600115	中国东航	100	388.00	0.00
234	601818	光大银行	127	368.30	0.00
235	600104	上汽集团	24	324.72	0.00
236	601618	中国中冶	102	312.12	0.00
237	000069	华侨城 A	100	311.00	0.00

238	600039	四川路桥	40	299.60	0.00
239	300498	温氏股份	8	160.48	0.00
240	600010	包钢股份	100	146.00	0.00
241	600584	长电科技	4	119.44	0.00
242	601868	中国能建	6	12.60	0.00

8.3.2 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所有股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600987	航民股份	1,052,962	9,223,947.12	1.12
2	002384	东山精密	466,700	8,484,606.00	1.03
3	688696	极米科技	57,999	6,552,727.02	0.80
4	603185	弘元绿能	194,504	6,473,093.12	0.79
5	600629	华建集团	1,241,000	6,403,560.00	0.78
6	002268	电科网安	281,900	6,331,474.00	0.77
7	000541	佛山照明	949,310	6,312,911.50	0.77
8	000887	中鼎股份	500,500	6,191,185.00	0.75
9	600846	同济科技	657,400	6,113,820.00	0.75
10	000009	中国宝安	519,900	6,103,626.00	0.74
11	002929	润建股份	143,500	5,988,255.00	0.73
12	600867	通化东宝	484,500	5,247,135.00	0.64
13	000937	冀中能源	684,200	4,885,188.00	0.60
14	688002	睿创微纳	106,143	4,693,643.46	0.57
15	000823	超声电子	489,000	4,679,730.00	0.57
16	000062	深圳华强	405,200	4,566,604.00	0.56
17	600839	四川长虹	767,800	4,061,662.00	0.50
18	000035	中国天楹	803,600	3,969,784.00	0.48
19	600388	龙净环保	306,600	3,921,414.00	0.48
20	300101	振芯科技	166,700	3,805,761.00	0.46
21	603686	福龙马	348,200	3,562,086.00	0.43
22	688276	百克生物	61,116	3,349,767.96	0.41
23	000589	贵州轮胎	480,600	2,941,272.00	0.36
24	000039	中集集团	364,700	2,789,955.00	0.34
25	002484	江海股份	172,500	2,770,350.00	0.34
26	002889	东方嘉盛	100,800	2,590,560.00	0.32
27	600383	金地集团	588,200	2,564,552.00	0.31
28	300088	长信科技	352,913	2,360,987.97	0.29
29	601077	渝农商行	526,300	2,147,304.00	0.26
30	300384	三联虹普	121,200	1,934,352.00	0.24
31	000090	天健集团	367,223	1,689,225.80	0.21
32	603053	成都燃气	129,300	1,324,032.00	0.16
33	600339	中油工程	233,000	705,990.00	0.09
34	300776	帝尔激光	11,000	662,860.00	0.08
35	002064	华峰化学	47,400	318,054.00	0.04

36	002392	北京利尔	79,800	301,644.00	0.04
37	600985	淮北矿业	17,000	282,710.00	0.03
38	688139	海尔生物	6,037	244,619.24	0.03
39	688569	铁科轨道	7,012	193,601.32	0.02
40	000799	酒鬼酒	1,800	131,670.00	0.02
41	002128	电投能源	8,000	114,160.00	0.01
42	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.01
43	301526	C 国际复材	9,723	43,267.35	0.01
44	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
45	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
46	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
47	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
48	688188	柏楚电子	61	15,439.71	0.00
49	688200	华峰测控	121	14,858.80	0.00
50	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
51	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
52	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
53	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
54	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
55	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
56	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
57	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
58	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
59	688686	奥普特	91	10,192.00	0.00
60	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
61	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
62	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
63	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
64	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
65	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
66	600129	太极集团	200	9,292.00	0.00
67	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
68	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
69	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
70	603605	珀莱雅	84	8,349.60	0.00
71	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
72	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
73	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
74	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
75	688536	思瑞浦	52	7,607.60	0.00
76	603688	石英股份	87	7,558.56	0.00
77	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
78	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00

79	688005	容百科技	175	6,965.00	0.00
80	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
81	688122	西部超导	125	6,653.75	0.00
82	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
83	605168	三人行	100	6,336.00	0.00
84	603004	C 鼎龙	195	6,082.05	0.00
85	300726	宏达电子	200	6,038.00	0.00
86	000028	国药一致	200	5,798.00	0.00
87	688202	美迪西	84	5,743.92	0.00
88	603345	安井食品	52	5,439.72	0.00
89	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
90	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
91	603613	国联股份	236	5,194.36	0.00
92	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
93	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
94	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
95	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
96	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
97	300769	德方纳米	60	3,661.80	0.00
98	603212	赛伍技术	200	3,474.00	0.00
99	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
100	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
101	300418	昆仑万维	90	3,366.00	0.00
102	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
103	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
104	688185	康希诺	41	3,055.32	0.00
105	300294	博雅生物	82	2,761.76	0.00
106	688099	晶晨股份	43	2,693.09	0.00
107	300244	迪安诊断	95	2,261.95	0.00
108	603489	八方股份	40	2,198.00	0.00
109	603236	移远通信	40	2,150.00	0.00
110	688707	振华新材	98	2,009.00	0.00
111	300438	鹏辉能源	69	1,952.01	0.00
112	688116	天奈科技	66	1,916.64	0.00
113	002294	信立泰	56	1,828.96	0.00
114	002756	永兴材料	30	1,566.30	0.00
115	688819	天能股份	55	1,535.60	0.00
116	002120	韵达股份	200	1,492.00	0.00
117	600884	杉杉股份	100	1,362.00	0.00
118	603733	仙鹤股份	79	1,275.06	0.00
119	601869	长飞光纤	45	1,235.70	0.00
120	000657	中钨高新	130	1,102.40	0.00
121	600368	五洲交通	275	1,086.25	0.00

122	603868	飞科电器	20	1,010.00	0.00
123	601231	环旭电子	62	936.82	0.00
124	688057	金达莱	66	934.56	0.00
125	002080	中材科技	58	923.36	0.00
126	300601	康泰生物	34	923.10	0.00
127	002372	伟星新材	58	839.26	0.00
128	300529	健帆生物	37	822.51	0.00
129	601958	金钼股份	83	784.35	0.00
130	300806	斯迪克	55	773.85	0.00
131	600035	楚天高速	200	764.00	0.00
132	300638	广和通	40	761.20	0.00
133	300390	天华新能	30	760.50	0.00
134	600256	广汇能源	99	706.86	0.00
135	688777	中控技术	15	680.25	0.00
136	000807	云铝股份	54	659.88	0.00
137	000828	东莞控股	49	526.26	0.00
138	300873	海晨股份	20	476.20	0.00
139	002414	高德红外	60	438.00	0.00
140	601200	上海环境	44	395.56	0.00
141	603300	华铁应急	60	384.00	0.00
142	600284	浦东建设	60	378.00	0.00
143	600908	无锡银行	73	368.65	0.00
144	300003	乐普医疗	20	323.20	0.00
145	002966	苏州银行	50	323.00	0.00
146	002061	浙江交科	80	292.00	0.00
147	601222	林洋能源	45	287.55	0.00
148	000718	苏宁环球	96	248.64	0.00
149	603939	益丰药房	6	240.24	0.00
150	600933	爱柯迪	10	219.40	0.00
151	600639	浦东金桥	20	202.20	0.00
152	002461	珠江啤酒	25	197.50	0.00
153	600251	冠农股份	20	173.80	0.00
154	600901	江苏金租	35	169.40	0.00
155	600236	桂冠电力	30	166.20	0.00
156	605366	宏柏新材	20	165.40	0.00
157	605399	晨光新材	10	135.60	0.00
158	000528	柳工	16	107.84	0.00
159	002444	巨星科技	4	90.08	0.00
160	600277	亿利洁能	30	78.90	0.00
161	603228	景旺电子	2	45.12	0.00
162	002936	郑州银行	20	40.20	0.00
163	603043	广州酒家	2	39.06	0.00
164	300207	欣旺达	2	29.52	0.00

165	601216	君正集团	6	22.44	0.00
166	688009	中国通号	4	17.52	0.00
167	600008	首创环保	3	8.07	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	69,433,579.68	5.97
2	601899	紫金矿业	54,803,839.49	4.71
3	600030	中信证券	47,481,358.23	4.08
4	603259	药明康德	46,095,403.00	3.96
5	601138	工业富联	44,498,302.92	3.83
6	300015	爱尔眼科	44,277,749.00	3.81
7	688120	华海清科	41,371,535.20	3.56
8	601012	隆基绿能	40,798,671.46	3.51
9	600036	招商银行	38,900,541.40	3.34
10	600519	贵州茅台	37,895,018.00	3.26
11	002142	宁波银行	37,839,687.50	3.25
12	601336	新华保险	36,159,601.05	3.11
13	603799	华友钴业	35,894,232.00	3.09
14	601600	中国铝业	34,713,738.00	2.98
15	600031	三一重工	34,597,828.00	2.97
16	600893	航发动力	34,025,565.00	2.93
17	601689	拓普集团	33,835,897.46	2.91
18	002271	东方雨虹	32,710,254.00	2.81
19	000568	泸州老窖	32,660,472.66	2.81
20	300122	智飞生物	32,504,027.84	2.79
21	002475	立讯精密	32,392,033.00	2.79
22	002129	TCL 中环	31,886,585.75	2.74
23	300059	东方财富	31,267,799.44	2.69
24	000333	美的集团	29,334,966.00	2.52
25	002410	广联达	29,117,543.40	2.50
26	300308	中际旭创	28,824,902.00	2.48
27	300207	欣旺达	28,586,836.78	2.46
28	600900	长江电力	28,572,121.50	2.46
29	002459	晶澳科技	27,732,568.38	2.38
30	000858	五粮液	27,140,838.28	2.33
31	688012	中微公司	26,302,436.95	2.26
32	603589	口子窖	25,672,600.00	2.21
33	601888	中国中免	25,568,430.32	2.20
34	300088	长信科技	25,328,495.94	2.18
35	600760	中航沈飞	24,586,223.08	2.11

36	600028	中国石化	24,485,933.00	2.11
37	601225	陕西煤业	24,166,169.00	2.08
38	000932	华菱钢铁	23,796,975.00	2.05
39	603369	今世缘	23,774,501.00	2.04

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。

8.4.2 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	601318	中国平安	81,241,298.00	6.99
2	600519	贵州茅台	63,410,780.00	5.45
3	601899	紫金矿业	57,902,225.00	4.98
4	603369	今世缘	48,017,340.00	4.13
5	300750	宁德时代	47,896,201.51	4.12
6	002594	比亚迪	47,353,944.00	4.07
7	300760	迈瑞医疗	47,226,806.00	4.06
8	002049	紫光国微	41,917,506.60	3.60
9	300015	爱尔眼科	40,872,935.00	3.51
10	688120	华海清科	38,719,660.48	3.33
11	601601	中国太保	38,666,107.36	3.32
12	601336	新华保险	37,334,919.14	3.21
13	000858	五粮液	35,422,895.00	3.05
14	601628	中国人寿	35,051,031.00	3.01
15	600845	宝信软件	34,275,161.55	2.95
16	600893	航发动力	33,048,262.00	2.84
17	601600	中国铝业	32,096,318.00	2.76
18	601689	拓普集团	32,076,780.00	2.76
19	300059	东方财富	31,909,633.48	2.74
20	000963	华东医药	31,569,781.00	2.71
21	002271	东方雨虹	31,169,231.00	2.68
22	300308	中际旭创	30,847,178.00	2.65
23	688012	中微公司	30,846,119.47	2.65
24	000568	泸州老窖	30,770,659.82	2.65
25	600015	华夏银行	30,737,271.00	2.64
26	600036	招商银行	30,674,173.00	2.64
27	600031	三一重工	30,291,067.00	2.60
28	002475	立讯精密	29,303,422.00	2.52
29	600030	中信证券	28,908,264.85	2.49
30	600176	中国巨石	28,877,862.69	2.48
31	601012	隆基绿能	28,284,776.00	2.43
32	601319	中国人保	27,637,792.00	2.38
33	600256	广汇能源	27,543,940.00	2.37
34	603259	药明康德	27,392,766.23	2.36

35	000333	美的集团	26,932,492.00	2.32
36	601138	工业富联	26,763,246.00	2.30
37	601857	中国石油	25,432,205.00	2.19
38	600028	中国石化	25,391,956.40	2.18
39	300207	欣旺达	25,110,937.00	2.16
40	600900	长江电力	25,010,294.00	2.15
41	603613	国联股份	24,838,124.85	2.14
42	600089	特变电工	24,667,142.73	2.12
43	603799	华友钴业	24,648,380.80	2.12
44	603589	口子窖	24,056,222.00	2.07
45	600760	中航沈飞	23,949,771.80	2.06
46	002821	凯莱英	23,543,891.60	2.02

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。

8.4.3 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	4,532,303,333.79
卖出股票收入（成交）总额	4,710,358,300.56

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	33,975,132.47	4.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,975,132.47	4.14

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019727	23 国债 24	237,000	23,851,322.88	2.91
2	019694	23 国债 01	50,000	5,097,645.21	0.62
3	019709	23 国债 16	50,000	5,026,164.38	0.61
4	-	-	-	-	-

5	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 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：无。

8.9 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：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期本基金投资的前十名证券除中信证券和宁波银行发行主体外，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。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

中信证券股份有限公司（简称中信证券）因未按规定履行客户身份识别义务等案由，于 2023 年 2 月 6 日被中国人民银行处以罚款。

根据宁波银保监局公布的行政处罚信息公开表：

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因违规开展异地互联网贷款业务等案由，于 2023 年 1 月 9 日被宁波银保监局处以罚款。 根据国家金融监督管理总局宁波监管局公布的行政处罚信息公开表：

根据宁波银保监局公布的行政处罚信息公开表：

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因监管标准化数据与 1104 数据交叉核验不一致及消费者个人信息管理不到位等案由，于 2023 年 11 月 27 日被国家金融监督管理总局宁波监管局处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的

规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.12.3 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	236,689.54
2	应收清算款	5,177,927.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	402,963.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,817,579.66

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
长城久泰 沪深 300	20,691	13,743.58	69,564,191.68	24.46	214,804,233.95	75.54

指数 A						
长城久泰 沪深 300 指数 C	2,988	127,469.20	367,334,336.97	96.44	13,543,638.64	3.56
合计	23,679	28,094.36	436,898,528.65	65.67	228,347,872.59	34.33

注：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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长城久泰沪深 300 指数 A	298,748.81	0.1051
	长城久泰沪深 300 指数 C	53,021.79	0.0139
	合计	351,770.60	0.0529

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

9.3 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	长城久泰沪深 300 指数 A	10~50
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城久泰沪深 300 指数 A	0~10
	长城久泰沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10

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。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
----	-----------------	-----------------

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	314,502,553.20	528,554,165.61
本报告期基金总申购份额	16,805,257.87	183,148,732.32
减:本报告期基金总赎回份额	46,939,385.44	330,824,922.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	284,368,425.63	380,877,975.61

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2023 年 2 月 6 日起,张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起,何小乐女士担任公司副总经理。

自 2023 年 9 月 15 日起,车君女士担任公司副总经理,不再担任公司督察长。

自 2023 年 9 月 15 日起,祝函先生担任公司督察长。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币陆万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),

为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
长城证券	2	9,234,906,860.74	100.00	2,179,022.77	100.00	-
第一创业	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 17 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，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，能满足基金运作的合法、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。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
长城证 券	37,227,623. 71	100.00	91,850,000.0 0	100.00	-	-
第一创 业	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

中信证 券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
3	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 10 日
4	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
5	长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 4 日
6	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 16 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 7 日
8	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20230303-20231231	164,264,534.23	-	-	164,264,534.23	24.69

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

本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，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的及投资策略；

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城久泰沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- (二) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
- (四) 《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 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：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日