

长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54

7.7 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	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长城中证 500 指数增强	
基金主代码	006048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 13 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 210, 572, 900. 37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006048	007413
报告期末下属分级基金的份额总额	180, 862, 595. 16 份	1, 029, 710, 305. 21 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。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以中证 500 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	祝函
	联系电话	0755-29279006
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn
客户服务电话	400-8868-666	021-60637228
传真	0755-29279000	021-60635778
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区	北京市西城区金融大街 25 号

	鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518046	100033
法定代表人	王军	张金良

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-34,900,797.01	-297,308,658.51
本期利润	-22,695,620.72	-286,862,039.90
加权平均基金份 额本期利润	-0.1132	-0.1518
本期加权平均净 值利润率	-7.99%	-13.14%
本期基金份额净 值增长率	-7.83%	-7.97%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	18,211,779.62	52,301,552.23
期末可供分配基	0.1007	0.0508

金份额利润		
期末基金资产净值	250,044,429.35	1,164,232,281.32
期末基金份额净值	1.3825	1.1306
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	38.56%	43.83%

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

长城中证 500 指数增强 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
过去一个月	-4.17%	0.78%	-6.55%	0.91%	2.38%	-0.13%
过去三个月	-2.09%	0.94%	-6.16%	1.09%	4.07%	-0.15%
过去六个月	-7.83%	1.51%	-8.46%	1.53%	0.63%	-0.02%
过去一年	-10.19%	1.19%	-16.71%	1.21%	6.52%	-0.02%
过去三年	-18.00%	1.15%	-26.01%	1.14%	8.01%	0.01%
自基金合同生效起至今	38.56%	1.28%	-0.95%	1.27%	39.51%	0.01%

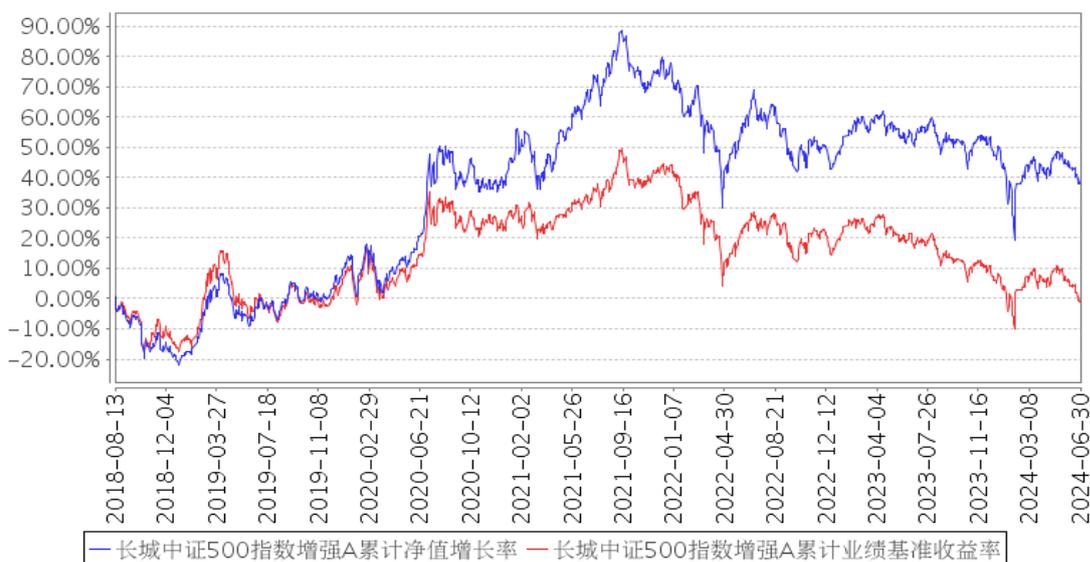
长城中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.19%	0.78%	-6.55%	0.91%	2.36%	-0.13%
过去三个月	-2.16%	0.94%	-6.16%	1.09%	4.00%	-0.15%

过去六个月	-7.97%	1.51%	-8.46%	1.53%	0.49%	-0.02%
过去一年	-10.48%	1.19%	-16.71%	1.21%	6.23%	-0.02%
过去三年	-18.73%	1.15%	-26.01%	1.14%	7.28%	0.01%
自基金合同生效起至今	43.83%	1.24%	0.48%	1.21%	43.35%	0.03%

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

长城中证500指数增强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



长城中证500指数增强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基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除

股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

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。

§ 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（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更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%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 106 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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		
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	-	16 年	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

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 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年权益市场波动较大，债券市场相对表现更好。A 股主要指数有所分化，沪深 300 上涨，中证 500、中证 1000、创业板等小盘成长性指数下跌；风格方面，市场广度效应消失，基于确定性逻辑的“缩圈”行情下，微小市值个股流动性风险凸显，微观交易上出现了不同于过去三年的统计规律甚至是三倍标准差之外的现象，这些尾部风险极大影响了市场参与者的交易结构和交易行为，这对部分交易性数据产生因子为主的量化策略带来了较大负面贡献。风格上看，红利与价值类因子较为抗跌；二季度相比一季度随着个股波动逐渐降低，市场从尾部风险交易回归到常态化的市场参与结构，交易性数据产生的因子有效性逐渐回归。

报告期内，本基金主要通过深度学习等神经网络方法广泛挖掘市场有效因子，并充分利用人工智能等算法进行多因子组合，严格控制行业与风格的相对偏离风险；基于市场对于中小股票的认知变化，模型在股票池的基础构建中优化了价值性的筛选因子，量化算法在因子挖掘中利用了不同风险下数据的学习提高因子稳健性；受市场交易结构影响，人工智能算法因子超额收益在一季度下行后二季度快速上行，产品在区间内小幅战胜业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城中证 500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.3825 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.83%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；截至本报告期末长城中证 500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1306 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.97%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年以来，由于经济修复长期不达预期，股票市场显著承压，叠加从年初开始，参与者结构显著波动情况，量化因子的表现明显偏弱；随着近期三中全会的成功召开，提纲挈领的规划了未来深化改革的方向和蓝图，预计下半年货币、财政等相关经济政策会逐步出台，用以应对当前的经济下行压力。

从各行业与指数估值来看，大多数都处于过去 5 年的底部区域，已经较大程度的反映了对于未来经济悲观的预期，大盘指数进一步下跌的空间不大；另一方面，从微观层面看下半年的市场交易结构预计会回归到常态化运行机制，量化多因子的表现有望回归到正常水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能的相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,967,577.39	136,490,637.29
结算备付金		13,273,085.04	30,451,447.07
存出保证金		3,121,527.12	2,076,593.26
交易性金融资产	6.4.7.2	1,397,763,285.98	3,701,632,910.51
其中：股票投资		1,322,774,856.29	3,633,435,364.21
基金投资		-	-
债券投资		74,988,429.69	68,197,546.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	85,800,876.29
应收股利		-	-
应收申购款		552,919.25	27,572,190.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,418,678,394.78	3,984,024,655.13
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	10,000,000.00
应付清算款		275,214.49	46,720,092.46
应付赎回款		1,034,517.34	27,694,053.21
应付管理人报酬		1,199,677.15	3,572,067.84
应付托管费		179,951.55	535,810.20
应付销售服务费		296,616.41	1,001,081.12
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	6.4.7.9	1,415,707.17	1,972,849.11
负债合计		4,401,684.11	91,495,953.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,179,166,701.12	3,088,471,613.93
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	235,110,009.55	804,057,087.26
净资产合计		1,414,276,710.67	3,892,528,701.19
负债和净资产总计		1,418,678,394.78	3,984,024,655.13

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,210,572,900.37 份，其中长城中证 500 指数增强 A 基金份额总额 180,862,595.16 份，基金份额净值 1.3825 元；长城中证 500 指数增强 C 基金份额总额 1,029,710,305.21 份，基金份额净值 1.1306 元。

6.2 利润表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-291,866,822.12	23,943,721.10
1. 利息收入		204,539.85	32,669.30
其中：存款利息收入	6.4.7.13	201,087.79	32,669.30
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		3,452.06	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-314,947,107.61	25,064,679.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-336,339,704.11	19,114,030.86

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	975,556.02	119,811.59
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-4,202,053.76	-
股利收益	6.4.7.19	24,619,094.24	5,830,836.96
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）	6.4.7.20	22,651,794.90	-1,200,905.98
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	223,950.74	47,278.37
减：二、营业总支出		17,690,838.50	2,354,586.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,323,346.78	1,736,523.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,848,501.97	260,478.56
3. 销售服务费		3,273,397.46	175,723.57
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,360.55	2,002.03
其中：卖出回购金融资产 支出		12,360.55	2,002.03
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.20
8. 其他费用	6.4.7.23	233,231.74	179,858.16
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-309,557,660.62	21,589,135.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-309,557,660.62	21,589,135.04
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-309,557,660.62	21,589,135.04

6.3 净资产变动表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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	3,088,471,613.93	-	804,057,087.26	3,892,528,701.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,088,471,613.93	-	804,057,087.26	3,892,528,701.19
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,909,304,912.81	-	-568,947,077.71	-2,478,251,990.52
(一)、综合收益总额	-	-	-309,557,660.62	-309,557,660.62
(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)	-1,909,304,912.81	-	-259,389,417.09	-2,168,694,329.90
其中：1. 基金申购款	309,716,533.83	-	70,145,011.50	379,861,545.33
2. 基金赎回款	-2,219,021,446.64	-	-329,534,428.59	-2,548,555,875.23
(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	1,179,166,701.12	-	235,110,009.55	1,414,276,710.67
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	195,051,294.65	-	122,668,765.57	317,720,060.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	195,051,294.65	-	122,668,765.57	317,720,060.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	52,317,487.56	-	48,269,135.64	100,586,623.20
(一)、综合收益总额	-	-	21,589,135.04	21,589,135.04
(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)	52,317,487.56	-	26,680,000.60	78,997,488.16
其中：1. 基金申购款	95,616,841.31	-	55,633,391.08	151,250,232.39
2. 基金赎回款	-43,299,353.75	-	-28,953,390.48	-72,252,744.23
(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	247,368,782.21	-	170,937,901.21	418,306,683.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是根据中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”及原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“久兆中小板基金”）基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，由原久兆中小板基金转型而来。原久兆中小板基金为契约型开放式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限不定，首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。根据深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》，自 2018 年 8 月 6 日起，久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。根据久兆中小板基金基金份额持有人大会的授权，管理人自 2018 年 8 月 6 日至 2018 年 8 月 13 日对久兆中小板基金实施转型与基金份额转换。基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成，久兆中小板基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市后，基金管理人于 2018 年 8 月 6 日（份额转换起始日）将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换为久兆 300 份额的场内份额；于 2018 年 8 月 13 日（份额转换基准日）将久兆 300 份额的场内份额、久兆 300 份额的场外份额转换为份额净值为 1.0000 元的本基金基金份额。基金份额转换后，本基金份额数保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金财产。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2019 年 5 月 9 日发布的《关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金于 2019 年 5 月 9 日起增加 C 类基金份额类别，原份额转为 A 类基金份额。根据申购费用、赎回费用、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。其中在投资人申购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基金份额类别，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基金份额类别，称为 C 类基金份额。增加基金份额类别后，A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。A 类基金份额基金代码为 006048，C

类基金份额基金代码为 007413。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,967,577.39
等于：本金	3,966,595.22
加：应计利息	982.17
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	3,967,577.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,375,417,121.90	-	1,322,774,856.29	-52,642,265.61	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	73,669,376.38	1,152,072.49	74,988,429.69	166,980.82
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	73,669,376.38	1,152,072.49	74,988,429.69	166,980.82
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,449,086,498.28	1,152,072.49	1,397,763,285.98	-52,475,284.79	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	17,700,160.00	-	-	-
其中：股指期货投资	17,700,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,700,160.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	18.00	17,703,360.00	3,200.00
合计				3,200.00
减：可抵销期货暂收款				3,200.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,121,351.20
其中：交易所市场	1,121,351.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	34,809.32
预提信息披露费	59,672.34
应付指数使用费	199,848.18
合计	1,415,707.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	203,129,361.30	167,856,298.45
本期申购	44,348,698.30	36,647,566.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-66,615,464.44	-55,047,469.41
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	180,862,595.16	149,456,395.91

长城中证 500 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,920,615,315.48	2,920,615,315.48
本期申购	273,068,966.96	273,068,966.96
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,163,973,977.23	-2,163,973,977.23
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	1,029,710,305.21	1,029,710,305.21

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	55,712,989.20	81,096,027.93	136,809,017.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	55,712,989.20	81,096,027.93	136,809,017.13
本期利润	-34,900,797.01	12,205,176.29	-22,695,620.72
本期基金份额交易产生的变动数	-2,600,412.57	-10,924,950.40	-13,525,362.97
其中：基金申购款	8,010,231.56	18,599,064.10	26,609,295.66
基金赎回款	-10,610,644.13	-29,524,014.50	-40,134,658.63
本期已分配利润	-	-	-

本期末	18,211,779.62	82,376,253.82	100,588,033.44
-----	---------------	---------------	----------------

长城中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	568,407,731.39	98,840,338.74	667,248,070.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	568,407,731.39	98,840,338.74	667,248,070.13
本期利润	-297,308,658.51	10,446,618.61	-286,862,039.90
本期基金份额交易产生的变动数	-218,797,520.65	-27,066,533.47	-245,864,054.12
其中：基金申购款	38,497,940.88	5,037,774.96	43,535,715.84
基金赎回款	-257,295,461.53	-32,104,308.43	-289,399,769.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,301,552.23	82,220,423.88	134,521,976.11

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	126,704.87
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	64,479.66
其他	9,903.26
合计	201,087.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-336,339,704.11
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	-336,339,704.11

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	6,364,238,135.68

减：卖出股票成本总额	6,694,070,908.44
减：交易费用	6,506,931.35
买卖股票差价收入	-336,339,704.11

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	950,369.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,186.49
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	975,556.02

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,742,186.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	43,154,890.51
减：应计利息总额	562,109.33
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	25,186.49

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-4,202,053.76

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	24,619,094.24
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	24,619,094.24

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	22,919,922.56
股票投资	22,827,789.85

债券投资	92,132.71
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-268,127.66
权证投资	-
期货投资	-268,127.66
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	0.00
合计	22,651,794.90

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	223,950.74
合计	223,950.74

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	138,021.50
银行费用	728.58
合计	233,231.74

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	4,054,077,762.67	37.80	1,407,516,442.05	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	35,360,247.00	44.83	13,746,249.30	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	144,000,000.00	86.75	33,100,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	996,921.88	37.80	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	325,556.41	100.00	193,166.26	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,323,346.78	1,736,523.54
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,218,954.89	480,597.03
应支付基金管理人的净管理费	11,104,391.89	1,255,926.51

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

提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,848,501.97	260,478.56

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	2,514,503.11	2,514,503.11
长城证券	-	1,726.42	1,726.42
合计	-	2,516,229.53	2,516,229.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	106,427.87	106,427.87
长城证券	-	963.21	963.21
合计	-	107,391.08	107,391.08

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

额的销售服务费年费率为 0.3%。销售服务费计算公式如下：

$$H = E \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用自有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

长城中证 500 指数增强 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
长城嘉信 资产管理 有限公司	2,843,621.13	0.2349	2,843,621.13	0.0910

6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,967,577.39	126,704.87	8,105,640.71	21,479.63

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 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

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1个月	新股锁定-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股锁定	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301591	肯特股	2024年2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-

603285	键邦股份	2024年6月28日	1-6个月(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 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 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2024年6 月30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	3,967,577.39	-	-	-	-	-	3,967,577.39
结算备付金	13,273,085.04	-	-	-	-	-	13,273,085.04
存出保证金	3,121,527.12	-	-	-	-	-	3,121,527.12
交易性金融资产	10,156,150.69	-64,775,990.14	-	-56,288.86	1,322,774,856.29	-	1,397,763,285.98
应收申购款	-	-	-	-	-	552,919.25	552,919.25
资产总计	30,518,340.24	-64,775,990.14	-	-56,288.86	1,323,327,775.54	-	1,418,678,394.78
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,034,517.34	1,034,517.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,199,677.15	1,199,677.15

应付托管费						179,951.55	179,951.55
应付清算款						275,214.49	275,214.49
应付销售服务费						296,616.41	296,616.41
其他负债						1,415,707.17	1,415,707.17
负债总计						4,401,684.11	4,401,684.11
利率敏感度缺口	30,518,340.24		-64,775,990.14		-56,288.86		
上年度末 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	136,490,637.29						136,490,637.29
结算备付金	30,451,447.07						30,451,447.07
存出保证金	2,076,593.26						2,076,593.26
交易性金融资产	13,763,642.05		-54,433,904.25			-3,633,435,364.21	13,701,632,910.51
应收申购款						27,572,190.71	27,572,190.71
应收清算款						85,800,876.29	85,800,876.29
资产总计	182,782,319.67		-54,433,904.25			-3,746,808,431.21	13,984,024,655.13
负债							
应付赎回款						27,694,053.21	27,694,053.21
应付管理人报酬						3,572,067.84	3,572,067.84
应付托管费						535,810.20	535,810.20
应付清						46,720,092.46	46,720,092.46

算款							
卖出回 购金融 资产款	10,000,000.00	-	-	-	-	-	10,000,000.00
应付销 售服务 费	-	-	-	-	-	1,001,081.12	1,001,081.12
其他负 债	-	-	-	-	-	1,972,849.11	1,972,849.11
负债总 计	10,000,000.00	-	-	-	-	81,495,953.94	91,495,953.94
利率敏 感度缺 口	172,782,319.67	-54,433,904.25	-	-	-		

6.4.13.4.1.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个 基点	54,465.83	105,959.44
	市场利率上升 25 个 基点	-54,379.88	-105,555.25

6.4.13.4.2 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。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。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：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	1,322,774,856.29	93.53	3,633,435,364.21	93.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	74,988,429.69	5.30	68,197,546.30	1.75
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	1,397,763,285.98	98.83	3,701,632,910.51	95.10

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

6.4.13.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		86,039,890.53
沪深 300 指数下降		-86,039,890.53	-147,263,135.31

	5%		
--	----	--	--

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,322,688,007.30	3,633,003,677.55
第二层次	74,977,751.94	68,197,546.30
第三层次	97,526.74	431,686.66
合计	1,397,763,285.98	3,701,632,910.51

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,322,774,856.29	93.24
	其中：股票	1,322,774,856.29	93.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	74,988,429.69	5.29
	其中：债券	74,988,429.69	5.29
	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	17,240,662.43	1.22
8	其他各项资产	3,674,446.37	0.26
9	合计	1,418,678,394.78	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	11,094,347.00	0.78
B	采矿业	101,069,113.52	7.15
C	制造业	676,287,603.08	47.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,790,016.34	3.66
E	建筑业	21,857,219.20	1.55
F	批发和零售业	15,781,701.60	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	32,467,630.30	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,873,884.91	4.37
J	金融业	116,369,028.26	8.23
K	房地产业	9,254,061.02	0.65
L	租赁和商务服务业	2,066,542.77	0.15

M	科学研究和技术服务业	955.44	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,127,663.30	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	38.25	-
Q	卫生和社会工作	380.66	-
R	文化、体育和娱乐业	21,928,083.68	1.55
S	综合	668.80	-
	合计	1,123,968,938.13	79.47

7.2.2 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	4,150,204.00	0.29
C	制造业	151,373,500.15	10.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,633,319.80	0.82
E	建筑业	3,281,992.00	0.23
F	批发和零售业	7,505,091.32	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	6,414,024.02	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,916.05	0.01
J	金融业	12,557,591.00	0.89
K	房地产业	1,643,020.76	0.12
L	租赁和商务服务业	461.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	165,900.66	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	720.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	177.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	198,805,918.16	14.06

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 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

7.3.1 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	601058	赛轮轮胎	1,247,010	17,458,140.00	1.23
2	600096	云天化	895,100	17,382,842.00	1.23
3	601077	渝农商行	3,115,200	15,638,304.00	1.11
4	601168	西部矿业	861,700	15,467,515.00	1.09
5	002487	大金重工	648,499	14,837,657.12	1.05
6	002625	光启技术	840,012	14,574,208.20	1.03
7	002850	科达利	188,920	14,429,709.60	1.02
8	601128	常熟银行	1,855,823	14,048,580.11	0.99
9	002138	顺络电子	511,000	14,032,060.00	0.99
10	002532	天山铝业	1,721,400	13,960,554.00	0.99
11	002128	电投能源	657,300	13,869,030.00	0.98
12	000738	航发控制	680,400	13,655,628.00	0.97
13	603160	汇顶科技	191,900	13,193,125.00	0.93
14	002078	太阳纸业	937,200	13,073,940.00	0.92
15	300699	光威复材	516,200	12,817,246.00	0.91
16	688099	晶晨股份	213,364	12,656,752.48	0.89
17	600348	华阳股份	1,267,850	12,627,786.00	0.89
18	603786	科博达	196,500	12,605,475.00	0.89
19	601717	郑煤机	850,900	12,593,320.00	0.89
20	000683	远兴能源	1,818,400	12,565,144.00	0.89
21	603979	金诚信	246,854	12,473,532.62	0.88
22	601990	南京证券	1,622,800	12,463,104.00	0.88
23	000728	国元证券	2,020,169	12,242,224.14	0.87
24	002008	大族激光	583,600	12,138,880.00	0.86
25	600021	上海电力	1,223,520	12,100,612.80	0.86
26	600521	华海药业	709,500	12,096,975.00	0.86
27	300866	安克创新	169,817	12,092,668.57	0.86
28	002595	豪迈科技	316,600	12,084,622.00	0.85
29	600820	XD 隧道股	1,843,100	12,035,443.00	0.85
30	601231	环旭电子	748,300	12,010,215.00	0.85
31	300207	欣旺达	787,414	11,945,070.38	0.84
32	600582	天地科技	1,720,919	11,857,131.91	0.84
33	600177	雅戈尔	1,661,380	11,829,025.60	0.84
34	601156	东航物流	579,300	11,788,755.00	0.83
35	000830	鲁西化工	1,010,400	11,710,536.00	0.83
36	000598	兴蓉环境	1,555,930	11,700,593.60	0.83

37	002195	岩山科技	4,610,290	11,571,827.90	0.82
38	600143	金发科技	1,722,900	11,388,369.00	0.81
39	300724	捷佳伟创	210,400	11,363,704.00	0.80
40	601216	君正集团	3,057,300	11,281,437.00	0.80
41	600580	卧龙电驱	927,100	11,264,265.00	0.80
42	300383	光环新网	1,328,400	11,224,980.00	0.79
43	000513	丽珠集团	301,400	11,215,094.00	0.79
44	603156	养元饮品	525,700	11,181,639.00	0.79
45	000887	中鼎股份	904,205	11,067,469.20	0.78
46	600566	济川药业	348,128	11,039,138.88	0.78
47	600549	厦门钨业	636,300	10,976,175.00	0.78
48	000027	深圳能源	1,489,492	10,873,291.60	0.77
49	600901	江苏金租	2,150,840	10,861,742.00	0.77
50	600329	达仁堂	334,483	10,833,904.37	0.77
51	600968	海油发展	2,623,100	10,807,172.00	0.76
52	002268	电科网安	757,535	10,779,723.05	0.76
53	601098	中南传媒	867,000	10,768,140.00	0.76
54	600598	北大荒	855,800	10,688,942.00	0.76
55	600517	国网英大	2,462,900	10,664,357.00	0.75
56	000921	海信家电	327,200	10,548,928.00	0.75
57	002372	伟星新材	682,400	10,522,608.00	0.74
58	600377	宁沪高速	830,700	10,466,820.00	0.74
59	601019	山东出版	883,300	10,440,606.00	0.74
60	600909	华安证券	2,467,610	10,388,638.10	0.73
61	600704	物产中大	2,366,000	10,268,440.00	0.73
62	600967	内蒙一机	1,421,668	10,236,009.60	0.72
63	600350	山东高速	1,153,878	10,211,820.30	0.72
64	605358	立昂微	433,364	10,028,042.96	0.71
65	002563	森马服饰	1,715,700	9,968,217.00	0.70
66	000563	陕国投 A	3,612,300	9,933,825.00	0.70
67	600170	上海建工	4,568,268	9,821,776.20	0.69
68	603529	爱玛科技	358,500	9,797,805.00	0.69
69	002653	海思科	319,100	9,796,370.00	0.69
70	600380	健康元	869,900	9,716,783.00	0.69
71	002152	广电运通	926,100	9,687,006.00	0.68
72	600988	赤峰黄金	591,800	9,670,012.00	0.68
73	000937	冀中能源	1,417,465	9,497,015.50	0.67
74	600848	上海临港	1,015,600	9,252,116.00	0.65
75	001203	大中矿业	935,200	8,987,272.00	0.64
76	300088	长信科技	1,889,808	8,882,097.60	0.63
77	600959	江苏有线	3,327,010	8,783,306.40	0.62
78	600535	天士力	684,800	8,614,784.00	0.61
79	688425	铁建重工	2,300,669	8,466,461.92	0.60

80	000878	云南铜业	674,400	8,403,024.00	0.59
81	002028	思源电气	122,400	8,188,560.00	0.58
82	300296	利亚德	1,728,795	7,779,577.50	0.55
83	300529	健帆生物	276,300	7,518,123.00	0.53
84	300502	新易盛	70,200	7,409,610.00	0.52
85	002831	裕同科技	287,983	7,369,484.97	0.52
86	600486	扬农化工	128,700	7,265,115.00	0.51
87	600879	航天电子	923,300	7,174,041.00	0.51
88	000958	电投产融	1,957,200	7,163,352.00	0.51
89	000933	神火股份	317,710	6,427,273.30	0.45
90	600637	东方明珠	1,003,671	6,102,319.68	0.43
91	600398	海澜之家	658,800	6,087,312.00	0.43
92	603606	东方电缆	121,400	5,925,534.00	0.42
93	002064	华峰化学	812,556	5,826,026.52	0.41
94	600008	首创环保	1,957,100	5,245,028.00	0.37
95	000988	华工科技	169,614	5,076,547.02	0.36
96	601198	东兴证券	626,600	4,987,736.00	0.35
97	600859	王府井	398,500	4,678,390.00	0.33
98	600765	中航重机	213,300	4,351,320.00	0.31
99	603228	景旺电子	136,648	4,345,406.40	0.31
100	601608	中信重工	1,139,550	4,341,685.50	0.31
101	002506	协鑫集成	2,212,400	4,292,056.00	0.30
102	601577	长沙银行	495,600	4,054,008.00	0.29
103	002155	湖南黄金	223,800	4,050,780.00	0.29
104	002797	第一创业	767,867	3,908,443.03	0.28
105	603728	鸣志电器	91,400	3,677,022.00	0.26
106	600157	永泰能源	3,115,613	3,676,423.34	0.26
107	603589	口子窖	87,500	3,429,125.00	0.24
108	600873	梅花生物	300,050	3,006,501.00	0.21
109	601665	齐鲁银行	604,200	2,966,622.00	0.21
110	300803	指南针	76,200	2,774,442.00	0.20
111	600529	山东药玻	90,300	2,288,202.00	0.16
112	600885	宏发股份	78,800	2,181,184.00	0.15
113	603568	伟明环保	103,385	2,127,663.30	0.15
114	002683	广东宏大	104,700	2,107,611.00	0.15
115	000709	河钢股份	1,024,700	1,987,918.00	0.14
116	603688	石英股份	60,700	1,797,327.00	0.13
117	603737	三棵树	49,079	1,780,095.33	0.13
118	601233	桐昆股份	108,800	1,736,448.00	0.12
119	002223	鱼跃医疗	45,100	1,695,760.00	0.12
120	300058	蓝色光标	283,000	1,539,520.00	0.11
121	600516	方大炭素	353,500	1,523,585.00	0.11
122	600497	驰宏锌锗	283,000	1,511,220.00	0.11

123	002273	水晶光电	85,100	1,444,998.00	0.10
124	300595	欧普康视	90,600	1,420,608.00	0.10
125	000050	深天马 A	165,200	1,202,656.00	0.09
126	000739	普洛药业	74,500	1,010,965.00	0.07
127	000009	中国宝安	106,280	914,008.00	0.06
128	601991	大唐发电	283,700	853,937.00	0.06
129	603883	老百姓	45,410	833,727.60	0.06
130	301029	怡合达	41,200	809,992.00	0.06
131	002185	华天科技	95,200	775,880.00	0.05
132	688188	柏楚电子	4,047	746,873.85	0.05
133	601928	凤凰传媒	65,633	719,337.68	0.05
134	603317	天味食品	60,700	692,587.00	0.05
135	600737	中粮糖业	69,110	662,764.90	0.05
136	300073	当升科技	17,200	590,132.00	0.04
137	600862	中航高科	28,700	538,986.00	0.04
138	601997	贵阳银行	99,100	522,257.00	0.04
139	600755	厦门国贸	59,181	424,327.77	0.03
140	601118	海南橡胶	89,100	405,405.00	0.03
141	000967	盈峰环境	76,500	323,595.00	0.02
142	688819	天能股份	11,763	280,665.18	0.02
143	000959	首钢股份	90,000	244,800.00	0.02
144	300118	东方日升	16,108	194,906.80	0.01
145	600995	南网储能	18,300	176,778.00	0.01
146	000703	恒逸石化	20,676	146,592.84	0.01
147	002738	中矿资源	5,020	134,536.00	0.01
148	600153	建发股份	11,500	102,695.00	0.01
149	300394	天孚通信	800	70,736.00	0.01
150	688281	华秦科技	88	7,332.16	0.00
151	688200	华峰测控	66	6,055.50	0.00
152	603444	吉比特	24	4,272.24	0.00
153	688536	思瑞浦	39	3,814.59	0.00
154	300776	帝尔激光	75	3,447.00	0.00
155	688005	容百科技	82	1,908.96	0.00
156	600895	张江高科	97	1,792.56	0.00
157	300357	我武生物	82	1,658.04	0.00
158	603379	三美股份	40	1,565.60	0.00
159	002557	洽洽食品	55	1,550.45	0.00
160	603456	九洲药业	97	1,330.84	0.00
161	002690	美亚光电	73	1,204.50	0.00
162	688002	睿创微纳	43	1,202.71	0.00
163	603233	大参林	80	1,144.00	0.00
164	003022	联泓新科	83	1,137.93	0.00
165	300748	金力永磁	80	1,036.80	0.00

166	603127	昭衍新药	72	955.44	0.00
167	002384	东山精密	39	807.30	0.00
168	002240	盛新锂能	60	805.20	0.00
169	600141	兴发集团	37	705.96	0.00
170	600673	东阳光	95	668.80	0.00
171	688114	华大智造	13	616.33	0.00
172	688006	杭可科技	35	610.75	0.00
173	600801	华新水泥	42	577.50	0.00
174	600528	中铁工业	71	519.72	0.00
175	600867	通化东宝	58	485.46	0.00
176	688276	百克生物	17	482.29	0.00
177	600392	盛和资源	50	431.00	0.00
178	002673	西部证券	66	408.54	0.00
179	603882	金城医学	14	380.66	0.00
180	000519	中兵红箭	24	352.08	0.00
181	002945	华林证券	33	329.34	0.00
182	603707	健友股份	27	320.76	0.00
183	603225	新凤鸣	20	311.80	0.00
184	300009	安科生物	36	307.44	0.00
185	603185	弘元绿能	17	290.53	0.00
186	000778	新兴铸管	82	285.36	0.00
187	601000	唐山港	50	235.00	0.00
188	000559	万向钱潮	40	178.40	0.00
189	600985	淮北矿业	10	167.40	0.00
190	002244	滨江集团	21	152.46	0.00
191	688538	和辉光电	63	124.74	0.00
192	000039	中集集团	10	92.60	0.00
193	601568	北元集团	17	63.07	0.00
194	002607	中公教育	25	38.25	0.00
195	600126	杭钢股份	6	24.66	0.00
196	000723	美锦能源	4	19.04	0.00
197	600271	航天信息	2	14.72	0.00
198	002429	兆驰股份	3	14.43	0.00

7.3.2 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	600487	亨通光电	418,700	6,602,899.00	0.47
2	600522	XD 中天科	405,200	6,422,420.00	0.45
3	601601	中国太保	226,000	6,296,360.00	0.45
4	002035	华帝股份	981,900	6,117,237.00	0.43
5	002422	科伦药业	185,200	5,617,116.00	0.40
6	688578	艾力斯	87,900	5,602,746.00	0.40
7	688510	航亚科技	294,329	5,418,596.89	0.38

8	600893	航发动力	141,100	5,157,205.00	0.36
9	605016	百龙创园	238,250	4,853,152.50	0.34
10	600458	时代新材	473,213	4,779,451.30	0.34
11	300628	亿联网络	120,834	4,443,066.18	0.31
12	600803	新奥股份	208,600	4,338,880.00	0.31
13	603050	科林电气	178,084	4,320,317.84	0.31
14	002179	中航光电	112,000	4,261,600.00	0.30
15	000538	云南白药	82,120	4,200,438.00	0.30
16	601101	昊华能源	451,600	4,150,204.00	0.29
17	601138	工业富联	147,100	4,030,540.00	0.28
18	600894	广日股份	340,800	3,919,200.00	0.28
19	300181	佐力药业	259,200	3,919,104.00	0.28
20	000922	佳电股份	322,800	3,851,004.00	0.27
21	600993	马应龙	144,000	3,840,480.00	0.27
22	300218	安利股份	254,400	3,836,352.00	0.27
23	605111	新洁能	125,400	3,835,986.00	0.27
24	000550	江铃汽车	174,000	3,777,540.00	0.27
25	601117	XD 中国化	398,300	3,281,992.00	0.23
26	002997	瑞鹄模具	102,000	3,260,940.00	0.23
27	600575	淮河能源	837,400	3,257,486.00	0.23
28	605183	确成股份	207,500	3,207,950.00	0.23
29	002371	北方华创	10,000	3,198,900.00	0.23
30	600368	五洲交通	884,070	3,156,129.90	0.22
31	000913	钱江摩托	199,000	3,136,240.00	0.22
32	002594	比亚迪	12,500	3,128,125.00	0.22
33	002311	海大集团	66,209	3,115,133.45	0.22
34	600452	涪陵电力	242,700	3,075,009.00	0.22
35	300750	宁德时代	17,000	3,060,510.00	0.22
36	300751	迈为股份	25,500	3,046,740.00	0.22
37	600618	氯碱化工	344,400	3,023,832.00	0.21
38	603515	欧普照明	173,400	3,006,756.00	0.21
39	600926	杭州银行	229,800	2,998,890.00	0.21
40	300470	中密控股	87,400	2,954,994.00	0.21
41	603008	喜临门	167,500	2,902,775.00	0.21
42	002441	众业达	381,800	2,894,044.00	0.20
43	600694	大商股份	166,140	2,792,813.40	0.20
44	000544	中原环保	348,000	2,738,760.00	0.19
45	600219	南山铝业	625,600	2,383,536.00	0.17
46	300408	三环集团	78,500	2,291,415.00	0.16
47	601328	交通银行	261,300	1,951,911.00	0.14
48	300783	三只松鼠	83,100	1,817,397.00	0.13
49	600007	中国国贸	74,800	1,642,608.00	0.12
50	300274	阳光电源	24,500	1,519,735.00	0.11

51	002267	陕天然气	195,800	1,480,248.00	0.10
52	688208	道通科技	61,316	1,480,168.24	0.10
53	300908	仲景食品	47,760	1,326,772.80	0.09
54	601229	上海银行	180,500	1,310,430.00	0.09
55	000725	京东方 A	299,900	1,226,591.00	0.09
56	600183	生益科技	51,800	1,090,908.00	0.08
57	603733	仙鹤股份	58,500	1,028,430.00	0.07
58	002252	上海莱士	118,400	925,888.00	0.07
59	000551	创元科技	99,300	866,889.00	0.06
60	603699	纽威股份	49,700	850,864.00	0.06
61	300453	三鑫医疗	31,550	201,604.50	0.01
62	688701	卓锦股份	30,621	165,047.19	0.01
63	300109	新开源	8,000	92,640.00	0.01
64	688737	中自科技	2,769	44,857.80	0.00
65	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
66	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
67	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
68	300760	迈瑞医疗	60	17,454.60	0.00
69	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
70	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
71	688019	安集科技	94	11,825.20	0.00
72	688018	乐鑫科技	111	10,953.48	0.00
73	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
74	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
75	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
76	688256	寒武纪	34	6,754.78	0.00
77	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
78	688111	金山办公	23	5,232.50	0.00
79	688300	联瑞新材	94	4,521.40	0.00
80	688668	鼎通科技	113	4,439.77	0.00
81	688363	华熙生物	73	4,129.61	0.00
82	002897	意华股份	99	3,728.34	0.00
83	688396	华润微	94	3,519.36	0.00
84	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
85	688139	海尔生物	85	3,162.00	0.00
86	688665	四方光电	104	2,884.96	0.00
87	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
88	688698	伟创电气	86	2,319.42	0.00
89	688625	呈和科技	62	2,254.32	0.00
90	688686	奥普特	33	2,112.99	0.00
91	688116	天奈科技	86	1,984.88	0.00
92	688228	开普云	52	1,984.32	0.00
93	688298	东方生物	70	1,900.50	0.00

94	688070	纵横股份	65	1,836.90	0.00
95	688799	华纳药厂	41	1,739.63	0.00
96	688078	龙软科技	72	1,658.16	0.00
97	688185	康希诺	40	1,643.60	0.00
98	688690	纳微科技	93	1,615.41	0.00
99	002415	海康威视	51	1,576.41	0.00
100	688519	南亚新材	61	1,559.77	0.00
101	300482	万孚生物	60	1,464.00	0.00
102	688369	致远互联	87	1,368.51	0.00
103	688023	安恒信息	34	1,360.34	0.00
104	688357	建龙微纳	58	1,351.40	0.00
105	600482	中国动力	66	1,285.68	0.00
106	600760	中航沈飞	32	1,283.20	0.00
107	688118	普元信息	88	1,269.84	0.00
108	688330	宏力达	60	1,223.40	0.00
109	000408	藏格矿业	50	1,203.50	0.00
110	688003	天准科技	36	1,179.36	0.00
111	002925	盈趣科技	90	1,140.30	0.00
112	688066	航天宏图	64	1,139.20	0.00
113	688328	深科达	79	1,124.17	0.00
114	688550	瑞联新材	46	1,066.74	0.00
115	688669	聚石化学	93	1,052.76	0.00
116	688303	大全能源	49	999.11	0.00
117	300480	光力科技	58	918.14	0.00
118	688057	金达莱	87	853.47	0.00
119	300244	迪安诊断	60	720.00	0.00
120	002416	爱施德	80	708.00	0.00
121	603602	纵横通信	50	623.50	0.00
122	000807	云铝股份	45	607.95	0.00
123	601728	中国电信	96	590.40	0.00
124	688195	腾景科技	23	563.73	0.00
125	688556	高测股份	46	546.94	0.00
126	002030	达安基因	99	495.00	0.00
127	000528	柳工	40	447.60	0.00
128	600064	南京高科	68	412.76	0.00
129	601006	大秦铁路	57	408.12	0.00
130	600057	厦门象屿	56	380.80	0.00
131	300363	博腾股份	31	370.45	0.00
132	688728	格科微	30	363.30	0.00
133	688126	沪硅产业	23	317.63	0.00
134	002332	仙琚制药	25	285.25	0.00
135	605368	蓝天燃气	20	272.80	0.00
136	000597	东北制药	69	267.03	0.00

137	603195	公牛集团	3	231.36	0.00
138	600789	鲁抗医药	33	231.00	0.00
139	600161	天坛生物	8	195.20	0.00
140	002511	中顺洁柔	28	193.76	0.00
141	600660	福耀玻璃	4	191.60	0.00
142	600551	时代出版	25	177.00	0.00
143	688586	江航装备	18	167.40	0.00
144	603866	桃李面包	32	162.24	0.00
145	600674	川投能源	8	150.00	0.00
146	002688	金河生物	38	137.94	0.00
147	000028	国药一致	4	128.92	0.00
148	000822	山东海化	22	128.26	0.00
149	002073	软控股份	17	125.63	0.00
150	600623	华谊集团	14	80.92	0.00
151	000415	渤海租赁	26	66.30	0.00
152	600507	方大特钢	9	33.66	0.00
153	002550	千红制药	6	32.34	0.00
154	600523	贵航股份	2	19.80	0.00
155	002131	利欧股份	10	14.30	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603160	汇顶科技	49,926,990.80	1.28
2	688099	晶晨股份	46,303,661.69	1.19
3	000988	华工科技	42,689,285.16	1.10
4	603786	科博达	39,719,459.00	1.02
5	002019	亿帆医药	38,596,099.00	0.99
6	603267	鸿远电子	37,160,384.42	0.95
7	002195	岩山科技	37,031,274.00	0.95
8	600839	四川长虹	33,900,060.38	0.87
9	601128	常熟银行	32,990,333.78	0.85
10	000895	双汇发展	32,796,906.00	0.84
11	601168	西部矿业	32,749,330.00	0.84
12	002607	中公教育	32,347,356.00	0.83
13	603737	三棵树	31,862,396.79	0.82
14	000933	神火股份	31,368,111.00	0.81
15	300558	贝达药业	30,668,846.00	0.79
16	600535	天士力	30,604,458.00	0.79
17	301029	怡合达	28,677,662.40	0.74
18	002120	韵达股份	28,520,401.00	0.73
19	600873	梅花生物	28,410,600.50	0.73

20	000513	丽珠集团	28,342,921.00	0.73
----	--------	------	---------------	------

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601168	西部矿业	69,016,035.00	1.77
2	002683	广东宏大	58,513,014.00	1.50
3	300776	帝尔激光	55,827,389.55	1.43
4	300136	信维通信	53,507,355.00	1.37
5	300253	卫宁健康	52,848,836.01	1.36
6	002487	大金重工	49,820,249.80	1.28
7	601717	郑煤机	46,774,686.15	1.20
8	002240	盛新锂能	46,476,801.00	1.19
9	002850	科达利	44,452,781.14	1.14
10	600161	天坛生物	43,816,601.18	1.13
11	600271	航天信息	43,600,734.00	1.12
12	000519	中兵红箭	42,139,787.00	1.08
13	601058	赛轮轮胎	40,998,081.60	1.05
14	600392	盛和资源	40,683,398.89	1.05
15	000009	中国宝安	40,624,951.00	1.04
16	002797	第一创业	40,338,457.00	1.04
17	600377	宁沪高速	39,746,748.00	1.02
18	000039	中集集团	38,653,920.30	0.99
19	000887	中鼎股份	38,591,215.00	0.99
20	002430	杭氧股份	38,584,431.00	0.99

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,360,582,610.67
卖出股票收入（成交）总额	6,364,238,135.68

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	74,932,140.83	5.30
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）	56,288.86	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	74,988,429.69	5.30

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	636,000	64,775,990.14	4.58
2	019709	23 国债 16	100,000	10,156,150.69	0.72
3	113683	伟 24 转债	280	56,288.86	0.00

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金在进行股指期货投资时，遵守法律法规的规定和基金合同的约定，符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约，对现货资产进行部分对冲，以增厚整个组合的风险调整后的收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,121,527.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	552,919.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,674,446.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长城中证 500 指数 增强 A	13,174	13,728.75	66,818,563.93	36.94	114,044,031.23	63.06
长城中证 500 指数 增强 C	16,209	63,527.07	987,739,552.84	95.92	41,970,752.37	4.08
合计	29,383	41,199.77	1,054,558,116.77	87.11	156,014,783.60	12.89

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）。

8.2 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	长城中证 500 指数增强 A	433,536.66	0.2397
	长城中证 500 指数增强 C	24,574.38	0.0024
	合计	458,111.04	0.0378

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	长城中证 500 指数增强 A	10~50
	长城中证 500 指数增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	0~10
	长城中证 500 指数增强 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2018 年 8 月 13 日) 基金份额总额	19,420,400.59	-
本报告期期初基金份额总额	203,129,361.30	2,920,615,315.48
本报告期基金总申购份额	44,348,698.30	273,068,966.96
减：本报告期基金总赎回份额	66,615,464.44	2,163,973,977.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	180,862,595.16	1,029,710,305.21

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，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）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券股份有限公司	4	6,670,147,521.68	62.20	1,640,150.70	62.20	-
长城证券	6	4,054,077,762.67	37.80	996,921.88	37.80	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 2 个专用交易单元（招商证券新增 2 个交易单元），减少 2 个专用交易单元（中信建投减少 2 个交易单元）。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：（1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；（3）经营行为规范，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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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(%)
招商证券股份有限公司	43,515,635.00	55.17	22,000,000.00	13.25	-	-
长城证券	35,360,247.00	44.83	144,000,000.00	86.75	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证	-	-	-	-	-	-

券						
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-
万联证	-	-	-	-	-	-

券						
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 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终止北京增财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	2024 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台开户、认申购、转换、赎回及新开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 2 日
3	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展电子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	2024 年 4 月 26 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 7 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20240205-20240325	583,491,410.13	8,219,259.37	591,710,669.50	-	-
	2	20240206-20240317, 20240321-20240630	533,602,341.76	-	166,902,341.76	366,700,000.00	30.2914

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (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

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 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 8 月 31 日