

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	6
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59

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	59
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.11 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城智盈添益债券型发起式证券投资基金	
基金简称	长城智盈添益债券发起式	
基金主代码	020181	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 26 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	113,822,536.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
下属分级基金的交 易代码	020181	020182
报告期末下属分级 基金的份额总额	19,311,549.12 份	94,510,987.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持流动性和控制风险的前提下，通过积极主动的组合管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>（1）A 股投资策略</p> <p>本基金在考虑大类资产配置的基础上，通过定量和定性相结合的方式，进行个股精选。</p> <p>（2）港股通标的投资策略</p> <p>本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会。</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p>

业绩比较基准	中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：本基金业绩比较基准自 2024 年 5 月 29 日起变更为“中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%”。

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	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	周直毅
	联系电话	0755-29279006	021-68475608
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-8868-666	95594
传真		0755-29279000	021-68476901
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	上海市黄浦区中山南路 688 号
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、38 层、39 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		518046	200120
法定代表人		王军	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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、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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
本期已实现收益	106,234.95	207,992.18
本期利润	260,566.04	542,707.43
加权平均基金份 额本期利润	0.0210	0.0210
本期加权平均净 值利润率	1.96%	1.96%
本期基金份额净 值增长率	1.71%	1.56%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	1,650,076.97	7,735,641.84
期末可供分配基 金份额利润	0.0854	0.0818
期末基金资产净 值	20,961,626.09	102,246,629.60
期末基金份额净 值	1.0854	1.0818
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	8.54%	8.18%

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

长城智盈添益债券发起式 A

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

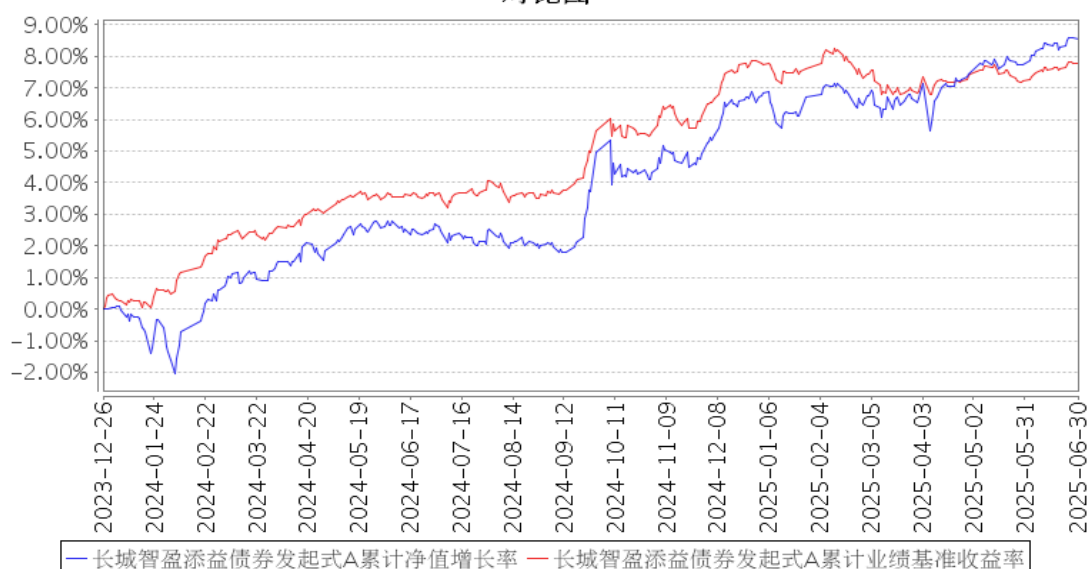
	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.74%	0.09%	0.54%	0.06%	0.20%	0.03%
过去三个月	1.86%	0.22%	0.89%	0.10%	0.97%	0.12%
过去六个月	1.71%	0.20%	-0.02%	0.12%	1.73%	0.08%
过去一年	5.88%	0.22%	3.98%	0.14%	1.90%	0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.54%	0.21%	7.79%	0.13%	0.75%	0.08%

长城智盈添益债券发起式 C

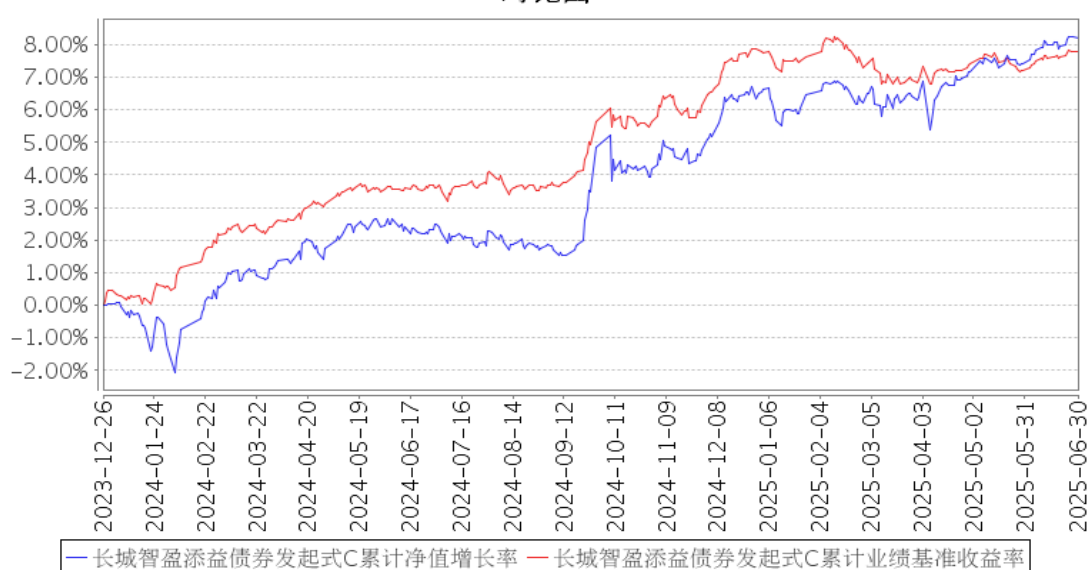
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.72%	0.09%	0.54%	0.06%	0.18%	0.03%
过去三个月	1.78%	0.22%	0.89%	0.10%	0.89%	0.12%
过去六个月	1.56%	0.20%	-0.02%	0.12%	1.58%	0.08%
过去一年	5.74%	0.23%	3.98%	0.14%	1.76%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.18%	0.22%	7.79%	0.13%	0.39%	0.09%

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

长城智盈添益债券发起式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



长城智盈添益债券发起式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于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2025 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 114 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	2023 年 12 月 26 日	-	17 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 2024 年 11 月至 2025 年 6 月任“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”基金经理。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，自 2025 年 1 月至今任“长城中证 A500 指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 4 月至今任“长城上证科创板 100 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至今任“长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”（自 2025 年 6 月 17 日由“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”变更而来）基金经理，自 2025 年 6 月至今任“长城恒生科技指数型证券投资基金(QDII)”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

上半年总体权益市场优于债券市场，商品类黄金表现不错，各宏观资产大类间有较好的对冲效果。具体看权益板块，A 股、港股内部都有明显的结构性机会。A 股上半年市场分化较大，科技类行业轮动较快，TMT、机器人、创新药等主题投资机会层出不穷，总体市场赚钱效应仍然来自于主题投资，估值波动较大，传统产业中银行表现相对更加突出，上市公司盈利多数恢复速度不理想，盈利端依然承压。风格因子方面小市值表现较强，中证 1000、中证 2000 等小市值指数显著跑赢沪深 300 等大盘指数。

报告期内，产品权益部分平均仓位接近配置上限。组合总体延续了资产配置、策略配置、因子配置的三层追求绝对收益的配置策略；总体尽量在不同资产子策略上寻求低相关或是负相关的投资组合，力求在控制绝对波动下追求绝对回报；具体运作上产品在配置层面把握了类红利资产、周期性板块以及部分优质蓝筹公司的盈利机会，因此产品在回撤可控的基础上相对基准有一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城智盈添益债券发起式 A 基金份额净值增长率为 1.71%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%；长城智盈添益债券发起式 C 基金份额净值增长率为 1.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体经济环境来看，利率环境持续宽松，货币供应充足，宏观政策面对于科技创新的扶持力度仍然在不断加大，各行业多个细分方向的“deepseek 时刻”持续出现，有望带动下半年新兴主题类的更多投资机会；从二级市场的成交活跃度看，市场投资的广度效应仍然存在，投资者的参与度持续较高，这也将有利于量化投资策略捕捉相应的超额收益。

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、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关基金经理及研究员、基金会计等岗位资深人员组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验,具有良好的专业能力,并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员,凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配,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,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定,诚实、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,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，本基金的利润分配情况符合有关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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	14,845,575.34	19,343,567.45
结算备付金		546,773.37	20,463.43
存出保证金		298,439.69	50,002.36
交易性金融资产	6.4.7.2	87,872,467.58	11,195,044.65
其中：股票投资		18,422,741.18	2,025,225.26
基金投资		-	-
债券投资		69,449,726.40	9,169,819.39
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	-	-276.16
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		-	7,662,813.12
应收股利		11,272.09	3,993.60
应收申购款		30,113,260.76	220,421.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		133,687,788.83	38,496,029.49
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2025 年 6 月 30 日	2024 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		6,000,000.00	1,100,000.00
应付清算款		4,383,536.35	-
应付赎回款		34,934.16	26,114,782.90
应付管理人报酬		33,584.22	18,235.46
应付托管费		5,597.38	3,039.26
应付销售服务费		11,861.71	24.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,745.25	5,225.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	8,274.07	20,665.85
负债合计		10,479,533.14	27,261,974.34
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	113,822,536.88	10,527,647.68
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,385,718.81	706,407.47
净资产合计		123,208,255.69	11,234,055.15
负债和净资产总计		133,687,788.83	38,496,029.49

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额总额 113,822,536.88 份，其中长城智盈添益债券发起式 A 基金份额总额 19,311,549.12 份，基金份额净值 1.0854 元；长城智盈添益债券发起式 C 基金份额总额 94,510,987.76 份，基金份额净值 1.0818 元。

6.2 利润表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		988,483.79	341,590.12
1. 利息收入		3,880.49	11,252.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,604.33	1,648.16
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		276.16	9,604.35

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		495,493.39	174,714.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,682.64	38,801.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	246,354.84	87,789.94
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	58,840.29	-3.60
股利收益	6.4.7.19	186,615.62	48,126.91
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	489,030.10	155,622.84
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	79.81	0.51
减：二、营业总支出		185,210.32	62,575.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	119,445.66	32,986.38
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,907.74	5,497.78
3. 销售服务费		39,981.13	82.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		541.16	-
其中：卖出回购金融资产支出		541.16	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		195.75	53.12
8. 其他费用	6.4.7.23	5,138.88	23,956.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		803,273.47	279,014.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		803,273.47	279,014.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		803,273.47	279,014.16

6.3 净资产变动表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	10,527,647.68	-	706,407.47	11,234,055.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产	10,527,647.68	-	706,407.47	11,234,055.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	103,294,889.20	-	8,679,311.34	111,974,200.54
(一)、综合收益总额	-	-	803,273.47	803,273.47
(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)	103,294,889.20	-	7,876,037.87	111,170,927.07
其中：1. 基金申购款	117,457,157.25	-	8,804,018.33	126,261,175.58
2. 基金赎回款	-14,162,268.05	-	-927,980.46	-15,090,248.51
(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	113,822,536.88	-	9,385,718.81	123,208,255.69
项目	上年度可比期间 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	10,112,468.43	-	3,790.84	10,116,259.27

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,112,468.43	-	3,790.84	10,116,259.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	24,378,453.92	-	861,887.27	25,240,341.19
(一)、综合收益总额	-	-	279,014.16	279,014.16
(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)	24,378,453.92	-	582,873.11	24,961,327.03
其中：1. 基金申购款	24,760,919.84	-	591,085.93	25,352,005.77
2. 基金赎回款	-382,465.92	-	-8,212.82	-390,678.74
(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	34,490,922.35	-	865,678.11	35,356,600.46

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：

邱春杨

刘沛

李志朋

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

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2023】2560 号文“关于准予长城智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司作为管理人自 2023 年 12 月 11 日至 2023 年 12 月 22 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2023）验字第 70015735_H04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 12 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 10,110,569.52 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 1,898.91 元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币 10,112,468.43 元，折合 10,112,468.43 份基金份额。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，基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费或申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、股票（包括创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以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）。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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基

金管理人在履行适当程序后，本基金的投资组合比例可相应进行调整。

本基金的业绩比较基准为：中债总全价（总值）指数收益率 \times 80%+银行活期存款利率（税后） \times 10%+中证 800 指数收益率 \times 8%+中证港股通综合指数收益率（人民币） \times 2%。

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。

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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 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）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征增值税试点的通知》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附加。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	14,845,575.34
等于：本金	14,844,962.82
加：应计利息	612.52
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	14,845,575.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,949,823.94	-	18,422,741.18	472,917.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	68,735,620.84	525,852.00	69,449,726.40	188,253.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	68,735,620.84	525,852.00	69,449,726.40	188,253.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		86,685,444.78	525,852.00	87,872,467.58	661,170.80

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 2025 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	12,160,050.00	-	-	-
其中：国债期货投资	12,160,050.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	12,160,050.00	-	-	-
----	---------------	---	---	---

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
T2509	10 年期国债 2509	3.00	3,267,000.00	12,550.00
T2512	10 年期国债 2512	1.00	1,089,350.00	14,000.00
TF2512	国债 2512	4.00	4,249,600.00	1,150.00
TL2509	30 年期国债 2509	1.00	1,204,000.00	16,700.00
TL2512	30 年期国债 2512	1.00	1,202,600.00	8,600.00
TL2603	30 年期国债 2603	1.00	1,201,000.00	500.00
合计				53,500.00
减：可抵销期货 暂收款				53,500.00
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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,314.67
其中：交易所市场	3,314.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	4,959.40
合计	8,274.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城智盈添益债券发起式 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,085,323.80	10,085,323.80
本期申购	9,365,873.19	9,365,873.19
本期赎回（以“-”号填列）	-139,647.87	-139,647.87
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	19,311,549.12	19,311,549.12

长城智盈添益债券发起式 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	442,323.88	442,323.88
本期申购	108,091,284.06	108,091,284.06
本期赎回（以“-”号填列）	-14,022,620.18	-14,022,620.18
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	94,510,987.76	94,510,987.76

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

长城智盈添益债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,200,771.62	-523,183.23	677,588.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,200,771.62	-523,183.23	677,588.39
本期利润	106,234.95	154,331.09	260,566.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,131,021.16	-419,098.62	711,922.54
其中：基金申购款	1,148,105.19	-425,840.97	722,264.22
基金赎回款	-17,084.03	6,742.35	-10,341.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,438,027.73	-787,950.76	1,650,076.97

长城智盈添益债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,953.77	-22,134.69	28,819.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	50,953.77	-22,134.69	28,819.08
本期利润	207,992.18	334,715.25	542,707.43
本期基金份额交易产生的变动数	11,152,793.50	-3,988,678.17	7,164,115.33
其中：基金申购款	12,776,974.79	-4,695,220.68	8,081,754.11
基金赎回款	-1,624,181.29	706,542.51	-917,638.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,411,739.45	-3,676,097.61	7,735,641.84

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,394.45
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	175.92
其他	33.96
合计	3,604.33

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,682.64
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	3,682.64

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,567,247.69
减：卖出股票成本总额	3,550,581.51
减：交易费用	12,983.54
买卖股票差价收入	3,682.64

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	271,515.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-25,161.01
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	246,354.84

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,743,017.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,744,964.01
减：应计利息总额	23,214.32
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-25,161.01

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	58,840.29

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	186,615.62
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	186,615.62

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	493,544.66
股票投资	460,111.85
债券投资	33,432.81
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-

2. 衍生工具	-4,650.00
权证投资	-
期货投资	-4,650.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-135.44
合计	489,030.10

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	79.81
合计	79.81

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	4,959.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	96.00
深港通_证券组合费	83.48
合计	5,138.88

6.4.7.24 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。

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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	23,055,233.27	100.00	10,448,152.86	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	69,316,848.60	100.00	16,710,595.00	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	11,800,000.00	100.00	29,300,000.00	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 2025年1月1日至2025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	5,682.72	100.00	3,314.67	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	9,881.88	100.00	5,868.97	100.00

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）本基金 2024 年 1-6 月佣金协议的服务范围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等。

（3）本报告期，本基金的交易佣金费率不超过中国基金业协会对外通报的市场平均股票交易佣金费率的两倍，佣金包含佣金收取方为基金提供证券研究服务而收取的费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	119,445.66	32,986.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	43,571.23	10,357.17
应支付基金管理人的净管理费	75,874.43	22,629.21

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 0.60%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,907.74	5,497.78

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 0.10%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C	合计
	长城基金管理有限公司	-	12.94
合计	-	12.94	12.94
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C	合计
	长城基金管理有限公司	-	12.28
合计	-	12.28	12.28

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 0.30%。销售服务费按该类基金份额前一日资产净值的销售服务费年费率计提。计算公式如下：

$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日（ 2023 年 12 月 26 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	8.7873%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日（ 2023 年 12 月 26 日）持有的基金份	-	-

额		
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.9986%	—

注：基金管理人持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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

长城智盈添益债券发起式 C

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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（%）
长城证券股份有限公司	3,695,491.50	3.2467	—	—

注：关联方持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
上海银行	14,845,575.34	3,394.45	2,892,186.08	1,392.76

注：

本基金的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（2025 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

注：无。

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 2025 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人民币 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 2025 年 06 月 30 日止, 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 6,000,000.00 元。6,000,000.00 元于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

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发行的

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。

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“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。

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货币资金、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 202 5 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	14,845,575.34	-	-	-	-	-	14,845,575.34
结 算 备 付 金	546,773.37	-	-	-	-	-	546,773.37
存 出 保 证 金	298,439.69	-	-	-	-	-	298,439.69
交 易 性 金 融 资 产	-	-	6,232,132.88	49,302,379.44	13,915,214.08	18,422,741.18	87,872,467.58
应	-	-	-	-	-	11,272.09	11,272.09

收股利							
应收申购款	-	-	-	-	-	30,113,260.76	30,113,260.76
资产总计	15,690,788.40	-	6,232,132.88	49,302,379.44	13,915,214.08	48,547,274.03	133,687,788.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,934.16	34,934.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,584.22	33,584.22
应付托管费	-	-	-	-	-	5,597.38	5,597.38
应付清算款	-	-	-	-	-	4,383,536.35	4,383,536.35
卖出回购金融资产款	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00

应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	11,861.71	11,861.71
应交 税费	-	-	-	-	-	1,745.25	1,745.25
其他 负债	-	-	-	-	-	8,274.07	8,274.07
负 债 总 计	6,000,000.00	-	-	-	-	4,479,533.14	10,479,533.14
利 率 敏 感 度 缺 口	9,690,788.40	-	6,232,132.88	49,302,379.44	13,915,214.08		
上 年 度 末 202 4 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	19,343,567.45	-	-	-	-	-	19,343,567.45
结 算 备	20,463.43	-	-	-	-	-	20,463.43

付金							
存出保证金	50,002.36	-	-	-	-	50,002.36	
交易性金融资产	-	1,506,566.71	7,663,252.68	-	2,025,225.26	11,195,044.65	
买入返售金融资产	-276.16	-	-	-	-	-276.16	
应收股利	-	-	-	-	3,993.60	3,993.60	
应收申购款	-	-	-	-	220,421.04	220,421.04	
应收清算款	-	-	-	-	7,662,813.12	7,662,813.12	
资产总计	19,413,757.08	1,506,566.71	7,663,252.68	-	9,912,453.02	38,496,029.49	
负债							
应付赎回	-	-	-	-	26,114,782.90	26,114,782.90	

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,235.46	18,235.46
应付托管费	-	-	-	-	-	3,039.26	3,039.26
卖出回购金融资产款	1,100,000.00	-	-	-	-	-	1,100,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	24.93	24.93
应交税费	-	-	-	-	-	5,225.94	5,225.94
其他负债	-	-	-	-	-	20,665.85	20,665.85
负债总计	1,100,000.00	-	-	-	-	26,161,974.34	27,261,974.34
利率敏	18,313,757.08	1,506,566.71	7,663,252.68	-	-	-	-

感 度 缺 口						
------------------	--	--	--	--	--	--

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,007,945.67	73,197.80
	市场利率上升 25 个基点	-967,586.52	-72,331.82

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。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

于本期末及上年度末，本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,619,938.72	-	4,619,938.72
资产合计	-	4,619,938.72	-	4,619,938.72
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-

资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	4,619,938.72	-	4,619,938.72
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	672,249.48	-	672,249.48
资产合计	-	672,249.48	-	672,249.48
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	672,249.48	-	672,249.48

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币均相对人 民币升值 5%	230,996.94	33,612.47
	所有外币均相对人 民币贬值 5%	-230,996.94	-33,612.47

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。

本基金投资组合的资产配置为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	18,422,741.18	14.95	2,025,225.26	18.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	69,449,726.40	56.37	9,169,819.39	81.63
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	87,872,467.58	71.32	11,195,044.65	99.65

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	835,379.20	80,249.55
	沪深 300 指数下降 5%	-835,379.20	-80,249.55

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	18,422,741.18	2,025,225.26
第二层次	69,449,726.40	9,169,819.39
第三层次	—	—
合计	87,872,467.58	11,195,044.65

6.4.14.2.2 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。

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	18,422,741.18	13.78
	其中：股票	18,422,741.18	13.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,449,726.40	51.95
	其中：债券	69,449,726.40	51.95
	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	15,392,348.71	11.51
8	其他各项资产	30,422,972.54	22.76
9	合计	133,687,788.83	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,619,938.72 元，占基金资产净值的比例为 3.75%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	128,259.00	0.10
B	采矿业	1,138,145.00	0.92
C	制造业	7,799,617.85	6.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,224,827.20	0.99
E	建筑业	19,643.00	0.02
F	批发和零售业	259,967.36	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	708,022.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	471,842.80	0.38
J	金融业	1,155,849.25	0.94
K	房地产业	154,646.00	0.13

L	租赁和商务服务业	315,471.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	88,959.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	24,770.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	71,136.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	241,647.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	13,802,802.46	11.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	976,698.45	0.79
消费者非必需品	430,568.07	0.35
消费者常用品	-	-
能源	55,537.76	0.05
金融	1,979,806.98	1.61
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	122,292.50	0.10
电信服务	1,055,034.96	0.86
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	4,619,938.72	3.75

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

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

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	00700	腾讯控股	2,300	1,055,034.96	0.86
2	01818	招金矿业	52,500	976,698.45	0.79
3	01288	农业银行	154,000	786,465.68	0.64
3	601288	农业银行	3,400	19,992.00	0.02
4	01398	工商银行	104,000	589,922.22	0.48
4	601398	工商银行	3,600	27,324.00	0.02
5	09988	阿里巴巴-W	4,300	430,568.07	0.35
6	00388	香港交易所	600	229,154.80	0.19
7	03988	中国银行	50,000	207,924.60	0.17
7	601988	中国银行	3,500	19,670.00	0.02
8	000983	山西焦煤	35,500	227,200.00	0.18
9	02328	中国财险	12,000	166,339.68	0.14
10	600096	云天化	7,400	162,578.00	0.13

11	000895	双汇发展	6,600	161,106.00	0.13
12	601857	中国石油	18,800	160,740.00	0.13
13	000651	格力电器	3,500	157,220.00	0.13
14	000538	云南白药	2,700	150,633.00	0.12
15	601919	中远海控	9,900	148,896.00	0.12
16	600887	伊利股份	5,300	147,764.00	0.12
17	002600	领益智造	16,600	142,594.00	0.12
18	601958	金钼股份	13,000	142,220.00	0.12
19	600681	百川能源	39,400	138,294.00	0.11
20	600295	鄂尔多斯	14,900	129,779.00	0.11
21	601225	陕西煤业	6,700	128,908.00	0.10
22	002508	老板电器	6,700	127,367.00	0.10
23	601088	中国神华	1,700	68,918.00	0.06
23	01088	中国神华	2,000	55,537.76	0.05
24	00981	中芯国际	3,000	122,292.50	0.10
25	600188	兖矿能源	9,800	119,266.00	0.10
26	000513	丽珠集团	3,200	115,328.00	0.09
27	002267	陕天然气	15,200	115,064.00	0.09
28	001286	陕西能源	13,000	113,100.00	0.09
29	002032	苏泊尔	2,100	110,019.00	0.09
30	002014	永新股份	9,000	109,080.00	0.09
31	600273	嘉化能源	12,600	106,596.00	0.09
32	000708	中信特钢	9,000	105,840.00	0.09
33	002884	凌霄泵业	6,600	105,204.00	0.09
34	301236	软通动力	1,900	103,816.00	0.08
35	603689	皖天然气	12,200	102,724.00	0.08
36	600346	恒力石化	7,200	102,672.00	0.08
37	603889	新澳股份	17,500	101,500.00	0.08
38	600901	江苏金租	16,600	100,596.00	0.08
39	600522	中天科技	6,900	99,774.00	0.08
40	600987	航民股份	14,100	99,687.00	0.08
41	600211	西藏药业	2,700	99,414.00	0.08
42	600873	梅花生物	8,900	95,141.00	0.08
43	600461	洪城环境	9,800	94,472.00	0.08
44	002601	龙佰集团	5,800	94,018.00	0.08
45	000333	美的集团	1,300	93,860.00	0.08
46	600642	申能股份	10,900	93,740.00	0.08
47	002003	伟星股份	8,500	92,735.00	0.08
48	000001	平安银行	7,600	91,732.00	0.07
49	600750	江中药业	4,200	91,686.00	0.07
50	600938	中国海油	3,500	91,385.00	0.07
51	001323	慕思股份	3,000	90,480.00	0.07
52	600941	中国移动	800	90,040.00	0.07

53	600351	亚宝药业	14,700	89,229.00	0.07
54	603299	苏盐井神	9,400	89,018.00	0.07
55	002083	孚日股份	18,400	88,872.00	0.07
56	002275	桂林三金	6,100	87,291.00	0.07
57	600007	中国国贸	4,200	86,436.00	0.07
58	002463	沪电股份	2,000	85,160.00	0.07
59	603195	公牛集团	1,763	85,064.75	0.07
60	000423	东阿阿胶	1,600	83,680.00	0.07
61	600153	建发股份	7,900	81,923.00	0.07
62	688728	格科微	5,300	81,620.00	0.07
63	600061	国投资本	10,800	81,216.00	0.07
64	002344	海宁皮城	18,700	81,158.00	0.07
65	605090	九丰能源	3,100	80,011.00	0.06
66	600737	中粮糖业	8,400	79,380.00	0.06
67	601318	中国平安	1,400	77,672.00	0.06
68	600517	国网英大	15,200	77,520.00	0.06
69	600803	XD 新奥股	4,100	77,490.00	0.06
70	603071	物产环能	6,000	76,380.00	0.06
71	300750	宁德时代	300	75,666.00	0.06
72	601928	凤凰传媒	6,600	73,722.00	0.06
73	600886	国投电力	5,000	73,700.00	0.06
74	600036	招商银行	1,600	73,520.00	0.06
75	001203	大中矿业	7,600	71,820.00	0.06
76	601717	中创智领	4,300	71,466.00	0.06
77	600757	长江传媒	7,700	71,456.00	0.06
78	300015	爱尔眼科	5,700	71,136.00	0.06
79	002027	分众传媒	9,700	70,810.00	0.06
80	000429	粤高速 A	5,300	70,649.00	0.06
81	601686	友发集团	12,400	70,432.00	0.06
82	002831	裕同科技	3,000	70,260.00	0.06
83	600329	达仁堂	2,100	70,056.00	0.06
84	601098	中南传媒	5,200	68,224.00	0.06
85	601236	红塔证券	8,000	67,760.00	0.05
86	605296	神农集团	2,200	67,628.00	0.05
87	001872	招商港口	3,400	67,524.00	0.05
88	600377	宁沪高速	4,400	67,496.00	0.05
89	600219	南山铝业	17,600	67,408.00	0.05
90	603053	成都燃气	7,000	67,270.00	0.05
91	601298	青岛港	7,400	64,306.00	0.05
92	600572	康恩贝	14,600	63,948.00	0.05
93	002318	久立特材	2,700	63,153.00	0.05
94	605499	东鹏饮料	200	62,810.00	0.05
95	600660	福耀玻璃	1,100	62,711.00	0.05

96	000758	中色股份	12,300	61,869.00	0.05
97	603156	养元饮品	2,900	61,364.00	0.05
98	000690	宝新能源	13,300	60,515.00	0.05
99	601089	福元医药	3,600	60,048.00	0.05
100	600535	天士力	3,800	59,470.00	0.05
101	000623	吉林敖东	3,500	59,325.00	0.05
102	000567	海德股份	10,000	59,200.00	0.05
103	601311	骆驼股份	6,400	57,792.00	0.05
104	002507	涪陵榨菜	4,300	54,997.00	0.04
105	601628	中国人寿	1,300	53,547.00	0.04
106	003016	欣贺股份	7,100	53,250.00	0.04
107	600479	千金药业	5,100	53,040.00	0.04
108	600020	中原高速	10,900	52,102.00	0.04
109	600690	海尔智家	2,100	52,038.00	0.04
110	002228	合兴包装	14,500	51,185.00	0.04
111	600177	雅戈尔	6,800	49,640.00	0.04
112	600919	江苏银行	4,100	48,954.00	0.04
113	603658	安图生物	1,300	48,750.00	0.04
114	603886	元祖股份	3,700	48,359.00	0.04
115	601000	唐山港	11,900	48,314.00	0.04
116	002053	云南能投	4,300	47,343.00	0.04
117	002714	牧原股份	1,100	46,211.00	0.04
118	000630	铜陵有色	13,800	46,092.00	0.04
119	603281	江瀚新材	1,800	45,108.00	0.04
120	688347	华虹公司	800	43,928.00	0.04
121	000999	华润三九	1,400	43,792.00	0.04
122	605507	国邦医药	2,200	43,494.00	0.04
123	600916	中国黄金	5,300	43,301.00	0.04
124	300782	卓胜微	600	42,822.00	0.03
125	001965	招商公路	3,500	42,000.00	0.03
126	605368	蓝天燃气	4,200	41,328.00	0.03
127	601369	陕鼓动力	4,700	41,219.00	0.03
128	601328	交通银行	5,100	40,800.00	0.03
129	002736	国信证券	3,500	40,320.00	0.03
130	300595	欧普康视	2,600	39,702.00	0.03
131	002763	汇洁股份	5,700	39,330.00	0.03
132	603587	地素时尚	3,100	38,502.00	0.03
133	000848	承德露露	4,200	38,346.00	0.03
134	600236	桂冠电力	5,900	36,993.00	0.03
135	000088	盐田港	8,000	36,240.00	0.03
136	002867	周大生	2,700	35,586.00	0.03
137	301132	满坤科技	1,000	35,280.00	0.03
138	002080	中材科技	1,800	35,100.00	0.03

139	605377	华旺科技	3,960	34,887.60	0.03
140	688150	莱特光电	1,400	34,608.00	0.03
141	688131	皓元医药	700	33,845.00	0.03
142	601601	中国太保	900	33,759.00	0.03
143	600582	天地科技	5,500	32,945.00	0.03
144	600023	浙能电力	6,100	32,330.00	0.03
145	002152	广电运通	2,400	32,256.00	0.03
146	300014	亿纬锂能	700	32,067.00	0.03
147	300864	南大环境	1,600	31,920.00	0.03
148	601169	北京银行	4,600	31,418.00	0.03
149	301339	通行宝	1,820	31,176.60	0.03
150	300725	药石科技	800	30,960.00	0.03
151	600998	九州通	5,974	30,706.36	0.02
152	300226	上海钢联	1,300	29,692.00	0.02
153	300140	节能环保	4,800	29,616.00	0.02
154	601319	中国人保	3,400	29,614.00	0.02
155	300496	中科创达	500	28,610.00	0.02
156	603589	口子窖	800	27,840.00	0.02
157	002142	宁波银行	1,000	27,360.00	0.02
158	600900	长江电力	900	27,126.00	0.02
159	600282	南钢股份	6,400	26,880.00	0.02
160	002174	游族网络	2,200	26,686.00	0.02
161	601952	苏垦农发	2,700	26,649.00	0.02
162	600850	电科数字	1,100	26,609.00	0.02
163	601065	江盐集团	3,200	26,304.00	0.02
164	601818	光大银行	6,300	26,145.00	0.02
165	688352	顾中科技	2,300	25,829.00	0.02
166	301358	湖南裕能	800	24,952.00	0.02
167	603699	纽威股份	800	24,936.00	0.02
168	300002	神州泰岳	2,100	24,780.00	0.02
169	301119	正强股份	700	24,752.00	0.02
170	603050	科林电气	1,500	24,690.00	0.02
171	688601	力芯微	600	23,970.00	0.02
172	002768	国恩股份	900	23,769.00	0.02
173	600332	白云山	900	23,724.00	0.02
174	600251	冠农股份	3,100	23,653.00	0.02
175	300122	智飞生物	1,200	23,508.00	0.02
176	603515	欧普照明	1,300	23,387.00	0.02
177	601009	南京银行	2,000	23,240.00	0.02
178	603303	得邦照明	1,900	22,933.00	0.02
179	000060	中金岭南	5,000	22,900.00	0.02
180	300390	天华新能	1,200	22,884.00	0.02
181	601698	中国卫通	1,100	22,517.00	0.02

182	000301	东方盛虹	2,700	22,491.00	0.02
183	688819	天能股份	800	22,208.00	0.02
184	600015	华夏银行	2,800	22,148.00	0.02
185	002028	思源电气	300	21,873.00	0.02
186	002171	楚江新材	2,200	21,406.00	0.02
187	000011	深物业 A	2,500	21,125.00	0.02
188	603701	德宏股份	1,200	20,976.00	0.02
189	300654	世纪天鸿	2,000	20,960.00	0.02
190	002454	松芝股份	2,700	20,844.00	0.02
191	000548	湖南投资	3,900	20,826.00	0.02
192	688122	西部超导	400	20,752.00	0.02
193	003022	联泓新科	1,300	20,579.00	0.02
194	301373	凌玮科技	700	20,489.00	0.02
195	300375	鹏翎股份	4,000	20,440.00	0.02
196	600016	民生银行	4,300	20,425.00	0.02
197	600578	京能电力	4,500	20,205.00	0.02
198	002818	富森美	1,600	19,968.00	0.02
199	600031	三一重工	1,100	19,745.00	0.02
200	002091	江苏国泰	2,700	19,629.00	0.02
201	002415	海康威视	700	19,411.00	0.02
202	301205	联特科技	200	19,172.00	0.02
203	603727	博迈科	1,300	19,019.00	0.02
204	603043	广州酒家	1,200	18,696.00	0.02
205	601186	XD 中国铁	2,300	18,423.00	0.01
206	600640	国脉文化	1,500	18,180.00	0.01
207	301195	北路智控	500	17,900.00	0.01
208	600548	深高速	1,700	17,799.00	0.01
209	600196	复星医药	700	17,563.00	0.01
210	300951	博硕科技	500	17,150.00	0.01
210	688128	中国电研	700	17,150.00	0.01
211	002971	和远气体	700	16,331.00	0.01
212	600309	万华化学	300	16,278.00	0.01
213	300207	欣旺达	800	16,048.00	0.01
214	688233	神工股份	500	15,885.00	0.01
215	002737	葵花药业	1,000	15,720.00	0.01
216	603288	海天味业	400	15,564.00	0.01
217	688155	先惠技术	300	15,486.00	0.01
218	300755	华致酒行	800	15,440.00	0.01
219	301448	开创电气	600	15,378.00	0.01
220	601998	中信银行	1,800	15,300.00	0.01
221	688616	西力科技	1,200	15,264.00	0.01
222	300787	海能实业	1,100	15,235.00	0.01
223	300939	秋田微	500	15,200.00	0.01

224	300400	劲拓股份	900	15,156.00	0.01
225	000581	威孚高科	800	15,152.00	0.01
226	600905	三峡能源	3,500	14,910.00	0.01
227	300088	长信科技	2,500	14,900.00	0.01
227	300623	捷捷微电	500	14,900.00	0.01
228	301282	金禄电子	600	14,874.00	0.01
229	001914	招商积余	1,200	14,844.00	0.01
230	688358	祥生医疗	500	14,825.00	0.01
231	001391	国货航	2,200	14,806.00	0.01
232	002666	德联集团	2,900	14,761.00	0.01
233	002817	黄山胶囊	2,000	14,760.00	0.01
234	000030	富奥股份	2,500	14,725.00	0.01
235	002913	奥士康	500	14,705.00	0.01
236	300439	美康生物	1,400	14,686.00	0.01
237	600028	中国石化	2,600	14,664.00	0.01
237	688098	申联生物	2,400	14,664.00	0.01
238	688252	天德钰	600	14,628.00	0.01
239	000055	方大集团	3,400	14,620.00	0.01
240	300160	秀强股份	2,600	14,612.00	0.01
241	688588	凌志软件	1,000	14,570.00	0.01
242	002382	蓝帆医疗	2,600	14,560.00	0.01
243	300690	双一科技	600	14,526.00	0.01
244	002203	海亮股份	1,400	14,448.00	0.01
245	600598	北大荒	1,000	14,420.00	0.01
246	688432	有研硅	1,300	14,352.00	0.01
247	688570	天玛智控	700	14,336.00	0.01
248	603898	好莱客	1,300	14,287.00	0.01
249	600742	富维股份	1,500	14,265.00	0.01
250	300508	维宏股份	500	14,195.00	0.01
251	301488	豪恩汽电	200	14,160.00	0.01
252	600362	XD 江西铜	600	14,058.00	0.01
253	300774	倍杰特	1,600	14,000.00	0.01
254	603075	热威股份	700	13,993.00	0.01
255	300319	麦捷科技	1,300	13,962.00	0.01
256	601155	新城控股	1,000	13,680.00	0.01
257	688633	星球石墨	500	13,615.00	0.01
258	300492	华图山鼎	200	13,576.00	0.01
259	300151	昌红科技	1,100	13,541.00	0.01
260	301028	东亚机械	1,100	13,519.00	0.01
261	688665	四方光电	300	13,416.00	0.01
262	002543	万和电气	1,200	13,332.00	0.01
263	300349	金卡智能	1,100	13,145.00	0.01
264	600821	金开新能	2,400	13,032.00	0.01

265	688360	德马科技	700	12,985.00	0.01
266	002304	洋河股份	200	12,910.00	0.01
267	688330	宏力达	500	12,840.00	0.01
268	688589	力合微	600	12,834.00	0.01
269	000869	张裕 A	600	12,738.00	0.01
270	688080	映翰通	250	12,722.50	0.01
271	301328	维峰电子	300	12,645.00	0.01
272	002978	安宁股份	400	12,632.00	0.01
273	688558	国盛智科	500	12,620.00	0.01
274	300735	光弘科技	500	12,550.00	0.01
275	688181	八亿时空	400	12,448.00	0.01
276	688503	聚和材料	300	12,417.00	0.01
277	300962	中金辐照	700	12,411.00	0.01
278	301202	朗威股份	300	12,330.00	0.01
279	301015	百洋医药	600	12,036.00	0.01
280	002399	海普瑞	1,000	11,910.00	0.01
281	605255	天普股份	600	11,736.00	0.01
282	301370	国科恒泰	1,100	11,715.00	0.01
283	601899	紫金矿业	600	11,700.00	0.01
284	600639	浦东金桥	1,100	11,649.00	0.01
285	000821	京山轻机	1,000	11,590.00	0.01
285	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.01
286	600893	航发动力	300	11,562.00	0.01
287	300481	濮阳惠成	800	11,448.00	0.01
288	688553	汇宇制药	700	11,403.00	0.01
289	688247	宣泰医药	1,100	11,363.00	0.01
290	300406	九强生物	800	11,320.00	0.01
291	002534	西子洁能	1,000	11,240.00	0.01
292	002950	奥美医疗	1,300	11,180.00	0.01
293	300978	东箭科技	1,000	11,160.00	0.01
294	601021	春秋航空	200	11,130.00	0.01
295	600526	菲达环保	2,300	11,040.00	0.01
296	002332	仙琚制药	1,200	11,004.00	0.01
297	301179	泽宇智能	720	10,987.20	0.01
298	003006	百亚股份	400	10,952.00	0.01
299	601107	四川成渝	1,800	10,836.00	0.01
300	000726	鲁泰 A	1,700	10,778.00	0.01
301	301305	朗坤科技	600	10,770.00	0.01
302	300463	迈克生物	900	10,710.00	0.01
303	000828	东莞控股	1,000	10,690.00	0.01
304	002001	新和成	500	10,635.00	0.01
305	002237	恒邦股份	900	10,620.00	0.01
306	603153	上海建科	600	10,578.00	0.01

307	300979	华利集团	200	10,514.00	0.01
308	600012	皖通高速	600	10,188.00	0.01
309	600268	国电南自	1,300	10,166.00	0.01
310	605599	莱百股份	600	9,810.00	0.01
311	001301	尚太科技	200	9,752.00	0.01
312	688091	上海谊众	200	9,356.00	0.01
313	601166	兴业银行	400	9,336.00	0.01
314	302132	中航成飞	100	8,794.00	0.01
315	301023	江南奕帆	200	8,734.00	0.01
316	600167	联美控股	1,500	8,430.00	0.01
317	600926	杭州银行	500	8,410.00	0.01
318	605333	沪光股份	300	8,235.00	0.01
319	000768	中航西飞	300	8,202.00	0.01
320	002847	盐津铺子	100	8,040.00	0.01
321	300146	汤臣倍健	700	7,868.00	0.01
322	301153	中科江南	300	7,860.00	0.01
323	000900	现代投资	1,800	7,614.00	0.01
324	300017	网宿科技	700	7,504.00	0.01
325	002233	塔牌集团	1,000	7,400.00	0.01
326	601811	新华文轩	500	7,285.00	0.01
327	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.01
328	300059	东方财富	300	6,939.00	0.01
329	600675	中华企业	2,400	6,912.00	0.01
330	600875	东方电气	400	6,696.00	0.01
331	600929	雪天盐业	1,300	6,578.00	0.01
332	600585	海螺水泥	300	6,441.00	0.01
333	601838	成都银行	300	6,030.00	0.00
334	600795	国电电力	1,200	5,808.00	0.00
335	600867	通化东宝	700	5,740.00	0.00
336	600380	健康元	500	5,515.00	0.00
337	601607	上海医药	300	5,364.00	0.00
338	600420	国药现代	500	5,325.00	0.00
339	605183	确成股份	300	5,250.00	0.00
340	002690	美亚光电	300	5,061.00	0.00
341	600703	三安光电	400	4,968.00	0.00
342	600989	宝丰能源	300	4,842.00	0.00
343	600019	宝钢股份	700	4,613.00	0.00
344	002134	天津普林	200	4,560.00	0.00
345	601877	正泰电器	200	4,534.00	0.00
346	002705	新宝股份	300	4,410.00	0.00
347	002550	千红制药	500	4,200.00	0.00
348	600000	浦发银行	300	4,164.00	0.00
349	002078	太阳纸业	300	4,038.00	0.00

350	600033	福建高速	1,100	3,894.00	0.00
351	600741	华域汽车	200	3,530.00	0.00
352	000830	鲁西化工	300	3,090.00	0.00
353	601825	沪农商行	300	2,910.00	0.00
354	600566	济川药业	100	2,633.00	0.00
355	603530	神马电力	100	2,592.00	0.00
356	603993	洛阳钼业	300	2,526.00	0.00
357	000544	中原环保	300	2,439.00	0.00
358	002956	西麦食品	100	2,347.00	0.00
359	601128	常熟银行	275	2,026.75	0.00
360	300803	指南针	25	2,016.50	0.00
361	600971	恒源煤电	300	1,980.00	0.00
361	601006	大秦铁路	300	1,980.00	0.00
362	600483	福能股份	200	1,928.00	0.00
363	601665	齐鲁银行	300	1,896.00	0.00
364	000529	广弘控股	300	1,833.00	0.00
365	603080	新疆火炬	100	1,735.00	0.00
366	002752	昇兴股份	300	1,671.00	0.00
367	601658	邮储银行	300	1,641.00	0.00
368	601766	中国中车	200	1,408.00	0.00
369	600348	华阳股份	200	1,332.00	0.00
370	600098	广州发展	200	1,250.00	0.00
371	601997	贵阳银行	200	1,248.00	0.00
372	600820	隧道股份	200	1,220.00	0.00
373	000937	冀中能源	200	1,150.00	0.00
374	000650	仁和药业	200	1,084.00	0.00
375	600968	海油发展	200	816.00	0.00
376	601018	宁波港	200	732.00	0.00
377	003816	中国广核	200	728.00	0.00
378	002911	佛燃能源	20	205.20	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	00700	腾讯控股	731,837.85	6.51
2	01288	农业银行	687,366.72	6.12
2	601288	农业银行	19,924.00	0.18
3	01398	工商银行	554,280.12	4.93
3	601398	工商银行	84,459.00	0.75
4	01818	招金矿业	616,342.50	5.49
5	09988	阿里巴巴-W	442,214.43	3.94
6	03988	中国银行	212,645.12	1.89

6	601988	中国银行	54,996.00	0.49
7	000983	山西焦煤	222,315.00	1.98
8	00388	香港交易所	210,591.37	1.87
9	002625	光启技术	198,480.00	1.77
10	601919	中远海控	192,046.00	1.71
11	601225	陕西煤业	163,913.00	1.46
12	600096	云天化	162,195.00	1.44
13	000895	双汇发展	155,562.00	1.38
14	600295	鄂尔多斯	152,691.00	1.36
15	601857	中国石油	148,591.00	1.32
16	000651	格力电器	144,679.00	1.29
17	600887	伊利股份	143,848.00	1.28
18	002600	领益智造	137,327.00	1.22
19	600681	百川能源	136,604.00	1.22
20	601958	金钼股份	136,493.00	1.21

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	186,467.00	1.66
2	01818	招金矿业	140,924.85	1.25
3	300059	东方财富	107,600.00	0.96
4	001391	国货航	99,260.00	0.88
5	302132	中航成飞	94,462.00	0.84
6	300124	汇川技术	92,954.00	0.83
7	600251	冠农股份	67,043.00	0.60
8	603757	大元泵业	66,894.00	0.60
9	601398	工商银行	62,455.00	0.56
10	688111	金山办公	60,906.00	0.54
11	603587	地素时尚	55,329.00	0.49
12	688153	唯捷创芯	54,961.00	0.49
13	300803	指南针	54,274.00	0.48
14	002831	裕同科技	54,227.00	0.48
15	600023	浙能电力	52,950.00	0.47
16	300033	同花顺	51,739.00	0.46
17	600036	招商银行	49,692.00	0.44
18	002216	三全食品	48,371.00	0.43
19	601816	京沪高铁	47,826.00	0.43
20	600703	三安光电	47,813.00	0.43

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	19,487,985.58
卖出股票收入（成交）总额	3,567,247.69

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	69,449,726.40	56.37
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	69,449,726.40	56.37

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	019768	25 国债 03	127,000	12,747,637.18	10.35
2	019742	24 特国 01	88,000	10,058,023.89	8.16
3	019755	24 国债 19	89,140	9,002,419.55	7.31
4	019761	24 国债 24	72,000	7,210,440.99	5.85
5	019757	24 国债 20	55,000	5,626,757.67	4.57

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资于国债期货，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.10.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

7.11.2 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的股票。

7.11.3 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	298,439.69
2	应收清算款	-
3	应收股利	11,272.09
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,113,260.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,422,972.54

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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）	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（%）
长城智盈添益债券发起式 A	101	191,203.46	10,001,889.08	51.79	9,309,660.04	48.21
长城智盈添益债券发起式 C	426	221,856.78	40,646,992.65	43.01	53,863,995.11	56.99
合计	527	215,982.04	50,648,881.73	44.50	63,173,655.15	55.50

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	长城智盈添益债券发起式 A	49,898.71	0.2584
	长城智盈添益债券发起式 C	8,000.00	0.0085
	合计	57,898.71	0.0509

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	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 C	0
	合计	0~10

本基金基金经理持有 本开放式基金	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有资 金	10,001,889.08	8.79	10,001,889.08	8.79	3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,889.08	8.79	10,001,889.08	8.79	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日 （2023 年 12 月 26 日）基金份额总额	10,064,129.80	48,338.63
本报告期期初基金 份额总额	10,085,323.80	442,323.88
本报告期基金总申 购份额	9,365,873.19	108,091,284.06
减：本报告期基金 总赎回份额	139,647.87	14,022,620.18
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	19,311,549.12	94,510,987.76

§ 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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
长城证券	2	23,055,233.27	100.00	5,682.72	100.00	未变更

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务

评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- （1）财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
 - （2）经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
 - （3）合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
 - （4）交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服
- 务；
- （5）研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

- （1）对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；
- （2）按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；
- （3）业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

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(%)
长城证券	69,316,848.60	100.00	11,800,000.00	100.00	-	-

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	2025 年 1 月 22 日

2	长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 3 月 29 日
3	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	2025 年 5 月 9 日
4	长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）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	2025 年 6 月 10 日
5	长城基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 6 月 25 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	20250101-20250520	10,001,889.08	-	-	10,001,889.08	8.7873
个人	1	20250319-20250622	-	14,107,025.30	-	14,107,025.30	12.3939
	2	20250220-20250630	-	34,460,096.91	-	34,460,096.91	30.2753
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智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的文件
- （二）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金基金合同》
- （三）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金托管协议》
- （四）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- （五） 法律意见书
- （六） 基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七） 基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八） 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

2025 年 8 月 29 日