

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64

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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城久泰沪深 300 指数证券投资基金	
基金简称	长城久泰沪深 300 指数	
基金主代码	200002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 5 月 21 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	462,393,919.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
下属分级基金的交 易代码	200002	006912
报告期末下属分级 基金的份额总额	331,421,206.97 份	130,972,712.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	（1）资产配置策略：本基金为增强型指数基金，股票投资以沪深 300 指数作为目标指数。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%。（2）股票投资策略：本基金的指数化投资采用分层抽样法，实现对沪深 300 指数的跟踪，即按照沪深 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。（3）债券投资策略：本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券等。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。
风险收益特征	承担市场平均风险，获取市场平均收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	张姗
	联系电话	0755-29279006	400-61-95555
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-8868-666	400-61-95555
传真	0755-29279000	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、38 层、39 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518046	518040
法定代表人	王军	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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)	
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
本期已实现收益	23,185,532.44	4,049,293.60
本期利润	26,228,899.60	4,110,787.03
加权平均基金份额 本期利润	0.0883	0.1037
本期加权平均净 值利润率	5.20%	11.09%
本期基金份额净 值增长率	4.90%	4.76%
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	113,054,706.46	-4,129,330.26
期末可供分配基金份额利润	0.3411	-0.0315
期末基金资产净值	594,042,811.60	126,843,382.29
期末基金份额净值	1.7924	0.9685
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	363.72%	24.28%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城久泰沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.90%	0.51%	2.37%	0.55%	1.53%	-0.04%
过去三个月	4.95%	1.17%	1.21%	1.04%	3.74%	0.13%
过去六个月	4.90%	1.02%	0.07%	0.97%	4.83%	0.05%
过去一年	13.67%	1.28%	13.12%	1.32%	0.55%	-0.04%
过去三年	-21.15%	1.08%	-11.43%	1.05%	-9.72%	0.03%
自基金合同生效起至今	363.72%	1.50%	248.53%	1.50%	115.19%	0.00%

长城久泰沪深 300 指数 C

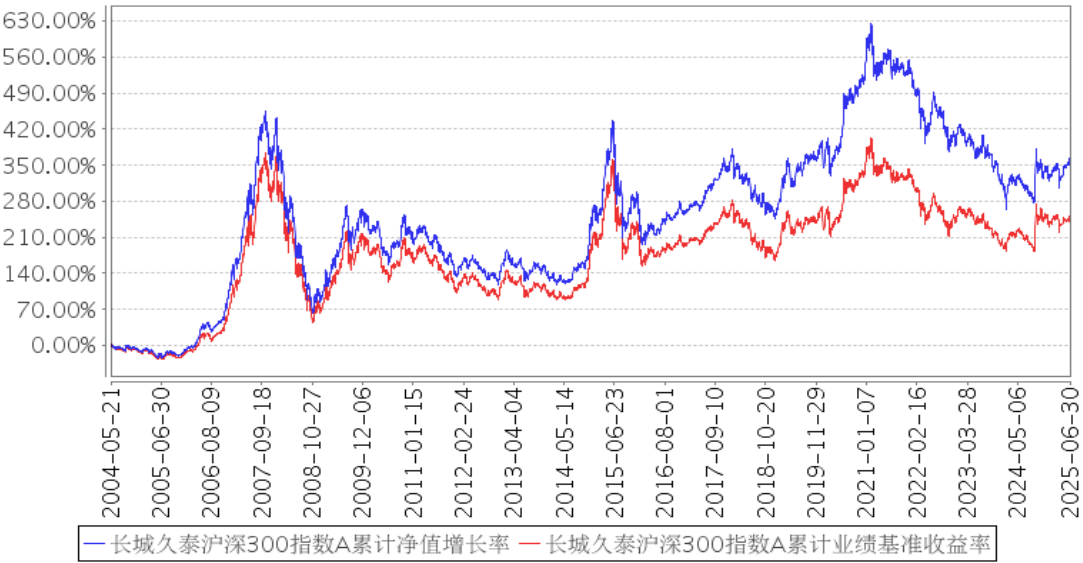
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	3.87%	0.51%	2.37%	0.55%	1.50%	-0.04%
过去三个月	4.88%	1.17%	1.21%	1.04%	3.67%	0.13%
过去六个月	4.76%	1.02%	0.07%	0.97%	4.69%	0.05%
过去一年	13.31%	1.28%	13.12%	1.32%	0.19%	-0.04%
过去三年	-21.90%	1.08%	-11.43%	1.05%	-10.47%	0.03%
自基金合同生效 起至今	24.28%	1.18%	25.91%	1.16%	-1.63%	0.02%

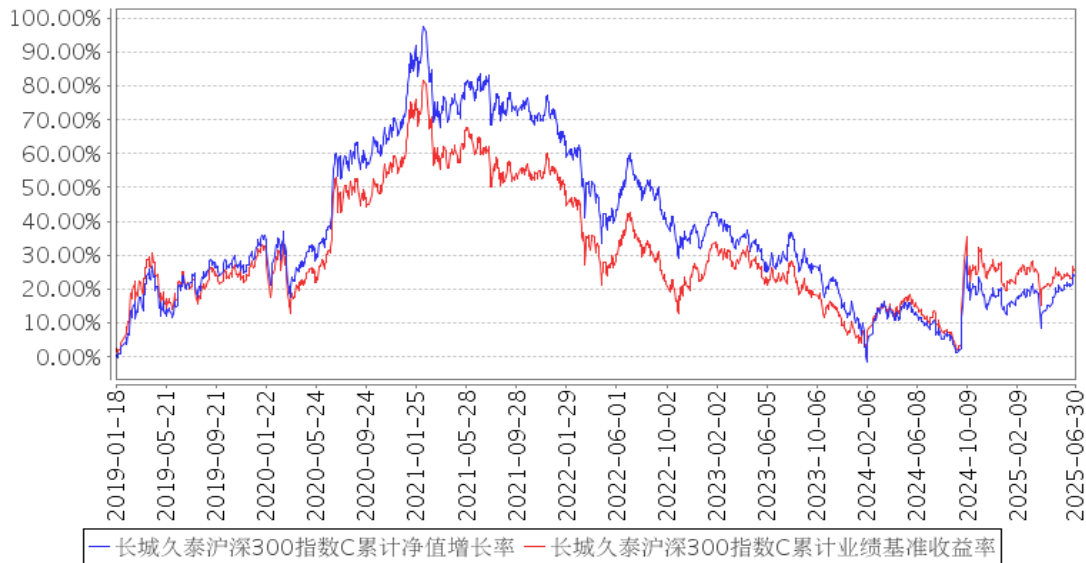
注：注：2011 年 4 月 1 日前长城久泰业绩比较基准每日收益率=中信标普 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%，2011 年 4 月 1 日后长城久泰业绩比较基准每日收益率=沪深 300 指数日收益率×95%+银行同业存款每日利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



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

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

§ 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		
杨建华	公司副总经理、投资总监、权益投资一部总经理、本基金的基金经理	2004 年 5 月 21 日	-	25 年	男，中国籍，硕士，注册会计师（CPA）。1991 年 7 月-1996 年 8 月曾就职于大庆石油管理局，1998 年 6 月-1999 年 10 月曾就职于华为技术有限公司，1999 年 10 月-2000 年 5 月曾就职于深圳市和君创业投资公司，2000 年 5 月-2001 年 9 月曾就职于长城证券有限责任公司投资银行部。2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资一部总经理、投委会委员兼基金经理。自 2007 年 9 月至 2009 年 1 月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2011 年 1 月至 2013 年 6 月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自 2009 年 9 月至 2016 年 9 月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理，自 2017 年 6 月至 2018 年 8 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理，自 2018 年 8 月至 2018 年 11 月任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 8 月至 2019 年 2 月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 4 月至 2022 年 10 月任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航混合

					型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 4 月至今任“长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 2 月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理。
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	-	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，本基金改进了人工智能算法在因子挖掘中的学习框架，为改善不同行情下因子的超额收益表现加大了对抗性数据的训练，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。风格上尽量紧跟基准指数贝塔，行业上的偏离多数控制在 2% 以内，指数内电子、医药、新能源等成长性行业超额收益不错；风格上看组合在小市值与动量方向略有超配，带来了正贡献，稳健战胜了业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额净值增长率为 4.90%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；长城久泰沪深 300 指数 C 基金份额净值增长率为 4.76%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

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应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

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

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	40,098,160.00	29,429,011.66
结算备付金		3,886,020.55	1,928,476.24
存出保证金		234,965.93	326,151.36
交易性金融资产	6.4.7.2	689,859,076.24	475,146,010.97
其中：股票投资		681,006,597.83	468,982,076.31
基金投资		-	-
债券投资		8,852,478.41	6,163,934.66
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		728,912.67	78,079.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		734,807,135.39	506,907,730.06
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 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		-	-
应付清算款		11,977,558.04	9,866,142.36
应付赎回款		678,758.72	482,287.09
应付管理人报酬		496,688.35	411,820.16
应付托管费		101,364.96	84,044.92
应付销售服务费		28,345.86	4,047.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	638,225.57	550,043.46
负债合计		13,920,941.50	11,398,385.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	462,393,919.52	297,247,369.92
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	258,492,274.37	198,261,974.86
净资产合计		720,886,193.89	495,509,344.78
负债和净资产总计		734,807,135.39	506,907,730.06

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 462,393,919.52 份，其中长城久泰沪深 300 指数 A 基金份额总额 331,421,206.97 份，基金份额净值 1.7924 元；长城久泰沪深 300 指数 C 基

金份额总额 130,972,712.55 份，基金份额净值 0.9685 元。

6.2 利润表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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		33,640,654.40	-27,008,265.94
1. 利息收入		56,786.04	73,023.75
其中：存款利息收入	6.4.7.13	56,786.04	73,023.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		30,326,198.70	-73,925,860.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	21,372,225.17	-83,523,906.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	43,678.12	338,259.65
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,910,295.41	9,259,786.60
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	3,104,860.59	46,503,026.15
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	152,809.07	341,544.45
减：二、营业总支出		3,300,967.77	5,371,392.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,625,469.11	4,029,457.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	535,809.98	822,338.19

3. 销售服务费		53,640.15	432,310.80
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		41.23	-
其中：卖出回购金融资产支出		41.23	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	-
8. 其他费用	6.4.7.23	86,007.28	87,286.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,339,686.63	-32,379,658.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,339,686.63	-32,379,658.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		30,339,686.63	-32,379,658.07

6.3 净资产变动表

会计主体：长城久泰沪深 300 指数证券投资基金

本报告期：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	297,247,369.92	-	198,261,974.86	495,509,344.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	297,247,369.92	-	198,261,974.86	495,509,344.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	165,146,549.60	-	60,230,299.51	225,376,849.11
（一）、综合收益总额	-	-	30,339,686.63	30,339,686.63
（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）	165,146,549.60	-	29,890,612.88	195,037,162.48

其中：1. 基金申购款	252,456,483.85	-	79,530,713.51	331,987,197.36
2. 基金赎回款	-87,309,934.25	-	-49,640,100.63	-136,950,034.88
(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	462,393,919.52	-	258,492,274.37	720,886,193.89
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	665,246,401.24	-	155,091,823.08	820,338,224.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	665,246,401.24	-	155,091,823.08	820,338,224.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-44,076,285.25	-	-29,364,725.25	-73,441,010.50
(一)、综合收益总额	-	-	-32,379,658.07	-32,379,658.07
(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）	-44,076,285.25	-	3,014,932.82	-41,061,352.43
其中：1. 基金申购款	267,140,671.31	-	89,102,724.85	356,243,396.16
2. 基金赎回款	-	-	-86,087,792.03	-397,304,748.59
311,216,956.56				
(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	621,170,115.99	-	125,727,097.83	746,897,213.82

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

长城久泰沪深 300 指数证券投资基金（以下简称“本基金”），由长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金更名而成，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字（2004）51 号文《关于同意长城久泰中信标普 300 指数证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人长城基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 5 月 21 日正式生效，首次设立募集规模为 1,512,020,891.32 基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（“招商银行”）。

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

本基金的指数化投资采用分层抽样法，自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日以中信标普 300 指数为跟踪标的指数，即按照中信标普 300 指数的行业配置比例构建投资组合，投资组合中具体

股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。自 2011 年 4 月 1 日起，所跟踪的标的指数变更为沪深 300 指数，并在 2011 年 4 月 20 日前将现有的组合调整为跟踪沪深 300 指数的新组合。股票投资范围以沪深 300 指数的成份股为主，少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票，并基于基本面研究进行有限度的优化调整。在正常情况下，本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90~95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

自基金合同生效日至 2011 年 3 月 31 日本基金的业绩比较基准为：95%×中信标普 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。自 2011 年 4 月 1 日起本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行同业存款利率。

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	40,098,160.00

等于：本金	40,093,783.44
加：应计利息	4,376.56
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	40,098,160.00

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		663,106,800.14	-	681,006,597.83	17,899,797.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,786,426.00	58,288.41	8,852,478.41	7,764.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,786,426.00	58,288.41	8,852,478.41	7,764.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		671,893,226.14	58,288.41	689,859,076.24	17,907,561.69

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

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	1,743.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	552,179.14

其中：交易所市场	552,179.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	638,225.57

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城久泰沪深 300 指数 A

项目	本期	
	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	281,459,794.02	281,459,794.02
本期申购	120,186,283.66	120,186,283.66
本期赎回（以“-”号填列）	-70,224,870.71	-70,224,870.71
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	331,421,206.97	331,421,206.97

长城久泰沪深 300 指数 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	15,787,575.90	15,787,575.90
本期申购	132,270,200.19	132,270,200.19
本期赎回（以“-”号填列）	-17,085,063.54	-17,085,063.54
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	130,972,712.55	130,972,712.55

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

长城久泰沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71,741,861.79	127,711,291.58	199,453,153.37
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	71,741,861.79	127,711,291.58	199,453,153.37
本期利润	23,185,532.44	3,043,367.16	26,228,899.60
本期基金份额交易产生的变动数	18,127,312.23	18,812,239.43	36,939,551.66
其中：基金申购款	38,053,993.30	49,921,889.98	87,975,883.28
基金赎回款	-19,926,681.07	-31,109,650.55	-51,036,331.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,054,706.46	149,566,898.17	262,621,604.63

长城久泰沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	352,711.29	-1,543,889.80	-1,191,178.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	352,711.29	-1,543,889.80	-1,191,178.51
本期利润	4,049,293.60	61,493.43	4,110,787.03
本期基金份额交易产生的变动数	4,455,383.73	-11,504,322.51	-7,048,938.78
其中：基金申购款	5,144,926.72	-13,590,096.49	-8,445,169.77
基金赎回款	-689,542.99	2,085,773.98	1,396,230.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,857,388.62	-12,986,718.88	-4,129,330.26

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	46,477.39
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	6,821.59
其他	3,487.06
合计	56,786.04

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	21,372,225.17
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	21,372,225.17

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	2,799,710,582.87
减：卖出股票成本总额	2,775,434,852.91
减：交易费用	2,903,504.79
买卖股票差价收入	21,372,225.17

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	56,645.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,967.30
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	43,678.12

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	3,844,862.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,798,990.00
减：应计利息总额	58,836.48
减：交易费用	3.45
买卖债券差价收入	-12,967.30

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

注：无。

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	8,910,295.41
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	8,910,295.41

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	3,104,860.59
股票投资	3,083,161.59
债券投资	21,699.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	3,104,860.59

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	152,809.07
合计	152,809.07

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,645.50
存托服务费	59.22
合计	86,007.28

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	-	-	4,921,379,926.06	100.00
东方证券	2,403,227,997.69	41.56	-	-

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	-	-	3,407,954.00	100.00
东方证券	599,800.00	9.27	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

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 （%）
东方证券	470,812.99	41.56	411,609.37	74.54
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	1,210,163.68	100.00	666,247.67	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，本基金的股票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，不通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用。

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	2,625,469.11	4,029,457.07

其中：应支付销售机构的客户维护费	822,986.75	980,294.80
应支付基金管理人的净管理费	1,802,482.36	3,049,162.27

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.98%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.98\%/ \text{当年天数}$

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

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	535,809.98	822,338.19

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.2\%/ \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。

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		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	—	895.79	895.79
招商银行	—	4,662.96	4,662.96
合计	—	5,558.75	5,558.75
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		

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	64,924.34	64,924.34
招商银行	-	92,051.91	92,051.91
合计	-	156,976.25	156,976.25

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。计算方法如下：

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

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

注：无。

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

注：无。

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
招商银行	40,098,160.00	46,477.39	6,876,946.91	44,171.74

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

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

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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-

301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股锁定	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月 (含)	新股锁定-送股	-	77.87	52	-	4,049.24	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个月 (含)	新股锁定-送股	-	45.22	109	-	4,928.98	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	276	12,834.00	11,826.60	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	494	23,351.38	61,335.04	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 07 月 11 日	39.98	1,600	45,802.00	60,880.00	-

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，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 2025 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	40,098,160.00	-	-	-	-	-	40,098,160.00
结算备付金	3,886,020.55	-	-	-	-	-	3,886,020.55
存出保证金	234,965.93	-	-	-	-	-	234,965.93
交易性金融资产	1,113,976.33	-	7,738,502.08	-	-	681,006,597.83	689,859,076.24
应收申购款	-	-	-	-	-	728,912.67	728,912.67
资产总计	45,333,122.81	-	7,738,502.08	-	-	681,735,510.50	734,807,135.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	678,758.72	678,758.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	496,688.35	496,688.35
应付托管费	-	-	-	-	-	101,364.96	101,364.96
应付清算款	-	-	-	-	-	11,977,558.04	11,977,558.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	28,345.86	28,345.86
其他负债	-	-	-	-	-	638,225.57	638,225.57
负债总计	-	-	-	-	-	13,920,941.50	13,920,941.50
利率敏感度缺口	45,333,122.81	-	7,738,502.08	-	-		
上年度末 2024 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	29,429,011.66	-	-	-	-	-	29,429,011.66
结算备付金	1,928,476.24	-	-	-	-	-	1,928,476.24
存出保证金	326,151.36	-	-	-	-	-	326,151.36
交易性金融资产	-	-	6,163,934.66	-	-	468,982,076.31	475,146,010.97
应收申购款	-	-	-	-	-	78,079.83	78,079.83

资产总计	31,683,639.26	-6,163,934.66	-	-	-469,060,156.14	506,907,730.06
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	482,287.09	482,287.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	411,820.16	411,820.16
应付托管费	-	-	-	-	84,044.92	84,044.92
应付清算款	-	-	-	-	9,866,142.36	9,866,142.36
应付销售服务费	-	-	-	-	4,047.26	4,047.26
应交税费	-	-	-	-	0.03	0.03
其他负债	-	-	-	-	550,043.46	550,043.46
负债总计	-	-	-	-	11,398,385.28	11,398,385.28
利率敏感度缺口	31,683,639.26	-6,163,934.66	-	-		

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	10,340.31	7,181.68
	市场利率上升 25 个基点	-10,312.53	-7,161.80

6.4.13.4.2 外汇风险

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。

本基金投资组合的资产配置为：本基金投资于股票的比例为基金净资产的 90-95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

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	681,006,597.83	94.47	468,982,076.31	94.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	8,852,478.41	1.23	6,163,934.66	1.24
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	689,859,076.24	95.70	475,146,010.97	95.89

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%	34,601,945.24	24,295,616.46
	沪深 300 指数下降 5%	-34,601,945.24	-24,295,616.46

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	680,666,431.81	468,696,338.03
第二层次	8,928,743.95	6,196,898.76
第三层次	263,900.48	252,774.18
合计	689,859,076.24	475,146,010.97

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	681,006,597.83	92.68
	其中：股票	681,006,597.83	92.68
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,852,478.41	1.20
	其中：债券	8,852,478.41	1.20
	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	43,984,180.55	5.99
8	其他各项资产	963,878.60	0.13
9	合计	734,807,135.39	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	1,361,848.78	0.19
B	采矿业	49,036,473.07	6.80
C	制造业	241,241,130.69	33.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,218,970.24	1.42
E	建筑业	6,154,174.84	0.85
F	批发和零售业	3,337,784.16	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	28,864,351.81	4.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,101,602.11	1.40
J	金融业	180,458,806.85	25.03
K	房地产业	3,067.72	—
L	租赁和商务服务业	3,720.78	—

M	科学研究和技术服务业	9,123,416.09	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,540,398.72	0.63
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	544,445,745.86	75.52

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	653.60	0.00
B	采矿业	6,070,317.65	0.84
C	制造业	88,010,405.78	12.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,490,287.05	1.73
E	建筑业	4,465.59	0.00
F	批发和零售业	4,501,394.54	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	302,589.41	0.04
H	住宿和餐饮业	621.72	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,255,823.84	1.01
J	金融业	5,936,240.16	0.82
K	房地产业	1,400,678.20	0.19
L	租赁和商务服务业	5,607,547.31	0.78
M	科学研究和技术服务业	79,110.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	3,270,802.90	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,562.06	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,626,352.00	0.23

S	综合	-	-
	合计	136,560,851.97	18.94

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	600519	贵州茅台	21,322	30,053,785.44	4.17
2	000333	美的集团	230,621	16,650,836.20	2.31
3	600036	招商银行	346,888	15,939,503.60	2.21
4	601899	紫金矿业	724,764	14,132,898.00	1.96
5	300750	宁德时代	54,948	13,858,984.56	1.92
6	601398	工商银行	1,594,200	12,099,978.00	1.68
7	601318	中国平安	203,693	11,300,887.64	1.57
8	000063	中兴通讯	300,700	9,769,743.00	1.36
9	600276	恒瑞医药	183,266	9,511,505.40	1.32
10	601919	中远海控	626,540	9,423,161.60	1.31
11	601988	中国银行	1,650,658	9,276,697.96	1.29
12	002736	国信证券	734,300	8,459,136.00	1.17
13	601336	新华保险	133,259	7,795,651.50	1.08
14	601166	兴业银行	333,146	7,775,627.64	1.08
15	605499	东鹏饮料	24,000	7,537,200.00	1.05
16	002028	思源电气	97,821	7,132,129.11	0.99
17	603259	药明康德	102,375	7,120,181.25	0.99
18	000338	潍柴动力	454,800	6,994,824.00	0.97
19	000001	平安银行	566,800	6,841,276.00	0.95
20	601225	陕西煤业	351,499	6,762,840.76	0.94
21	601229	上海银行	630,000	6,684,300.00	0.93
22	002142	宁波银行	242,920	6,646,291.20	0.92
23	601601	中国太保	175,734	6,591,782.34	0.91
24	600809	山西汾酒	36,660	6,466,457.40	0.90
25	002594	比亚迪	19,300	6,405,863.00	0.89
26	000725	京东方 A	1,603,664	6,398,619.36	0.89
27	000408	藏格矿业	146,450	6,249,021.50	0.87
28	601628	中国人寿	147,984	6,095,460.96	0.85
29	601319	中国人保	698,683	6,085,528.93	0.84
30	300014	亿纬锂能	132,800	6,083,568.00	0.84
31	600926	杭州银行	356,122	5,989,972.04	0.83
32	601857	中国石油	690,844	5,906,716.20	0.82

33	600016	民生银行	1, 238, 885	5, 884, 703. 75	0. 82
34	688082	盛美上海	51, 133	5, 826, 094. 02	0. 81
35	601169	北京银行	796, 326	5, 438, 906. 58	0. 75
36	601077	渝农商行	756, 000	5, 397, 840. 00	0. 75
37	601111	中国国航	683, 700	5, 394, 393. 00	0. 75
38	600028	中国石化	924, 940	5, 216, 661. 60	0. 72
39	600900	长江电力	171, 547	5, 170, 426. 58	0. 72
40	600039	四川路桥	521, 940	5, 167, 206. 00	0. 72
41	600377	宁沪高速	336, 400	5, 160, 376. 00	0. 72
42	300124	汇川技术	78, 840	5, 090, 698. 80	0. 71
43	600760	中航沈飞	86, 808	5, 088, 684. 96	0. 71
44	000983	山西焦煤	736, 500	4, 713, 600. 00	0. 65
45	002475	立讯精密	132, 100	4, 582, 549. 00	0. 64
46	600015	华夏银行	576, 549	4, 560, 502. 59	0. 63
47	300015	爱尔眼科	363, 814	4, 540, 398. 72	0. 63
48	600018	上港集团	790, 500	4, 513, 755. 00	0. 63
49	300442	润泽科技	91, 000	4, 507, 230. 00	0. 63
50	000776	广发证券	267, 312	4, 493, 514. 72	0. 62
51	601916	浙商银行	1, 305, 500	4, 425, 645. 00	0. 61
52	000166	申万宏源	874, 646	4, 390, 722. 92	0. 61
53	600160	巨化股份	152, 200	4, 365, 096. 00	0. 61
54	603296	华勤技术	54, 100	4, 364, 788. 00	0. 61
55	002311	海大集团	73, 724	4, 319, 489. 16	0. 60
56	601998	中信银行	504, 305	4, 286, 592. 50	0. 59
57	002916	深南电路	39, 600	4, 269, 276. 00	0. 59
58	003816	中国广核	1, 167, 300	4, 248, 972. 00	0. 59
59	603993	洛阳钼业	477, 100	4, 017, 182. 00	0. 56
60	601898	中煤能源	358, 742	3, 924, 637. 48	0. 54
61	601872	招商轮船	613, 767	3, 842, 181. 42	0. 53
62	000301	东方盛虹	437, 682	3, 645, 891. 06	0. 51
63	002938	鹏鼎控股	108, 600	3, 478, 458. 00	0. 48
64	002600	领益智造	398, 500	3, 423, 115. 00	0. 47
65	600196	复星医药	135, 900	3, 409, 731. 00	0. 47
66	601689	拓普集团	71, 577	3, 382, 013. 25	0. 47
67	000963	华东医药	82, 656	3, 335, 996. 16	0. 46
68	002459	晶澳科技	333, 537	3, 328, 699. 26	0. 46
69	601698	中国卫通	161, 900	3, 314, 093. 00	0. 46
70	000858	五 粮 液	27, 374	3, 254, 768. 60	0. 45
71	000708	中信特钢	268, 590	3, 158, 618. 40	0. 44
72	002463	沪电股份	72, 450	3, 084, 921. 00	0. 43
73	000596	古井贡酒	22, 836	3, 040, 613. 40	0. 42
74	300979	华利集团	54, 227	2, 850, 713. 39	0. 40
75	601818	光大银行	680, 527	2, 824, 187. 05	0. 39

76	601901	方正证券	346,420	2,740,182.20	0.38
77	000100	TCL 科技	483,330	2,092,818.90	0.29
78	601211	国泰海通	109,031	2,089,033.96	0.29
79	300059	东方财富	90,195	2,086,210.35	0.29
80	300347	泰格医药	37,559	2,002,645.88	0.28
81	600030	中信证券	72,408	1,999,908.96	0.28
82	600188	兖矿能源	163,320	1,987,604.40	0.28
83	601658	邮储银行	348,300	1,905,201.00	0.26
84	601288	农业银行	288,531	1,696,562.28	0.24
85	000651	格力电器	36,600	1,644,072.00	0.23
86	601328	交通银行	200,513	1,604,104.00	0.22
87	300502	新易盛	12,408	1,576,064.16	0.22
88	601688	华泰证券	87,253	1,553,975.93	0.22
89	603288	海天味业	36,039	1,402,277.49	0.19
90	002714	牧原股份	32,414	1,361,712.14	0.19
91	600031	三一重工	73,791	1,324,548.45	0.18
92	600919	江苏银行	110,861	1,323,680.34	0.18
93	600482	中国动力	53,100	1,225,017.00	0.17
94	600000	浦发银行	85,932	1,192,736.16	0.17
95	300408	三环集团	35,644	1,190,509.60	0.17
96	300274	阳光电源	17,040	1,154,800.80	0.16
97	002230	科大讯飞	24,100	1,153,908.00	0.16
98	600660	福耀玻璃	19,243	1,097,043.43	0.15
99	601066	中信建投	41,300	993,265.00	0.14
100	688256	寒武纪	1,600	962,400.00	0.13
101	000425	徐工机械	120,426	935,710.02	0.13
102	002001	新 和 成	42,378	901,380.06	0.13
103	300832	新产业	15,600	884,832.00	0.12
104	000538	云南白药	15,500	864,745.00	0.12
105	603799	华友钴业	23,151	857,050.02	0.12
106	600887	伊利股份	30,336	845,767.68	0.12
107	601009	南京银行	72,681	844,553.22	0.12
108	601138	工业富联	39,494	844,381.72	0.12
109	600741	华域汽车	47,746	842,716.90	0.12
110	600183	生益科技	26,882	810,492.30	0.11
111	001289	龙源电力	48,800	789,584.00	0.11
112	300308	中际旭创	5,400	787,644.00	0.11
113	600066	宇通客车	30,800	765,688.00	0.11
114	600989	宝丰能源	46,600	752,124.00	0.10
115	000157	中联重科	103,400	747,582.00	0.10
116	002648	卫星化学	42,999	745,172.67	0.10
117	600460	士兰微	29,900	742,118.00	0.10
118	600690	海尔智家	29,295	725,930.10	0.10

119	600176	中国巨石	63,622	725,290.80	0.10
120	600219	南山铝业	189,296	725,003.68	0.10
121	601117	中国化学	92,052	706,038.84	0.10
122	688008	澜起科技	8,400	688,800.00	0.10
123	000895	双汇发展	28,200	688,362.00	0.10
124	300628	亿联网络	18,934	658,145.84	0.09
125	600061	国投资本	85,572	643,501.44	0.09
126	688041	海光信息	4,475	632,272.75	0.09
127	601766	中国中车	89,200	627,968.00	0.09
128	601808	中海油服	42,500	584,800.00	0.08
129	000977	浪潮信息	11,396	579,828.48	0.08
130	601600	中国铝业	82,040	577,561.60	0.08
131	000975	山金国际	29,900	566,306.00	0.08
132	601088	中国神华	12,000	486,480.00	0.07
133	600958	东方证券	47,856	463,246.08	0.06
134	601127	赛力斯	3,200	429,824.00	0.06
135	601799	星宇股份	3,400	425,000.00	0.06
136	002493	荣盛石化	50,950	421,866.00	0.06
137	601816	京沪高铁	70,200	403,650.00	0.06
138	601699	潞安环能	37,709	397,829.95	0.06
139	688981	中芯国际	4,312	380,189.04	0.05
140	600489	中金黄金	23,000	336,490.00	0.05
141	002371	北方华创	586	259,135.06	0.04
142	300760	迈瑞医疗	868	195,083.00	0.03
143	601868	中国能建	85,070	189,706.10	0.03
144	002352	顺丰控股	2,300	112,148.00	0.02
145	601728	中国电信	13,100	101,525.00	0.01
146	601668	中国建筑	15,115	87,213.55	0.01
147	600332	白云山	2,200	57,992.00	0.01
148	688111	金山办公	157	43,967.85	0.01
149	600111	北方稀土	1,648	41,035.20	0.01
150	600875	东方电气	1,800	30,132.00	0.00
151	600436	片仔癀	150	30,001.50	0.00
152	300033	同花顺	100	27,301.00	0.00
153	688169	石头科技	174	27,239.70	0.00
154	688036	传音控股	199	15,860.30	0.00
155	688271	联影医疗	112	14,306.88	0.00
156	002049	紫光国微	162	10,669.32	0.00
157	600346	恒力石化	654	9,326.04	0.00
158	600309	万华化学	143	7,759.18	0.00
159	002304	洋河股份	115	7,423.25	0.00
160	601021	春秋航空	127	7,067.55	0.00
161	300896	爱美客	40	6,992.40	0.00

162	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.00
163	603833	欧派家居	121	6,830.45	0.00
164	600570	恒生电子	192	6,439.68	0.00
165	000999	华润三九	204	6,381.12	0.00
166	002460	赣锋锂业	180	6,078.60	0.00
167	002466	天齐锂业	185	5,927.40	0.00
168	688187	时代电气	131	5,587.15	0.00
169	600085	同仁堂	136	4,904.16	0.00
170	600893	航发动力	126	4,856.04	0.00
171	000938	紫光股份	174	4,174.26	0.00
172	603392	万泰生物	67	4,087.00	0.00
173	600406	国电南瑞	175	3,921.75	0.00
174	601877	正泰电器	171	3,876.57	0.00
175	002422	科伦药业	100	3,592.00	0.00
176	600009	上海机场	112	3,558.24	0.00
177	688303	大全能源	165	3,517.80	0.00
178	600150	中国船舶	100	3,254.00	0.00
179	300418	昆仑万维	90	3,026.70	0.00
180	000768	中航西飞	110	3,007.40	0.00
181	603260	合盛硅业	62	2,938.80	0.00
182	002415	海康威视	104	2,883.92	0.00
183	600886	国投电力	178	2,623.72	0.00
184	300122	智飞生物	131	2,566.29	0.00
185	600547	山东黄金	76	2,426.68	0.00
186	688126	沪硅产业	129	2,414.88	0.00
187	600362	XD 江西铜	100	2,343.00	0.00
188	002241	歌尔股份	100	2,332.00	0.00
189	601100	恒立液压	32	2,304.00	0.00
190	601881	中国银河	133	2,280.95	0.00
191	600674	川投能源	136	2,181.44	0.00
192	601633	长城汽车	100	2,148.00	0.00
193	000786	北新建材	80	2,118.40	0.00
194	600415	小商品城	100	2,068.00	0.00
195	600999	招商证券	114	2,005.26	0.00
196	600104	上汽集团	124	1,990.20	0.00
197	601878	浙商证券	175	1,909.25	0.00
198	000625	长安汽车	148	1,888.48	0.00
199	601985	中国核电	200	1,864.00	0.00
200	601788	光大证券	100	1,798.00	0.00
201	601607	上海医药	100	1,788.00	0.00
202	000792	盐湖股份	100	1,708.00	0.00
203	002236	大华股份	106	1,683.28	0.00
204	002601	龙佰集团	100	1,621.00	0.00

205	002709	天赐材料	89	1,612.68	0.00
206	601012	隆基绿能	106	1,592.12	0.00
207	600588	用友网络	117	1,564.29	0.00
208	603195	公牛集团	32	1,544.00	0.00
209	300661	圣邦股份	21	1,528.17	0.00
210	300413	芒果超媒	70	1,527.40	0.00
211	688599	天合光能	103	1,496.59	0.00
212	600845	宝信软件	62	1,464.44	0.00
213	002129	TCL 中环	187	1,436.16	0.00
214	002027	分众传媒	193	1,408.90	0.00
215	603369	今世缘	36	1,401.48	0.00
216	300316	晶盛机电	48	1,303.20	0.00
217	600233	圆通速递	100	1,289.00	0.00
218	601186	XD 中国铁	152	1,217.52	0.00
219	600372	中航机载	100	1,206.00	0.00
220	000002	万 科 A	181	1,162.02	0.00
221	001965	招商公路	96	1,152.00	0.00
222	600161	天坛生物	55	1,055.45	0.00
223	600048	保利发展	127	1,028.70	0.00
224	000661	长春高新	10	991.80	0.00
225	601800	中国交建	111	986.79	0.00
226	688009	中国通号	187	961.18	0.00
227	600089	特变电工	80	954.40	0.00
228	000876	新 希 望	100	938.00	0.00
229	688472	阿特斯	100	915.00	0.00
230	300433	蓝思科技	41	914.30	0.00
231	605117	德业股份	17	895.22	0.00
232	601825	沪农商行	91	882.70	0.00
233	600795	国电电力	182	880.88	0.00
234	001979	招商蛇口	100	877.00	0.00
235	000807	云铝股份	54	862.92	0.00
236	600803	XD 新奥股	45	850.50	0.00
237	000568	泸州老窖	7	793.80	0.00
238	601669	中国电建	162	788.94	0.00
239	601377	兴业证券	119	736.61	0.00
240	600023	浙能电力	135	715.50	0.00
241	600011	华能国际	100	714.00	0.00
242	688223	晶科能源	137	711.03	0.00
243	002252	上海莱士	100	687.00	0.00
244	601838	成都银行	34	683.40	0.00
245	601006	大秦铁路	95	627.00	0.00
246	601618	中国中冶	202	601.96	0.00
247	600029	南方航空	100	590.00	0.00

248	300759	康龙化成	24	588.96	0.00
249	002180	纳思达	24	550.56	0.00
250	600050	中国联通	100	534.00	0.00
251	601238	广汽集团	69	516.81	0.00
252	601989	中国重工	100	464.00	0.00
253	600426	华鲁恒升	20	433.40	0.00
254	601390	中国中铁	74	415.14	0.00
255	600115	中国东航	100	403.00	0.00
256	600010	包钢股份	200	358.00	0.00
257	601939	建设银行	36	339.84	0.00
258	000630	铜陵有色	100	334.00	0.00
259	601888	中国中免	4	243.88	0.00
260	600019	宝钢股份	29	191.11	0.00
261	600905	三峡能源	37	157.62	0.00
262	300498	温氏股份	8	136.64	0.00
263	600584	长电科技	4	134.76	0.00
264	603806	福斯特	6	77.76	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	300207	欣旺达	218,902	4,391,174.12	0.61
2	600113	浙江东日	142,500	3,673,650.00	0.51
3	300866	安克创新	32,100	3,646,560.00	0.51
4	300660	江苏雷利	69,280	3,064,947.20	0.43
5	002138	顺络电子	108,700	3,056,644.00	0.42
6	600578	京能电力	641,100	2,878,539.00	0.40
7	603515	欧普照明	158,464	2,850,767.36	0.40
8	601991	大唐发电	880,600	2,791,502.00	0.39
9	689009	九号公司	46,000	2,721,820.00	0.38
10	300070	碧水源	603,400	2,715,300.00	0.38
11	300787	海能实业	171,940	2,381,369.00	0.33
12	003022	联泓新科	148,600	2,352,338.00	0.33
13	002080	中材科技	115,958	2,261,181.00	0.31
14	002841	视源股份	64,166	2,220,143.60	0.31
15	301165	锐捷网络	33,020	2,029,409.20	0.28
16	600298	安琪酵母	55,700	1,958,969.00	0.27
17	600236	桂冠电力	310,630	1,947,650.10	0.27
18	600956	新天绿能	248,500	1,918,420.00	0.27
19	600167	联美控股	303,000	1,702,860.00	0.24
20	002517	恺英网络	85,800	1,656,798.00	0.23
21	300755	华致酒行	84,500	1,630,850.00	0.23
22	000030	富奥股份	276,400	1,627,996.00	0.23

23	688665	四方光电	36,400	1,627,808.00	0.23
24	601928	凤凰传媒	145,600	1,626,352.00	0.23
25	688150	莱特光电	63,700	1,574,664.00	0.22
26	603039	泛微网络	28,000	1,559,600.00	0.22
27	000988	华工科技	33,000	1,551,330.00	0.22
28	002171	楚江新材	159,300	1,549,989.00	0.22
29	300893	松原安全	63,100	1,547,212.00	0.21
30	603737	三棵树	41,615	1,533,512.75	0.21
31	002945	华林证券	105,300	1,513,161.00	0.21
32	000987	越秀资本	220,327	1,511,443.22	0.21
33	000785	居然智家	491,400	1,498,770.00	0.21
34	600329	达仁堂	44,900	1,497,864.00	0.21
35	002821	凯莱英	16,966	1,497,249.50	0.21
36	002831	裕同科技	63,700	1,491,854.00	0.21
37	688553	汇宇制药	91,000	1,482,390.00	0.21
38	688114	华大智造	22,800	1,478,124.00	0.21
39	300558	贝达药业	25,400	1,471,930.00	0.20
40	301376	致欧科技	80,600	1,470,950.00	0.20
41	688677	海泰新光	37,700	1,470,677.00	0.20
42	601958	金钼股份	133,983	1,465,774.02	0.20
43	000959	首钢股份	431,000	1,465,400.00	0.20
44	688220	翱捷科技	18,600	1,456,380.00	0.20
45	002716	湖南白银	371,200	1,447,680.00	0.20
46	301160	翔楼新材	18,000	1,441,440.00	0.20
47	600663	陆家嘴	158,000	1,399,880.00	0.19
48	003006	百亚股份	51,000	1,396,380.00	0.19
49	001203	大中矿业	147,600	1,394,820.00	0.19
50	002174	游族网络	114,400	1,387,672.00	0.19
51	603699	纽威股份	44,100	1,374,597.00	0.19
52	002595	豪迈科技	23,100	1,367,982.00	0.19
53	688819	天能股份	39,355	1,092,494.80	0.15
54	600498	烽火通信	50,300	1,057,809.00	0.15
55	300017	网宿科技	89,200	956,224.00	0.13
56	000426	兴业银锡	58,600	925,880.00	0.13
57	688377	迪威尔	38,200	911,834.00	0.13
58	603638	艾迪精密	51,700	904,233.00	0.13
59	601969	海南矿业	121,400	880,150.00	0.12
60	300765	新诺威	16,400	847,716.00	0.12
61	603050	科林电气	51,100	841,106.00	0.12
62	688161	威高骨科	29,324	785,589.96	0.11
63	601001	晋控煤业	63,600	777,192.00	0.11
64	300803	指南针	9,205	742,475.30	0.10
65	301127	武汉天源	41,460	708,551.40	0.10

66	002414	高德红外	63,921	655,190.25	0.09
67	600685	中船防务	22,700	617,213.00	0.09
68	601555	东吴证券	70,400	616,000.00	0.09
69	002202	金风科技	59,829	613,247.25	0.09
70	002532	天山铝业	72,600	603,306.00	0.08
71	002056	横店东磁	42,600	602,790.00	0.08
72	300373	扬杰科技	11,600	602,040.00	0.08
73	600517	国网英大	116,060	591,906.00	0.08
74	000783	长江证券	85,400	591,822.00	0.08
75	002847	盐津铺子	7,300	586,920.00	0.08
76	000623	吉林敖东	34,400	583,080.00	0.08
77	688122	西部超导	11,147	578,306.36	0.08
78	000513	丽珠集团	16,000	576,640.00	0.08
79	002373	千方科技	61,800	574,740.00	0.08
80	300677	英科医疗	24,200	573,056.00	0.08
81	600583	海油工程	104,100	568,386.00	0.08
82	600299	安迪苏	58,900	568,385.00	0.08
83	603858	步长制药	34,700	563,528.00	0.08
84	600380	健康元	50,900	561,427.00	0.08
85	600998	九州通	109,100	560,774.00	0.08
86	600704	物产中大	105,500	555,985.00	0.08
87	002266	浙富控股	179,281	552,185.48	0.08
88	600483	福能股份	55,800	537,912.00	0.07
89	600062	华润双鹤	28,300	528,078.00	0.07
90	600582	天地科技	86,100	515,739.00	0.07
91	688686	奥普特	5,234	500,475.08	0.07
92	002032	苏泊尔	8,600	450,554.00	0.06
93	002268	电科网安	24,400	446,276.00	0.06
94	600755	厦门国贸	71,300	431,365.00	0.06
95	600166	福田汽车	158,000	428,180.00	0.06
96	000893	亚钾国际	14,000	421,960.00	0.06
97	000050	深天马 A	49,100	418,332.00	0.06
98	301068	大地海洋	11,230	385,189.00	0.05
99	603087	甘李药业	6,800	372,504.00	0.05
100	002603	以岭药业	26,000	366,600.00	0.05
101	001227	兰州银行	146,300	365,750.00	0.05
102	688432	有研硅	29,029	320,480.16	0.04
103	688582	芯动联科	4,598	308,985.60	0.04
104	301004	嘉益股份	4,520	299,359.60	0.04
105	300590	移为通信	22,800	296,628.00	0.04
106	600739	辽宁成大	25,400	279,400.00	0.04
107	300627	华测导航	6,912	241,920.00	0.03
108	002891	中宠股份	3,700	228,919.00	0.03

109	301413	安培龙	2,800	214,060.00	0.03
110	688188	柏楚电子	1,600	210,656.00	0.03
111	001872	招商港口	10,400	206,544.00	0.03
112	603355	莱克电气	8,900	199,538.00	0.03
113	688100	威胜信息	5,307	196,624.35	0.03
114	688213	思特威	1,873	191,458.06	0.03
115	688633	星球石墨	6,868	187,015.64	0.03
116	688318	财富趋势	1,395	160,313.40	0.02
117	002353	杰瑞股份	4,400	154,000.00	0.02
118	601568	北元集团	36,400	151,060.00	0.02
119	688233	神工股份	4,155	132,004.35	0.02
120	688128	中国电研	4,598	112,651.00	0.02
121	603129	春风动力	500	108,250.00	0.02
122	688065	凯赛生物	2,227	104,891.70	0.01
123	300638	广和通	3,440	98,487.20	0.01
124	688091	上海谊众	2,000	93,560.00	0.01
125	600418	江淮汽车	2,200	88,198.00	0.01
126	002625	光启技术	1,700	67,966.00	0.01
127	601866	中远海发	26,100	64,467.00	0.01
128	688775	影石创新	494	61,335.04	0.01
129	688313	仕佳光子	1,600	60,880.00	0.01
130	002128	电投能源	2,800	55,384.00	0.01
131	600499	科达制造	4,700	46,060.00	0.01
132	603589	口子窖	1,300	45,240.00	0.01
133	600563	法拉电子	400	43,636.00	0.01
134	688578	艾力斯	454	42,240.16	0.01
135	300492	华图山鼎	620	42,085.60	0.01
136	000810	创维数字	3,000	35,340.00	0.00
137	688018	乐鑫科技	215	31,411.50	0.00
138	688120	华海清科	158	26,654.60	0.00
139	600004	白云机场	2,900	26,390.00	0.00
140	688696	极米科技	199	22,757.64	0.00
141	688019	安集科技	142	21,555.60	0.00
142	300341	麦克奥迪	1,200	19,416.00	0.00
143	603766	隆鑫通用	1,500	19,140.00	0.00
144	300789	唐源电气	700	18,641.00	0.00
145	688631	莱斯信息	200	17,840.00	0.00
146	688200	华峰测控	121	17,448.20	0.00
147	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
148	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
149	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
150	688198	佰仁医疗	145	14,890.05	0.00
151	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00

152	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
153	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
154	300768	迪普科技	800	13,720.00	0.00
155	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
156	688356	键凯科技	178	12,566.80	0.00
157	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
158	300857	协创数据	140	12,048.40	0.00
159	603049	中策橡胶	276	11,826.60	0.00
160	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
161	688190	云路股份	126	11,662.56	0.00
162	688685	迈信林	200	11,170.00	0.00
163	688278	特宝生物	148	10,672.28	0.00
164	688778	厦钨新能	183	10,233.36	0.00
165	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
166	002487	大金重工	300	9,870.00	0.00
167	688768	容知日新	200	8,878.00	0.00
168	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
169	688080	映翰通	170	8,651.30	0.00
170	688002	睿创微纳	123	8,575.56	0.00
171	600688	上海石化	2,900	8,265.00	0.00
172	688563	航材股份	143	8,098.09	0.00
173	688003	天准科技	175	8,032.50	0.00
174	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
175	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
176	688425	铁建重工	1,843	7,519.44	0.00
177	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
178	688131	皓元医药	150	7,252.50	0.00
179	688063	派能科技	160	7,212.80	0.00
180	688300	联瑞新材	151	7,029.05	0.00
181	688166	博瑞医药	130	6,982.30	0.00
182	603605	珀莱雅	84	6,954.36	0.00
183	688116	天奈科技	147	6,728.19	0.00
184	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
185	688603	天承科技	149	6,585.80	0.00
186	688777	中控技术	140	6,287.40	0.00
187	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
188	301536	星宸科技	100	6,030.00	0.00
189	600724	宁波富达	1,300	5,915.00	0.00
190	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
191	688088	虹软科技	109	5,259.25	0.00
192	688363	华熙生物	102	5,237.70	0.00
193	000423	东阿阿胶	100	5,230.00	0.00
194	688533	上声电子	188	5,062.84	0.00

195	688268	华特气体	100	5,037.00	0.00
196	688232	新点软件	162	4,866.48	0.00
197	688252	天德钰	193	4,705.34	0.00
198	688408	中信博	100	4,668.00	0.00
199	688226	威腾电气	174	4,548.36	0.00
200	000799	酒鬼酒	100	4,399.00	0.00
201	603345	安井食品	52	4,181.84	0.00
202	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
203	688139	海尔生物	128	3,953.92	0.00
204	688561	奇安信	114	3,873.72	0.00
205	688015	交控科技	179	3,730.36	0.00
206	688433	华曙高科	100	3,675.00	0.00
207	688289	圣湘生物	178	3,645.44	0.00
208	603929	亚翔集成	100	3,510.00	0.00
209	688358	祥生医疗	118	3,498.70	0.00
210	688330	宏力达	135	3,466.80	0.00
211	603236	移远通信	40	3,432.00	0.00
212	688248	南网科技	108	3,397.68	0.00
213	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
214	688276	百克生物	155	3,255.00	0.00
215	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
216	688087	英科再生	125	3,212.50	0.00
217	300751	迈为股份	46	3,199.76	0.00
218	688658	悦康药业	163	3,103.52	0.00
219	688202	美迪西	84	3,018.12	0.00
220	688569	铁科轨道	144	2,966.40	0.00
221	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
222	688400	凌云光	100	2,757.00	0.00
223	002294	信立泰	56	2,650.48	0.00
224	600642	申能股份	300	2,580.00	0.00
225	688127	蓝特光学	100	2,571.00	0.00
226	688185	康希诺	41	2,444.83	0.00
227	688057	金达莱	197	2,403.40	0.00
228	603713	密尔克卫	44	2,346.08	0.00
229	301061	匠心家居	30	2,326.20	0.00
230	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
231	300957	贝泰妮	50	2,211.00	0.00
232	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
233	600763	通策医疗	52	2,146.56	0.00
234	300294	博雅生物	82	2,131.18	0.00
235	688179	阿拉丁	167	2,124.24	0.00
236	002987	京北方	96	2,001.60	0.00
237	300769	德方纳米	60	1,981.20	0.00

238	300438	鹏辉能源	69	1,905.09	0.00
239	688678	福立旺	100	1,904.00	0.00
240	688315	诺禾致源	134	1,892.08	0.00
241	688526	科前生物	121	1,885.18	0.00
242	300100	双林股份	40	1,883.20	0.00
243	601869	长飞光纤	45	1,832.40	0.00
244	688772	珠海冠宇	121	1,729.09	0.00
245	603733	仙鹤股份	79	1,638.46	0.00
246	688101	三达膜	115	1,603.10	0.00
247	000887	中鼎股份	90	1,583.10	0.00
248	688505	复旦张江	178	1,541.48	0.00
249	603489	八方股份	56	1,519.84	0.00
250	300595	欧普康视	99	1,511.73	0.00
251	688046	药康生物	100	1,504.00	0.00
252	603659	璞泰来	80	1,502.40	0.00
253	688588	凌志软件	100	1,457.00	0.00
254	002889	东方嘉盛	96	1,440.96	0.00
255	000762	西藏矿业	75	1,438.50	0.00
256	300244	迪安诊断	95	1,415.50	0.00
257	688707	振华新材	98	1,327.90	0.00
258	605168	三人行	45	1,324.35	0.00
259	300852	四会富仕	40	1,290.80	0.00
260	688219	会通股份	100	1,255.00	0.00
261	603688	石英股份	30	1,056.60	0.00
262	600694	大商股份	55	1,020.25	0.00
263	600352	浙江龙盛	100	1,016.00	0.00
264	603127	昭衍新药	48	1,009.44	0.00
265	002410	广联达	75	1,005.75	0.00
266	002756	永兴材料	30	952.50	0.00
267	002911	佛燃能源	90	923.40	0.00
268	300806	斯迪克	55	907.50	0.00
269	601231	环旭电子	62	907.06	0.00
270	002926	华西证券	100	894.00	0.00
271	603613	国联股份	36	852.84	0.00
272	300873	海晨股份	40	807.60	0.00
273	688585	上纬新材	100	778.00	0.00
274	002608	江苏国信	100	733.00	0.00
275	603868	飞科电器	20	717.40	0.00
276	603300	海南华铁	60	669.00	0.00
277	300919	中伟股份	20	657.60	0.00
278	002458	益生股份	80	653.60	0.00
279	601665	齐鲁银行	100	632.00	0.00
280	603218	日月股份	49	621.81	0.00

281	600258	首旅酒店	44	621.72	0.00
282	601128	常熟银行	83	611.71	0.00
283	002372	伟星新材	58	600.88	0.00
284	600256	广汇能源	99	595.98	0.00
285	300390	天华新能	30	572.10	0.00
286	603025	大豪科技	40	560.80	0.00
287	300450	先导智能	22	546.70	0.00
288	002271	东方雨虹	50	536.50	0.00
289	000828	东莞控股	49	523.81	0.00
290	300601	康泰生物	34	516.46	0.00
291	300815	玉禾田	24	493.20	0.00
292	601598	中国外运	100	493.00	0.00
293	600908	无锡银行	73	460.63	0.00
294	002966	苏州银行	50	439.00	0.00
295	300685	艾德生物	20	430.60	0.00
296	601200	上海环境	53	420.82	0.00
297	601666	平煤股份	55	407.55	0.00
298	601000	唐山港	100	406.00	0.00
299	600284	浦东建设	60	396.00	0.00
300	600928	西安银行	100	392.00	0.00
301	688538	和辉光电	162	379.08	0.00
302	601018	宁波港	100	366.00	0.00
303	000657	中钨高新	30	355.80	0.00
304	600826	兰生股份	40	328.00	0.00
305	002061	浙江交科	80	316.80	0.00
306	600008	首创环保	103	311.06	0.00
307	601158	重庆水务	64	296.96	0.00
308	600208	衢州发展	100	296.00	0.00
309	601101	昊华能源	40	289.60	0.00
310	002461	珠江啤酒	25	282.25	0.00
311	600351	亚宝药业	45	273.15	0.00
312	600477	杭萧钢构	100	265.00	0.00
313	601222	林洋能源	45	256.50	0.00
314	300986	志特新材	20	252.00	0.00
315	600368	五洲交通	58	245.92	0.00
316	600901	江苏金租	35	212.10	0.00
317	600639	浦东金桥	20	211.80	0.00
318	000718	苏宁环球	96	208.32	0.00
319	605158	华达新材	24	199.68	0.00
320	603939	益丰药房	7	171.29	0.00
321	300682	朗新集团	7	164.50	0.00
322	600606	绿地控股	99	161.37	0.00
323	600933	爱柯迪	10	160.10	0.00

324	600987	航民股份	22	155.54	0.00
325	000528	柳 工	16	153.76	0.00
326	600251	冠农股份	20	152.60	0.00
327	605399	晨光新材	10	127.80	0.00
328	605366	宏柏新材	20	125.20	0.00
329	600740	山西焦化	30	111.30	0.00
330	002444	巨星科技	4	102.04	0.00
331	601155	新城控股	6	82.08	0.00
332	000090	天健集团	23	81.42	0.00
333	000541	佛山照明	10	63.80	0.00
334	002936	郑州银行	20	41.20	0.00
335	601216	君正集团	6	33.12	0.00
336	603043	广州酒家	2	31.16	0.00
337	000544	中原环保	1	8.13	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	601166	兴业银行	42,991,821.00	8.68
2	000166	申万宏源	31,871,386.88	6.43
3	600519	贵州茅台	31,719,196.00	6.40
4	601899	紫金矿业	30,190,357.00	6.09
5	002142	宁波银行	29,950,584.98	6.04
6	601919	中远海控	27,515,959.00	5.55
7	601601	中国太保	27,393,274.00	5.53
8	600183	生益科技	27,379,774.00	5.53
9	300015	爱尔眼科	26,431,948.85	5.33
10	300408	三环集团	26,350,791.00	5.32
11	688041	海光信息	26,164,874.69	5.28
12	002594	比亚迪	25,342,950.24	5.11
13	002475	立讯精密	25,307,006.00	5.11
14	601336	新华保险	24,946,708.12	5.03
15	601066	中信建投	24,244,014.00	4.89
16	601998	中信银行	24,085,550.00	4.86
17	002736	国信证券	21,853,316.00	4.41
18	605499	东鹏饮料	21,386,478.80	4.32
19	601689	拓普集团	20,831,951.00	4.20
20	000333	美的集团	19,965,072.00	4.03
21	600015	华夏银行	19,753,901.00	3.99
22	002938	鹏鼎控股	19,673,496.00	3.97
23	600346	恒力石化	19,602,035.00	3.96
24	300502	新易盛	19,470,189.53	3.93

25	300979	华利集团	19,453,279.00	3.93
26	600377	宁沪高速	19,333,359.00	3.90
27	600061	国投资本	19,081,082.24	3.85
28	300207	欣旺达	18,981,992.00	3.83
29	601857	中国石油	18,485,508.00	3.73
30	300124	汇川技术	17,960,624.00	3.62
31	603501	豪威集团	17,949,949.00	3.62
32	601211	国泰海通	17,894,506.32	3.61
33	601127	赛力斯	17,397,100.00	3.51
34	601398	工商银行	17,360,180.00	3.50
35	600350	山东高速	16,965,286.00	3.42
36	300433	蓝思科技	16,738,744.00	3.38
37	603288	海天味业	16,437,972.67	3.32
38	000651	格力电器	16,396,543.00	3.31
39	601688	华泰证券	16,082,178.00	3.25
40	002352	顺丰控股	15,994,202.00	3.23
41	601169	北京银行	15,721,222.80	3.17
42	688981	中芯国际	15,645,166.31	3.16
43	688278	特宝生物	15,625,707.02	3.15
44	601138	工业富联	15,620,157.00	3.15
45	600660	福耀玻璃	15,610,026.00	3.15
46	600999	招商证券	15,472,540.00	3.12
47	601088	中国神华	15,456,909.00	3.12
48	000963	华东医药	15,341,451.53	3.10
49	002128	电投能源	15,160,789.00	3.06
50	002916	深南电路	15,043,013.30	3.04
51	000895	双汇发展	15,018,660.30	3.03
52	601898	中煤能源	14,959,977.00	3.02
53	601816	京沪高铁	14,678,368.00	2.96
54	300014	亿纬锂能	14,655,474.00	2.96
55	002415	海康威视	14,652,575.00	2.96
56	601988	中国银行	14,203,914.00	2.87
57	000807	云铝股份	14,074,388.18	2.84
58	002028	思源电气	13,785,474.00	2.78
59	603259	药明康德	13,775,843.00	2.78
60	600031	三一重工	13,564,573.00	2.74
61	600039	四川路桥	13,506,977.73	2.73
62	001965	招商公路	13,359,401.04	2.70
63	000408	藏格矿业	13,346,661.00	2.69
64	688396	华润微	13,210,185.54	2.67
65	601728	中国电信	12,908,534.00	2.61
66	600019	宝钢股份	12,892,835.00	2.60
67	300308	中际旭创	12,653,112.00	2.55

68	601319	中国人保	12,584,811.12	2.54
69	601318	中国平安	12,277,827.00	2.48
70	603195	公牛集团	12,267,918.20	2.48
71	000538	云南白药	11,795,891.00	2.38
72	300750	宁德时代	11,518,632.00	2.32
73	300627	华测导航	11,467,847.73	2.31
74	601288	农业银行	11,128,839.00	2.25
75	600415	小商品城	11,089,151.00	2.24
76	688111	金山办公	11,055,020.92	2.23
77	600276	恒瑞医药	10,709,097.56	2.16
78	600236	桂冠电力	10,672,872.00	2.15
79	688578	艾力斯	10,558,629.11	2.13
80	002371	北方华创	10,546,518.00	2.13
81	600000	浦发银行	10,544,053.00	2.13
82	600028	中国石化	10,458,184.00	2.11
83	000425	徐工机械	10,363,580.00	2.09
84	601818	光大银行	10,352,290.00	2.09
85	600809	山西汾酒	10,340,885.00	2.09
86	603699	纽威股份	10,266,176.00	2.07
87	002493	荣盛石化	10,262,130.00	2.07
88	300033	同花顺	10,240,045.00	2.07
89	300413	芒果超媒	10,188,370.18	2.06
90	000776	广发证券	9,942,787.00	2.01

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	601166	兴业银行	36,977,804.00	7.46
2	600183	生益科技	33,410,276.00	6.74
3	300408	三环集团	32,402,126.09	6.54
4	000166	申万宏源	31,128,143.00	6.28
5	601601	中国太保	30,634,469.00	6.18
6	601919	中远海控	27,473,427.00	5.54
7	688041	海光信息	26,712,450.46	5.39
8	688981	中芯国际	25,647,240.29	5.18
9	601088	中国神华	24,742,710.00	4.99
10	605499	东鹏饮料	24,145,236.00	4.87
11	300433	蓝思科技	23,864,937.00	4.82
12	600346	恒力石化	22,929,015.00	4.63
13	601138	工业富联	22,864,214.00	4.61
14	601066	中信建投	22,696,887.00	4.58
15	002142	宁波银行	22,553,373.00	4.55

16	601336	新华保险	22,293,510.29	4.50
17	300015	爱尔眼科	22,042,383.00	4.45
18	603288	海天味业	21,770,766.00	4.39
19	002475	立讯精密	21,094,288.00	4.26
20	601127	赛力斯	20,736,555.00	4.18
21	002128	电投能源	20,724,718.00	4.18
22	000895	双汇发展	20,039,010.00	4.04
23	300502	新易盛	19,953,710.00	4.03
24	601318	中国平安	19,912,007.00	4.02
25	600019	宝钢股份	19,897,624.00	4.02
26	601998	中信银行	19,613,038.00	3.96
27	300750	宁德时代	19,497,106.00	3.93
28	600015	华夏银行	19,462,805.80	3.93
29	002594	比亚迪	19,055,506.00	3.85
30	600660	福耀玻璃	18,669,792.00	3.77
31	600061	国投资本	18,447,504.00	3.72
32	603501	豪威集团	18,126,716.75	3.66
33	601689	拓普集团	18,120,741.00	3.66
34	300207	欣旺达	17,787,845.00	3.59
35	600000	浦发银行	17,479,573.00	3.53
36	601319	中国人保	17,329,000.00	3.50
37	600350	山东高速	17,116,086.00	3.45
38	300308	中际旭创	17,021,478.60	3.44
39	688396	华润微	16,806,271.02	3.39
40	601688	华泰证券	16,792,166.00	3.39
41	002352	顺丰控股	16,678,343.00	3.37
42	601899	紫金矿业	16,668,793.00	3.36
43	300979	华利集团	16,615,104.76	3.35
44	002938	鹏鼎控股	16,475,085.00	3.32
45	601211	国泰海通	16,225,044.00	3.27
46	000538	云南白药	15,968,886.00	3.22
47	688278	特宝生物	15,591,010.88	3.15
48	600999	招商证券	15,157,656.00	3.06
49	002415	海康威视	14,931,777.00	3.01
50	601728	中国电信	14,911,503.00	3.01
51	601398	工商银行	14,855,904.00	3.00
52	000651	格力电器	14,692,030.00	2.97
53	688336	三生国健	14,642,118.74	2.95
54	601288	农业银行	14,638,618.00	2.95
55	600519	贵州茅台	14,462,232.00	2.92
56	600377	宁沪高速	14,370,476.00	2.90
57	000807	云铝股份	14,294,021.00	2.88
58	601816	京沪高铁	13,976,219.00	2.82

59	002736	国信证券	13,939,359.00	2.81
60	000333	美的集团	13,506,450.00	2.73
61	300627	华测导航	13,294,245.15	2.68
62	300124	汇川技术	13,222,746.00	2.67
63	001965	招商公路	13,220,843.00	2.67
64	688012	中微公司	12,959,388.27	2.62
65	601857	中国石油	12,484,062.00	2.52
66	000963	华东医药	12,363,954.00	2.50
67	688009	中国通号	12,218,296.11	2.47
68	603195	公牛集团	11,932,664.97	2.41
69	600031	三一重工	11,909,582.00	2.40
70	601628	中国人寿	11,492,907.00	2.32
71	600415	小商品城	11,381,755.00	2.30
72	002371	北方华创	11,349,558.00	2.29
73	688578	艾力斯	11,255,898.45	2.27
74	601898	中煤能源	11,106,119.00	2.24
75	002916	深南电路	10,917,792.00	2.20
76	300394	天孚通信	10,911,801.00	2.20
77	600066	宇通客车	10,659,818.00	2.15
78	300033	同花顺	10,645,812.00	2.15
79	688111	金山办公	10,495,587.57	2.12
80	300413	芒果超媒	10,371,363.00	2.09
81	601169	北京银行	10,166,080.21	2.05

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	2,984,376,212.84
卖出股票收入（成交）总额	2,799,710,582.87

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	8,852,478.41	1.23
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	8,852,478.41	1.23

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	019766	25 国债 01	58,000	5,824,982.90	0.81
2	019758	24 国债 21	13,000	1,311,665.10	0.18
3	019749	24 国债 15	11,000	1,113,976.33	0.15
4	019773	25 国债 08	6,000	601,854.08	0.08

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

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

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除中国工商银行股份有限公司发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

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

规定。

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的股票。

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	234,965.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	728,912.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	963,878.60

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)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长城久泰 沪深 300	18,877	17,556.88	128,507,852.21	38.77	202,913,354.76	61.23

指数 A						
长城久泰 沪深 300 指数 C	2, 257	58, 029. 56	118, 298, 868. 05	90. 32	12, 673, 844. 50	9. 68
合计	21, 134	21, 879. 15	246, 806, 720. 26	53. 38	215, 587, 199. 26	46. 62

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	长城久泰沪深 300 指数 A	29, 472. 26	0. 0089
	长城久泰沪深 300 指数 C	116, 947. 22	0. 0893
	合计	146, 419. 48	0. 0317

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

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城久泰沪深 300 指数 A	长城久泰沪深 300 指数 C
基金合同生效日 （2004 年 5 月 21 日）基金份额总额	1, 512, 020, 891. 32	—

本报告期期初基金份额总额	281,459,794.02	15,787,575.90
本报告期基金总申购份额	120,186,283.66	132,270,200.19
减：本报告期基金总赎回份额	70,224,870.71	17,085,063.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	331,421,206.97	130,972,712.55

§ 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 (%)	
东方证券	2	2,403,227,997.69	41.56	470,812.99	41.56	未变更
中信建投	2	2,127,240,208.64	36.78	416,715.71	36.78	未变更
中信证券	2	670,670,973.80	11.60	131,377.56	11.60	未变更
华泰证券	1	489,356,443.70	8.46	95,864.55	8.46	未变更
兴业证券	2	92,409,560.01	1.60	18,103.83	1.60	未变更
长城证券	2	-	-	-	-	未变更
东兴证券	-	-	-	-	-	本期报告退租1个
国海证券	2	-	-	-	-	未变更
国盛证券	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通	1	-	-	-	-	未变更
华安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华源证券	1	-	-	-	-	未变更
银河证券	1	-	-	-	-	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 (%)
东方证券	599,800.00	9.27	-	-	-	-
中信建投	3,775,143.63	58.32	1,000,000.00	100.00	-	-
中信证券	2,098,470.00	32.42	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金开通同一基金不同份额类别相互转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
5	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
6	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）

		20%的时间区 间					
机构	1	20250307- 20250326, 20 250521- 20250630	58, 633, 245. 38	107, 937 , 247. 49	58, 633, 245. 38	107, 93 7, 247. 49	23. 343 1
	2	20250624- 20250630	-	115, 383 , 416. 22	-	115, 38 3, 416. 22	24. 953 5
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） 中国证监会同意长城久泰沪深 300 指数证券投资基金设立的文件
- （二）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金基金合同》
- （三）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》
- （四）《长城久泰沪深 300 指数证券投资基金托管协议》
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会规定的其他文件

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