

长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长城中证 500 指数增强	
基金主代码	006048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 13 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	477,341,056.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006048	007413
报告期末下属分级基金的份额总额	126,960,092.14 份	350,380,964.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以中证 500 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	祝函	王小飞
	联系电话	0755-29279006	021-60637103
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	021-60637228
传真		0755-29279000	021-60635778

注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518046	100033
法定代表人	王军	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、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)	
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	12,013,200.12	31,081,956.22
本期利润	17,710,449.83	45,243,072.97
加权平均基金份 额本期利润	0.1225	0.1004
本期加权平均净 值利润率	7.65%	7.68%
本期基金份额净 值增长率	7.45%	7.29%
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	48,699,618.89	97,398,285.09

期末可供分配基金份额利润	0.3836	0.2780
期末基金资产净值	215,952,969.39	485,925,701.59
期末基金份额净值	1.7010	1.3868
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	70.48%	76.42%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.53%	0.82%	4.09%	0.75%	1.44%	0.07%
过去三个月	3.61%	1.55%	0.97%	1.43%	2.64%	0.12%
过去六个月	7.45%	1.33%	3.21%	1.29%	4.24%	0.04%
过去一年	23.04%	1.59%	18.83%	1.64%	4.21%	-0.05%
过去三年	2.96%	1.26%	-7.61%	1.29%	10.57%	-0.03%
自基金合同生效起至今	70.48%	1.33%	17.70%	1.33%	52.78%	0.00%

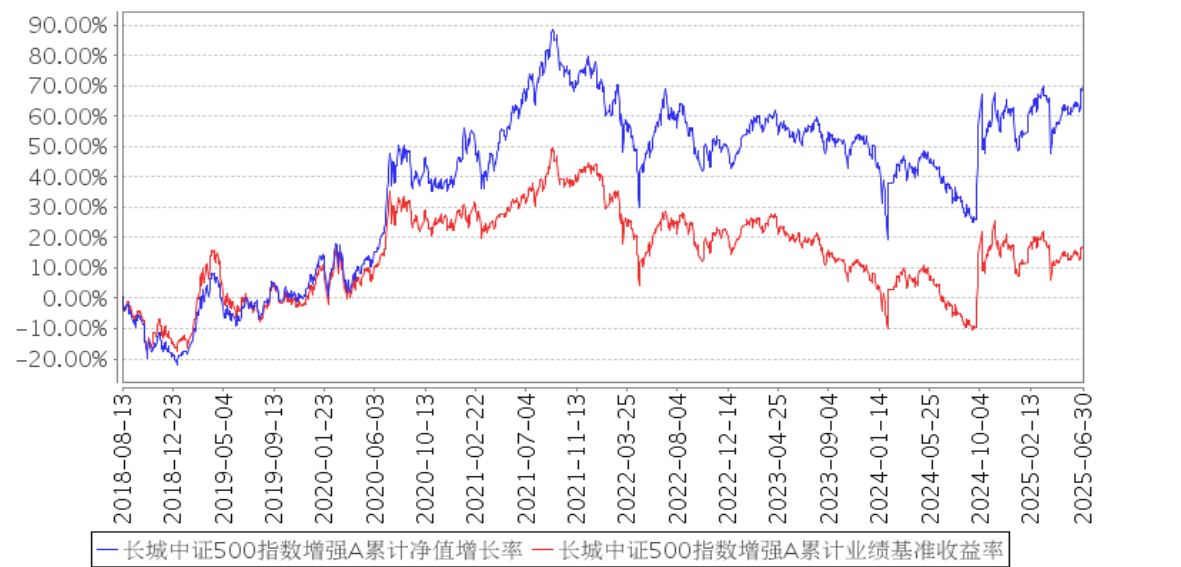
长城中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	5.50%	0.82%	4.09%	0.75%	1.41%	0.07%
过去三个月	3.53%	1.55%	0.97%	1.43%	2.56%	0.12%

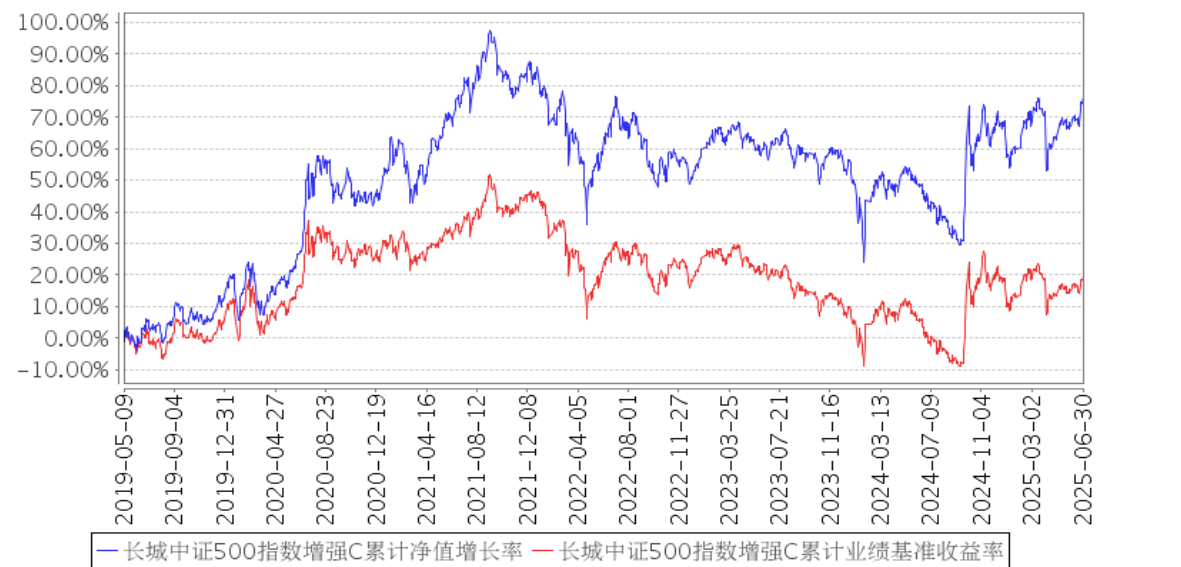
过去六个月	7.29%	1.33%	3.21%	1.29%	4.08%	0.04%
过去一年	22.66%	1.59%	18.83%	1.64%	3.83%	-0.05%
过去三年	2.02%	1.26%	-7.61%	1.29%	9.63%	-0.03%
自基金合同生效 起至今	76.42%	1.30%	19.40%	1.29%	57.02%	0.01%

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

长城中证500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长城中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股

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

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 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	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，基本面因子的角度看组合在价值与低波动风格上适度暴露，兼顾对于基准指数的贝塔跟踪，追求长期超额回报，报告期内稳健战胜了业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城中证 500 指数增强 A 基金份额净值增长率为 7.45%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%；长城中证 500 指数增强 C 基金份额净值增长率为 7.29%，同期业绩比较基准收益率为 3.21%。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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	8,389,273.64	180,811,245.76
结算备付金		4,974,340.18	14,587,615.72
存出保证金		965,636.18	2,252,187.84
交易性金融资产	6.4.7.2	680,927,915.76	988,544,790.17
其中：股票投资		652,793,251.37	935,189,107.25
基金投资		-	-
债券投资		28,134,664.39	53,355,682.92
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	-	-2,352.33
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		8,495,973.91	16,148,462.34
应收股利		-	-
应收申购款		1,372,315.08	290,626.33

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		705,125,454.75	1,202,632,575.83
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		-	37,185,991.51
应付赎回款		1,840,253.68	160,344,889.59
应付管理人报酬		557,550.98	893,762.98
应付托管费		83,632.63	134,064.45
应付销售服务费		116,021.46	197,139.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,881.83	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	644,443.19	792,439.25
负债合计		3,246,783.77	199,548,287.67
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	455,295,561.92	707,251,719.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	246,583,109.06	295,832,568.52
净资产合计		701,878,670.98	1,003,084,288.16
负债和净资产总计		705,125,454.75	1,202,632,575.83

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额总额 477,341,056.82 份，其中长城中证 500 指数增强 A 基金份额总额 126,960,092.14 份，基金份额净值 1.7010 元；长城中证 500 指数增强 C 基金份额总额 350,380,964.68 份，基金份额净值 1.3868 元。

6.2 利润表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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		68,689,624.53	-291,866,822.12
1. 利息收入		44,797.39	204,539.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	41,324.51	201,087.79
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,472.88	3,452.06
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,646,622.78	-314,947,107.61
其中：股票投资收益	6.4.7.14	40,415,242.95	-336,339,704.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	265,226.22	975,556.02
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	431,384.96	-4,202,053.76
股利收益	6.4.7.19	7,534,768.65	24,619,094.24
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	19,858,889.51	22,651,794.90
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	139,314.85	223,950.74
减：二、营业总支出		5,736,101.73	17,690,838.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,085,653.33	12,323,346.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	612,847.95	1,848,501.97
3. 销售服务费		879,738.20	3,273,397.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		21,734.14	12,360.55
其中：卖出回购金融资产支出		21,734.14	12,360.55
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,334.07	-
8. 其他费用	6.4.7.23	133,794.04	233,231.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,953,522.80	-309,557,660.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,953,522.80	-309,557,660.62

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		62,953,522.80	-309,557,660.62

6.3 净资产变动表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	707,251,719.64	-	295,832,568.52	1,003,084,288.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	707,251,719.64	-	295,832,568.52	1,003,084,288.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 251,956,157.72	-	-49,249,459.46	-301,205,617.18
(一)、综合收益总额	-	-	62,953,522.80	62,953,522.80
(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)	- 251,956,157.72	-	- 112,202,982.26	-364,159,139.98
其中：1. 基金申购款	127,466,783.82	-	44,755,841.46	172,222,625.28
2. 基金赎回款	- 379,422,941.54	-	- 156,958,823.72	-536,381,765.26
(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	455,295,561.92	-	246,583,109.06	701,878,670.98
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	3,088,471,613.93	-	804,057,087.26	3,892,528,701.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,088,471,613.93	-	804,057,087.26	3,892,528,701.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,909,304,912.81	-	-568,947,077.71	-2,478,251,990.52
（一）、综合收益总额	-	-	-309,557,660.62	-309,557,660.62
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,909,304,912.81	-	-259,389,417.09	-2,168,694,329.90
其中：1. 基金申购款	309,716,533.83	-	70,145,011.50	379,861,545.33
2. 基金赎回款	-2,219,021,446.64	-	-329,534,428.59	-2,548,555,875.23
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1, 179, 166, 701.12	-	235, 110, 009. 55	1, 414, 276, 710. 67

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

基金管理人负责人

刘沛

主管会计工作负责人

李志朋

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是根据中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”及原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“久兆中小板基金”）基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，由原久兆中小板基金转型而来。原久兆中小板基金为契约型开放式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限不定，首次募集规模为 965, 942, 785. 13 份基金份额。根据深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》，自 2018 年 8 月 6 日起，久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。根据久兆中小板基金基金份额持有人大会的授权，管理人自 2018 年 8 月 6 日至 2018 年 8 月 13 日对久兆中小板基金实施转型与基金份额转换。基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成，久兆中小板基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

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

数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金财产。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2019 年 5 月 9 日发布的《关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金于 2019 年 5 月 9 日起增加 C 类基金份额类别，原份额转为 A 类基金份额。根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别。其中在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，称为 C 类基金份额。增加基金份额类别后，A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。A 类基金份额基金代码为 006048，C 类基金份额基金代码为 007413。

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

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第

3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会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	8,389,273.64
等于：本金	8,388,361.57
加：应计利息	912.07
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	8,389,273.64

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	639,467,715.06	-	652,793,251.37	13,325,536.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	27,965,865.17	148,474.39	28,134,664.39	20,324.83
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	27,965,865.17	148,474.39	28,134,664.39	20,324.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		667,433,580.23	148,474.39	680,927,915.76	13,345,861.14

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	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,501,866.66	-	-	-
其中：股指期货投资	4,501,866.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,501,866.66	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	4.00	4,693,920.00	192,053.34
合计				192,053.34
减：可抵销期货暂收款				192,053.34
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	1,625.90

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	409,668.25
其中：交易所市场	409,668.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	143,888.89
合计	644,443.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A

项目	本期	
	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	172,632,275.81	142,655,656.99
本期申购	13,574,785.01	11,217,659.26
本期赎回（以“-”号填列）	-59,246,968.68	-48,958,719.01
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	126,960,092.14	104,914,597.24

长城中证 500 指数增强 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	564,596,062.65	564,596,062.65
本期申购	116,249,124.56	116,249,124.56
本期赎回（以“-”号填列）	-330,464,222.53	-330,464,222.53
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	350,380,964.68	350,380,964.68

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,319,189.71	78,302,211.28	130,621,400.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	52,319,189.71	78,302,211.28	130,621,400.99
本期利润	12,013,200.12	5,697,249.71	17,710,449.83
本期基金份额交易产生的变动数	-15,632,770.94	-21,660,707.73	-37,293,478.67
其中：基金申购款	4,777,132.99	5,712,170.26	10,489,303.25
基金赎回款	-20,409,903.93	-27,372,877.99	-47,782,781.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,699,618.89	62,338,753.26	111,038,372.15

长城中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	120,957,804.35	44,253,363.18	165,211,167.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	120,957,804.35	44,253,363.18	165,211,167.53
本期利润	31,081,956.22	14,161,116.75	45,243,072.97
本期基金份额交易产生的变动数	-54,641,475.48	-20,268,028.11	-74,909,503.59
其中：基金申购款	27,335,013.78	6,931,524.43	34,266,538.21
基金赎回款	-81,976,489.26	-27,199,552.54	-109,176,041.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,398,285.09	38,146,451.82	135,544,736.91

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	26,794.21
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	6,708.04
其他	7,822.26
合计	41,324.51

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	40,415,242.95
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	40,415,242.95

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	2,767,776,998.47
减：卖出股票成本总额	2,724,628,503.28
减：交易费用	2,733,252.24
买卖股票差价收入	40,415,242.95

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	248,062.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,163.84
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	265,226.22

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	51,704,285.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,152,136.53
减：应计利息总额	534,969.47
减：交易费用	15.43
买卖债券差价收入	17,163.84

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
股指期货投资收益	431,384.96

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	7,534,768.65
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	7,534,768.65

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	19,316,289.17
股票投资	19,367,381.14
债券投资	-51,091.97
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	546,959.12
权证投资	-
期货投资	546,959.12
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	4,358.78
合计	19,858,889.51

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	139,314.85
合计	139,314.85

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	43,888.89

银行费用	645.00
合计	133,794.04

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	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	-	-	4,054,077,762.67	37.80
东方证券	616,412,642.01	11.88	-	-

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	-	-	35,360,247.00	44.83
东方证券	17,375,926.00	33.51	-	-

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	-	-	144,000,000.00	86.75
东方证券	18,596,000.00	6.33	-	-

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	120,746.52	11.88	120,746.52	29.47
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	996,921.88	37.80	-	-
------	------------	-------	---	---

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	4,085,653.33	12,323,346.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	749,657.48	1,218,954.89
应支付基金管理人的净管理费	3,335,995.85	11,104,391.89

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

$$H=E\times 1.00\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	612,847.95	1,848,501.97

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

$$H=E\times 0.15\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期
--	----

获得销售服务费的各关联方名称	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		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	557,105.92	557,105.92
长城证券	-	1,537.61	1,537.61
合计	-	558,643.53	558,643.53
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		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	2,514,503.11	2,514,503.11
长城证券	-	1,726.42	1,726.42
合计	-	2,516,229.53	2,516,229.53

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

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
中国建设银行	8,389,273.64	26,794.21	3,967,577.39	126,704.87

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（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	350	16,275.00	14,997.50	-
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	573	27,085.71	71,143.68	-

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，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约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	8,389,273.64	-	-	-	-	-	8,389,273.64
结算备付金	4,974,340.18	-	-	-	-	-	4,974,340.18
存出保证金	965,636.18	-	-	-	-	-	965,636.18
交易性金融资产	-	-28,134,664.39	-	-	-652,793,251.37	680,927,915.76	
应收申购款	-	-	-	-	-	1,372,315.08	1,372,315.08
应收清算款	-	-	-	-	-	8,495,973.91	8,495,973.91
资产总计	14,329,250.00	-28,134,664.39	-	-	-662,661,540.36	705,125,454.75	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,840,253.68	1,840,253.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	557,550.98	557,550.98
应付托管费	-	-	-	-	-	83,632.63	83,632.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	116,021.46	116,021.46
应交税费	-	-	-	-	-	4,881.83	4,881.83
其他负债	-	-	-	-	-	644,443.19	644,443.19
负债总计	-	-	-	-	-	3,246,783.77	3,246,783.77
利率敏感度 缺口	14,329,250.00	-28,134,664.39	-	-	-		
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	180,811,245.76	-	-	-	-	-	180,811,245.76
结算备付金	14,587,615.72	-	-	-	-	-	14,587,615.72
存出保证金	2,252,187.84	-	-	-	-	-	2,252,187.84
交易性金融资产	-	-53,355,682.92	-	-	-935,189,107.25	988,544,790.17	

买入返售金融资产	-2,352.33	-	-	-	-	-	-2,352.33
应收申购款	-	-	-	-	-	290,626.33	290,626.33
应收清算款	-	-	-	-	-	16,148,462.34	16,148,462.34
资产总计	197,648,696.99	-53,355,682.92	-	-	-951,628,195.92	1,202,632,575.83	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-160,344,889.59	160,344,889.59	
应付管理人报酬	-	-	-	-	893,762.98	893,762.98	
应付托管费	-	-	-	-	134,064.45	134,064.45	
应付清算款	-	-	-	-	37,185,991.51	37,185,991.51	
应付销售服务费	-	-	-	-	197,139.89	197,139.89	
其他负债	-	-	-	-	792,439.25	792,439.25	
负债总计	-	-	-	-	-199,548,287.67	199,548,287.67	
利率敏感度缺口	197,648,696.99	-53,355,682.92	-	-			

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	40,230.90	75,746.35
	市场利率上升 25 个基点	-40,107.63	-75,490.34

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	652,793,251.37	93.01	935,189,107.25	93.23
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	28,134,664.39	4.01	53,355,682.92	5.32
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	680,927,915.76	97.02	988,544,790.17	98.55

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	48,626,569.29	58,210,845.98

	5%		
	沪深 300 指数下降	-48,626,569.29	-58,210,845.98
	5%		

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	652,500,985.81	934,905,604.57
第二层次	28,150,049.93	53,386,411.42
第三层次	276,880.02	252,774.18
合计	680,927,915.76	988,544,790.17

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	652,793,251.37	92.58
	其中：股票	652,793,251.37	92.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,134,664.39	3.99
	其中：债券	28,134,664.39	3.99
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,363,613.82	1.90
8	其他各项资产	10,833,925.17	1.54
9	合计	705,125,454.75	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	-	-
B	采矿业	12,325,240.13	1.76
C	制造业	377,406,595.75	53.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,799,106.25	3.53
E	建筑业	162.52	-
F	批发和零售业	12,114,234.49	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,532,939.81	5.49
J	金融业	55,009,160.93	7.84
K	房地产业	8,755,663.56	1.25
L	租赁和商务服务业	9,353,183.00	1.33
M	科学研究和技术服务业	9,085,479.26	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	3,602,250.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,186,977.61	0.17
S	综合	3,065,668.00	0.44
	合计	555,236,661.31	79.11

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,412,821.60	0.63
C	制造业	55,753,362.85	7.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	969,220.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,093,538.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	2,187,249.48	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,766,239.23	3.10
J	金融业	7,818,183.00	1.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,041,713.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	20,899.30	0.00
N	水利、环境和公	163,243.60	0.02

	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	330,120.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	97,556,590.06	13.90

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	300207	欣旺达	466,414	9,356,264.84	1.33
2	300395	菲利华	176,200	9,003,820.00	1.28
3	002138	顺络电子	307,200	8,638,464.00	1.23
4	300857	协创数据	99,200	8,537,152.00	1.22
5	300024	机器人	496,500	8,529,870.00	1.22
6	002738	中矿资源	259,800	8,355,168.00	1.19
7	002223	鱼跃医疗	234,400	8,344,640.00	1.19
8	300017	网宿科技	775,800	8,316,576.00	1.18
9	300496	中科创达	139,900	8,005,078.00	1.14
10	300373	扬杰科技	153,800	7,982,220.00	1.14
11	600298	安琪酵母	226,298	7,958,900.66	1.13
12	603605	珀莱雅	94,400	7,815,376.00	1.11
13	002821	凯莱英	87,400	7,713,050.00	1.10
14	601958	金钼股份	693,700	7,589,078.00	1.08
15	601155	新城控股	537,100	7,347,528.00	1.05
16	600535	天士力	468,600	7,333,590.00	1.04
17	601577	长沙银行	723,600	7,192,584.00	1.02
18	003022	联泓新科	452,430	7,161,966.90	1.02
19	300390	天华新能	374,600	7,143,622.00	1.02
20	603596	伯特利	135,240	7,125,795.60	1.02
21	600578	京能电力	1,579,000	7,089,710.00	1.01
22	000893	亚钾国际	232,900	7,019,606.00	1.00
23	000932	华菱钢铁	1,554,100	6,838,040.00	0.97
24	002080	中材科技	340,900	6,647,550.00	0.95
25	688281	华秦科技	107,324	6,494,175.24	0.93

26	688582	芯动联科	96,626	6,493,267.20	0.93
27	600153	建发股份	616,200	6,389,994.00	0.91
28	600998	九州通	1,225,500	6,299,070.00	0.90
29	301358	湖南裕能	196,600	6,131,954.00	0.87
30	300140	节能环保	990,700	6,112,619.00	0.87
31	300002	神州泰岳	517,600	6,107,680.00	0.87
32	601555	东吴证券	688,400	6,023,500.00	0.86
33	688772	珠海冠宇	419,896	6,000,313.84	0.85
34	601991	大唐发电	1,859,100	5,893,347.00	0.84
35	603087	甘李药业	106,000	5,806,680.00	0.83
36	002841	视源股份	159,723	5,526,415.80	0.79
37	002203	海亮股份	534,700	5,518,104.00	0.79
38	301165	锐捷网络	89,660	5,510,503.60	0.79
39	603893	瑞芯微	35,800	5,436,588.00	0.77
40	002558	巨人网络	230,100	5,418,855.00	0.77
41	300888	稳健医疗	131,500	5,404,650.00	0.77
42	000060	中金岭南	1,166,000	5,340,280.00	0.76
43	688183	生益电子	100,053	5,122,713.60	0.73
44	600956	新天绿能	662,200	5,112,184.00	0.73
45	601965	中国汽研	286,200	5,080,050.00	0.72
46	000783	长江证券	715,400	4,957,722.00	0.71
47	601665	齐鲁银行	774,300	4,893,576.00	0.70
48	000959	首钢股份	1,401,200	4,764,080.00	0.68
49	002572	索菲亚	334,800	4,690,548.00	0.67
50	300383	光环新网	319,566	4,569,793.80	0.65
51	300073	当升科技	101,603	4,457,323.61	0.64
52	002185	华天科技	423,800	4,280,380.00	0.61
53	300115	长盈精密	199,900	4,277,860.00	0.61
54	002156	通富微电	164,700	4,219,614.00	0.60
55	601231	环旭电子	284,000	4,154,920.00	0.59
56	600109	国金证券	473,300	4,150,841.00	0.59
57	000009	中国宝安	465,300	4,131,864.00	0.59
58	688248	南网科技	127,281	4,004,260.26	0.57
59	002500	山西证券	680,200	3,972,368.00	0.57
60	002850	科达利	35,020	3,963,213.40	0.56
61	600688	上海石化	1,365,200	3,890,820.00	0.55
62	600816	建元信托	1,315,300	3,880,135.00	0.55
63	002414	高德红外	366,800	3,759,700.00	0.54
64	600862	中航高科	144,000	3,755,520.00	0.54
65	688469	芯联集成	778,486	3,713,378.22	0.53
66	300699	光威复材	115,900	3,670,553.00	0.52
67	002056	横店东磁	255,400	3,613,910.00	0.51
68	300070	碧水源	800,500	3,602,250.00	0.51

69	300919	中伟股份	109,400	3,597,072.00	0.51
70	000623	吉林敖东	208,800	3,539,160.00	0.50
71	300627	华测导航	99,720	3,490,200.00	0.50
72	000728	国元证券	437,569	3,452,419.41	0.49
73	600704	物产中大	644,687	3,397,500.49	0.48
74	300142	沃森生物	303,100	3,334,100.00	0.48
75	300595	欧普康视	216,700	3,309,009.00	0.47
76	688819	天能股份	119,090	3,305,938.40	0.47
77	003031	中瓷电子	61,200	3,256,452.00	0.46
78	002273	水晶光电	161,300	3,221,161.00	0.46
79	300677	英科医疗	135,060	3,198,220.80	0.46
80	603341	龙旗科技	78,500	3,189,455.00	0.45
81	000960	锡业股份	207,200	3,170,160.00	0.45
82	600673	东阳光	263,600	3,065,668.00	0.44
83	300001	特锐德	124,800	2,991,456.00	0.43
84	603728	鸣志电器	50,500	2,902,235.00	0.41
85	600098	广州发展	461,493	2,884,331.25	0.41
86	688032	禾迈股份	28,876	2,883,557.36	0.41
87	601158	重庆水务	609,000	2,825,760.00	0.40
88	600906	财达证券	390,100	2,660,482.00	0.38
89	000987	越秀资本	378,200	2,594,452.00	0.37
90	603826	坤彩科技	131,888	2,581,048.16	0.37
91	600498	烽火通信	108,600	2,283,858.00	0.33
92	002532	天山铝业	268,600	2,232,066.00	0.32
93	002152	广电运通	165,700	2,227,008.00	0.32
94	300601	康泰生物	139,446	2,118,184.74	0.30
95	600143	金发科技	199,600	2,057,876.00	0.29
96	603233	大参林	125,000	2,037,500.00	0.29
97	600329	达仁堂	60,483	2,017,712.88	0.29
98	603927	中科软	104,300	2,017,162.00	0.29
99	002926	华西证券	221,500	1,980,210.00	0.28
100	688249	晶合集成	92,740	1,879,839.80	0.27
101	002624	完美世界	120,800	1,832,536.00	0.26
102	603786	科博达	32,700	1,811,907.00	0.26
103	600079	人福医药	85,900	1,802,182.00	0.26
104	600685	中船防务	64,900	1,764,631.00	0.25
105	600808	马钢股份	505,600	1,744,320.00	0.25
106	688172	燕东微	86,185	1,694,397.10	0.24
107	688153	唯捷创芯	53,569	1,661,174.69	0.24
108	300058	蓝色光标	246,900	1,619,664.00	0.23
109	002025	航天电器	31,200	1,603,992.00	0.23
110	000738	航发控制	74,800	1,552,100.00	0.22
111	600166	福田汽车	562,800	1,525,188.00	0.22

112	300573	兴齐眼药	28,800	1,491,552.00	0.21
113	603486	科沃斯	25,500	1,484,865.00	0.21
114	600765	中航重机	87,500	1,477,000.00	0.21
115	600352	浙江龙盛	142,100	1,443,736.00	0.21
116	002756	永兴材料	44,190	1,403,032.50	0.20
117	000785	居然智家	440,500	1,343,525.00	0.19
118	600380	健康元	118,100	1,302,643.00	0.19
119	688188	柏楚电子	9,515	1,252,744.90	0.18
120	688295	中复神鹰	58,727	1,221,521.60	0.17
121	300751	迈为股份	16,456	1,144,679.36	0.16
122	002683	广东宏大	31,400	1,065,716.00	0.15
123	601001	晋控煤业	86,700	1,059,474.00	0.15
124	600925	苏能股份	201,572	1,054,221.56	0.15
125	600801	华新水泥	88,500	1,047,840.00	0.15
126	600517	国网英大	204,400	1,042,440.00	0.15
127	688375	国博电子	17,053	1,023,350.53	0.15
128	002281	光迅科技	20,100	991,332.00	0.14
129	603345	安井食品	11,600	932,872.00	0.13
130	601456	国联民生	89,200	923,220.00	0.13
131	600499	科达制造	91,687	898,532.60	0.13
132	601168	西部矿业	53,639	892,016.57	0.13
133	603228	景旺电子	20,400	853,536.00	0.12
134	000423	东阿阿胶	15,500	810,650.00	0.12
135	600848	上海临港	88,000	798,160.00	0.11
136	000563	陕国投 A	214,700	766,479.00	0.11
137	300285	国瓷材料	43,900	761,665.00	0.11
138	002966	苏州银行	80,929	710,556.62	0.10
139	600435	北方导航	44,200	689,078.00	0.10
140	601918	新集能源	102,900	664,734.00	0.09
141	300476	胜宏科技	4,900	658,462.00	0.09
142	600663	陆家嘴	68,846	609,975.56	0.09
143	002608	江苏国信	82,200	602,526.00	0.09
144	002958	青农商行	164,700	594,567.00	0.08
145	601928	凤凰传媒	51,033	570,038.61	0.08
146	603816	顾家家居	21,800	556,336.00	0.08
147	601717	中创智领	33,433	555,656.46	0.08
148	601568	北元集团	133,460	553,859.00	0.08
149	603156	养元饮品	24,000	507,840.00	0.07
150	600582	天地科技	83,619	500,877.81	0.07
151	688568	中科星图	12,387	446,055.87	0.06
152	600909	华安证券	69,900	407,517.00	0.06
153	000878	云南铜业	31,800	404,496.00	0.06
154	601858	中国科传	20,400	396,780.00	0.06

155	000537	中绿电	46,800	391,248.00	0.06
156	000034	神州数码	10,100	380,164.00	0.05
157	300604	长川科技	8,000	359,280.00	0.05
158	688578	艾力斯	3,532	328,617.28	0.05
159	300136	信维通信	14,200	318,080.00	0.05
160	002673	西部证券	37,866	298,384.08	0.04
161	002409	雅克科技	5,200	284,388.00	0.04
162	688777	中控技术	6,264	281,316.24	0.04
163	002508	老板电器	14,500	275,645.00	0.04
164	600699	均胜电子	13,500	235,440.00	0.03
165	002202	金风科技	22,942	235,155.50	0.03
166	600873	梅花生物	21,450	229,300.50	0.03
167	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.03
168	002595	豪迈科技	2,800	165,816.00	0.02
169	601098	中南传媒	12,300	161,376.00	0.02
170	002472	双环传动	4,200	140,658.00	0.02
171	002008	大族激光	5,000	121,850.00	0.02
172	600901	江苏金租	20,013	121,278.78	0.02
173	600155	华创云信	15,700	109,272.00	0.02
174	600131	国网信通	6,000	106,200.00	0.02
175	300474	景嘉微	1,300	94,900.00	0.01
176	688065	凯赛生物	1,976	93,069.60	0.01
177	000750	国海证券	22,400	92,288.00	0.01
178	301536	星辰科技	1,300	78,390.00	0.01
179	600038	中直股份	1,900	73,739.00	0.01
180	300251	光线传媒	2,900	58,783.00	0.01
181	601128	常熟银行	7,192	53,005.04	0.01
182	300223	北京君正	600	41,520.00	0.01
183	600282	南钢股份	7,700	32,340.00	0.00
184	002078	太阳纸业	800	10,768.00	0.00
185	300037	新宙邦	100	3,520.00	0.00
186	000921	海信家电	101	2,595.70	0.00
187	600096	云天化	100	2,197.00	0.00
188	300529	健帆生物	100	2,157.00	0.00
189	300012	华测检测	100	1,169.00	0.00
190	600516	方大炭素	178	825.92	0.00
191	600170	上海建工	68	162.52	0.00
192	000887	中鼎股份	5	87.95	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	300660	江苏雷利	84,060	3,718,814.40	0.53

2	002625	光启技术	85,500	3,418,290.00	0.49
3	688327	云从科技	241,500	3,330,285.00	0.47
4	002128	电投能源	166,720	3,297,721.60	0.47
5	300768	迪普科技	190,900	3,273,935.00	0.47
6	000686	东北证券	427,000	3,258,010.00	0.46
7	300755	华致酒行	158,600	3,060,980.00	0.44
8	301119	正强股份	83,400	2,949,024.00	0.42
9	300638	广和通	102,100	2,923,123.00	0.42
10	601236	红塔证券	344,900	2,921,303.00	0.42
11	300657	弘信电子	101,500	2,830,835.00	0.40
12	301191	菲菱科思	32,100	2,785,317.00	0.40
13	301202	朗威股份	66,700	2,741,370.00	0.39
14	300590	移为通信	209,300	2,722,993.00	0.39
15	300787	海能实业	195,280	2,704,628.00	0.39
16	301596	瑞迪智驱	30,520	2,668,058.40	0.38
17	300124	汇川技术	40,200	2,595,714.00	0.37
18	300785	值得买	79,300	2,524,119.00	0.36
19	603515	欧普照明	123,800	2,227,162.00	0.32
20	688516	奥特维	57,124	1,898,801.76	0.27
21	002463	沪电股份	41,190	1,753,870.20	0.25
22	300151	昌红科技	129,700	1,596,607.00	0.23
23	688159	有方科技	22,000	1,576,740.00	0.22
24	688058	宝兰德	52,600	1,508,042.00	0.21
25	688512	慧智微	128,900	1,406,299.00	0.20
26	688693	锆威特	42,300	1,396,323.00	0.20
27	301378	通达海	47,200	1,393,816.00	0.20
28	301307	美利信	55,700	1,342,370.00	0.19
29	688662	富信科技	36,700	1,337,715.00	0.19
30	300846	首都在线	68,600	1,334,956.00	0.19
31	688228	开普云	22,400	1,330,112.00	0.19
32	300608	思特奇	114,000	1,326,960.00	0.19
33	301210	金杨股份	31,700	1,316,818.00	0.19
34	688031	星环科技	28,200	1,314,966.00	0.19
35	300603	立昂技术	115,300	1,302,890.00	0.19
36	688071	华依科技	35,300	1,286,685.00	0.18
37	600350	山东高速	118,978	1,268,305.48	0.18
38	300295	三六五网	77,900	1,252,632.00	0.18
39	601628	中国人寿	28,000	1,153,320.00	0.16
40	001203	大中矿业	118,000	1,115,100.00	0.16
41	300071	福石控股	207,100	1,041,713.00	0.15
42	600642	申能股份	112,700	969,220.00	0.14
43	601919	中远海控	61,100	918,944.00	0.13
44	300231	银信科技	64,000	787,840.00	0.11

45	301539	宏鑫科技	29,700	550,044.00	0.08
46	688322	奥比中光	8,476	500,168.76	0.07
47	601336	新华保险	8,300	485,550.00	0.07
48	688553	汇宇制药	29,633	482,721.57	0.07
49	301023	江南奕帆	10,900	476,003.00	0.07
50	300491	通合科技	19,400	370,540.00	0.05
51	300014	亿纬锂能	8,000	366,480.00	0.05
52	688677	海泰新光	9,298	362,714.98	0.05
53	301510	固高科技	12,000	360,600.00	0.05
54	688276	百克生物	17,032	357,672.00	0.05
55	688279	峰岬科技	1,926	357,273.00	0.05
56	688005	容百科技	15,750	351,540.00	0.05
57	300654	世纪天鸿	31,500	330,120.00	0.05
58	688004	博汇科技	12,000	238,800.00	0.03
59	002454	松芝股份	30,700	237,004.00	0.03
60	301008	宏昌科技	10,100	231,492.00	0.03
61	002690	美亚光电	13,000	219,310.00	0.03
62	301030	仕净科技	11,700	205,335.00	0.03
63	301310	鑫宏业	5,300	194,722.00	0.03
64	300866	安克创新	1,485	168,696.00	0.02
65	300877	金春股份	9,700	156,558.00	0.02
66	301448	开创电气	6,100	156,343.00	0.02
67	300912	凯龙高科	9,800	143,962.00	0.02
68	688078	龙软科技	4,203	133,235.10	0.02
69	688691	灿芯股份	2,123	131,328.78	0.02
70	300049	福瑞股份	3,200	103,776.00	0.01
71	301589	诺瓦星云	700	101,731.00	0.01
72	003021	兆威机电	800	86,520.00	0.01
73	300113	顺网科技	4,200	82,992.00	0.01
74	300025	华星创业	11,600	80,504.00	0.01
75	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
76	688135	利扬芯片	2,939	60,866.69	0.01
77	301316	慧博云通	1,400	60,312.00	0.01
78	688737	中自科技	2,769	59,533.50	0.01
79	688680	海优新材	989	43,713.80	0.01
80	300382	斯莱克	2,200	33,462.00	0.00
81	002867	周大生	2,300	30,314.00	0.00
82	301368	丰立智能	400	24,732.00	0.00
83	688701	卓锦股份	2,340	19,281.60	0.00
84	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
85	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
86	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
87	603049	中策橡胶	350	14,997.50	0.00

88	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
89	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
90	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
91	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
92	300357	我武生物	600	12,384.00	0.00
93	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
94	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
95	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
96	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
97	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
98	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
99	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
100	300237	美晨科技	3,100	6,758.00	0.00
101	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
102	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
103	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
104	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
105	300492	华图山鼎	60	4,072.80	0.00
106	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
107	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
108	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
109	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
110	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
111	688390	固德威	26	1,129.70	0.00
112	002268	电科网安	35	640.15	0.00
113	300996	普联软件	40	601.20	0.00
114	600268	国电南自	4	31.28	0.00
115	603327	福蓉科技	3	27.75	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	002625	光启技术	25,184,313.00	2.51
2	601098	中南传媒	23,015,611.00	2.29
3	300001	特锐德	22,545,513.00	2.25
4	002532	天山铝业	20,004,035.00	1.99
5	003022	联泓新科	18,688,746.90	1.86
6	603379	三美股份	18,105,399.51	1.80
7	002850	科达利	18,004,414.00	1.79
8	300751	迈为股份	17,768,901.91	1.77
9	300888	稳健医疗	17,231,803.00	1.72
10	002273	水晶光电	16,825,918.31	1.68

11	300573	兴齐眼药	16,206,903.00	1.62
12	300866	安克创新	16,150,982.56	1.61
13	688005	容百科技	15,934,334.26	1.59
14	603290	斯达半导	15,402,824.20	1.54
15	688153	唯捷创芯	15,168,271.49	1.51
16	603596	伯特利	15,108,870.20	1.51
17	002841	视源股份	15,013,148.00	1.50
18	300207	欣旺达	14,115,598.00	1.41
19	300677	英科医疗	13,785,694.60	1.37
20	603979	金诚信	13,465,634.00	1.34

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	002532	天山铝业	26,249,318.00	2.62
2	002625	光启技术	24,032,260.00	2.40
3	300003	乐普医疗	23,143,880.00	2.31
4	688005	容百科技	23,052,057.07	2.30
5	601098	中南传媒	22,850,483.00	2.28
6	300001	特锐德	21,488,144.00	2.14
7	300012	华测检测	21,041,287.00	2.10
8	002517	恺英网络	19,404,985.00	1.93
9	601168	西部矿业	18,726,225.00	1.87
10	603379	三美股份	18,526,904.00	1.85
11	300207	欣旺达	17,921,289.00	1.79
12	002558	巨人网络	17,875,611.00	1.78
13	603882	金域医学	17,821,864.00	1.78
14	300751	迈为股份	17,784,143.00	1.77
15	601231	环旭电子	17,299,216.00	1.72
16	600873	梅花生物	17,183,605.00	1.71
17	002926	华西证券	16,989,295.00	1.69
18	300677	英科医疗	16,935,442.60	1.69
19	300142	沃森生物	16,927,187.19	1.69
20	600879	航天电子	16,662,936.00	1.66

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	2,422,865,266.26
卖出股票收入（成交）总额	2,767,776,998.47

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	28,134,664.39	4.01
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	28,134,664.39	4.01

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	149,000	14,964,180.22	2.13
2	019773	25 国债 08	80,000	8,024,721.10	1.14
3	019758	24 国债 21	51,000	5,145,763.07	0.73

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

的风险调整后的收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期本基金投资的前十名证券除中矿资源集团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。

中矿资源集团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	965,636.18
2	应收清算款	8,495,973.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,372,315.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,833,925.17

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 (%)
长城中证 500 指数 增强 A	10,668	11,901.02	42,047,224.83	33.12	84,912,867.31	66.88
长城中证 500 指数 增强 C	13,852	25,294.61	316,692,511.13	90.39	33,688,453.55	9.61
合计	24,520	19,467.42	358,739,735.96	75.15	118,601,320.86	24.85

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 （%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	长城中证 500 指数增强 A	92,997.00	0.0732
	长城中证 500 指数增强 C	267,641.49	0.0764
	合计	360,638.49	0.0756

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	0~10
	长城中证 500 指数增强 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	0~10
	长城中证 500 指数增强 C	0
	合计	0~10

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 13 日）基金份额总额	19,420,400.59	—
本报告期期初基金份额总额	172,632,275.81	564,596,062.65
本报告期基金总申购份额	13,574,785.01	116,249,124.56
减：本报告期基金总赎回份额	59,246,968.68	330,464,222.53
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	126,960,092.14	350,380,964.68

§ 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，中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任

陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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 (%)	
长江证券	1	1,258,164,446.06	24.24	246,479.78	24.25	未变更
招商证券股份有限公司	4	1,203,391,812.79	23.19	235,728.71	23.19	未变更
中信证券	1	846,306,087.28	16.31	165,787.14	16.31	未变更
东方证券	2	616,412,642.01	11.88	120,746.52	11.88	未变更
广发证券股份有限公司	1	516,485,635.64	9.95	101,178.47	9.95	未变更

公司						
兴业证券	1	382,816,896 .71	7.38	74,995.59	7.38	未变更
国泰海通	4	365,812,535 .54	7.05	71,654.09	7.05	未变更
财通证券	2	-	-	-	-	未变更
长城证券	6	-	-	-	-	未变更
东吴证券	1	-	-	-	-	未变更
东兴证券	1	-	-	-	-	未变更
方正证券	2	-	-	-	-	未变更
国金证券	2	-	-	-	-	未变更
国投证券	1	-	-	-	-	未变更
国信证券	2	-	-	-	-	未变更
国元证券	1	-	-	-	-	未变更
宏信证券	1	-	-	-	-	未变更
华创证券	1	-	-	-	-	未变更
华福证券	2	-	-	-	-	未变更
华金证券	2	-	-	-	-	未变更
华泰证券	1	-	-	-	-	未变更
华西证券	1	-	-	-	-	本期报告 退租 1 个
华源证券	1	-	-	-	-	未变更
华鑫证券	1	-	-	-	-	未变更
联讯证券	2	-	-	-	-	未变更
民生证券	1	-	-	-	-	未变

						更
平安证券	1	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
山西证券	2	-	-	-	-	未变 更
上海证券	1	-	-	-	-	未变 更
申万宏源	1	-	-	-	-	未变 更
首创证券	1	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
太平洋证 券	2	-	-	-	-	未变 更
天风证券	2	-	-	-	-	未变 更
万和证券	2	-	-	-	-	未变 更
万联证券	2	-	-	-	-	未变 更
五矿证券	2	-	-	-	-	未变 更
西部证券	1	-	-	-	-	未变 更
西南证券	1	-	-	-	-	未变 更
银河证券	2	-	-	-	-	未变 更
粤开证券	2	-	-	-	-	未变 更
中金财富	1	-	-	-	-	未变 更
中金公司	1	-	-	-	-	未变 更
中泰证券	2	-	-	-	-	未变 更
中信建投	1	-	-	-	-	未变 更
中银国际	2	-	-	-	-	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(%)
长江证券	385,676.85	0.74	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	4,694,221.00	9.05	42,000,000.00	14.30	-	-

中信证 券	18,008,180 .00	34.73	185,035,000. 00	63.02	-	-
东方证 券	17,375,926 .00	33.51	18,596,000.0 0	6.33	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	11,388,962 .00	21.96	48,000,000.0 0	16.35	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-

华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于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 2 月 14 日
3	关于长城基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 3 月 20 日
4	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
5	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
6	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
7	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	20250101–20250630	209,482,809.68	–	38,000,000.00	171,482,809.68	35.9246
产品特有风险							
如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：							
1、流动性风险							
本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；							
2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险							
若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资							

者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

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久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的文件
- （二）《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日