

长城中证 A500 指数型证券投资基金 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 17 日（基金合同生效日）起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	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	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
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	长城中证 A500 指数型证券投资基金	
基金简称	长城中证 A500 指数	
基金主代码	022762	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 1 月 17 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	120,572,946.11 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 A500 指数 A	长城中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	022762	022763
报告期末下属分级基金的份额总额	64,057,871.96 份	56,515,074.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证 A500 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。在条件允许的情况下，本基金也可以适当参与中证 A500 指数所包含指数成份股以外的其他个股（非标的指数成份股及备选成份股），以更好地跟踪指数。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）组合复制策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>（2）替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股等进行替代。</p>

	<p>(3) 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>2、债券投资策略 本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券投资。</p> <p>3、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>4、资产支持证券投资策略 基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳健收益。</p> <p>5、存托凭证投资策略 本基金投资存托凭证的策略依照境内上市交易的股票投资策略执行。</p>
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	2025年1月17日（基金合同生效日）-2025年6月30日	
	长城中证 A500 指数 A	长城中证 A500 指数 C
本期已实现收益	2,309,764.77	3,672,112.37
本期利润	2,532,557.07	4,226,020.80
加权平均基金份额 本期利润	0.0211	0.0155
本期加权平均净 值利润率	2.12%	1.56%
本期基金份额净 值增长率	1.57%	1.46%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利 润	1,004,405.44	825,301.31
期末可供分配基 金份额利润	0.0157	0.0146
期末基金资产净 值	65,062,277.40	57,340,375.46
期末基金份额净 值	1.0157	1.0146

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额净值增长率	1.57%	1.46%

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。

④本基金合同于 2025 年 1 月 17 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满六个月。

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 A500 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	3.47%	0.57%	2.68%	0.57%	0.79%	0.00%
过去三个月	2.78%	0.99%	0.83%	1.14%	1.95%	-0.15%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.57%	0.83%	3.69%	1.01%	-2.12%	-0.18%

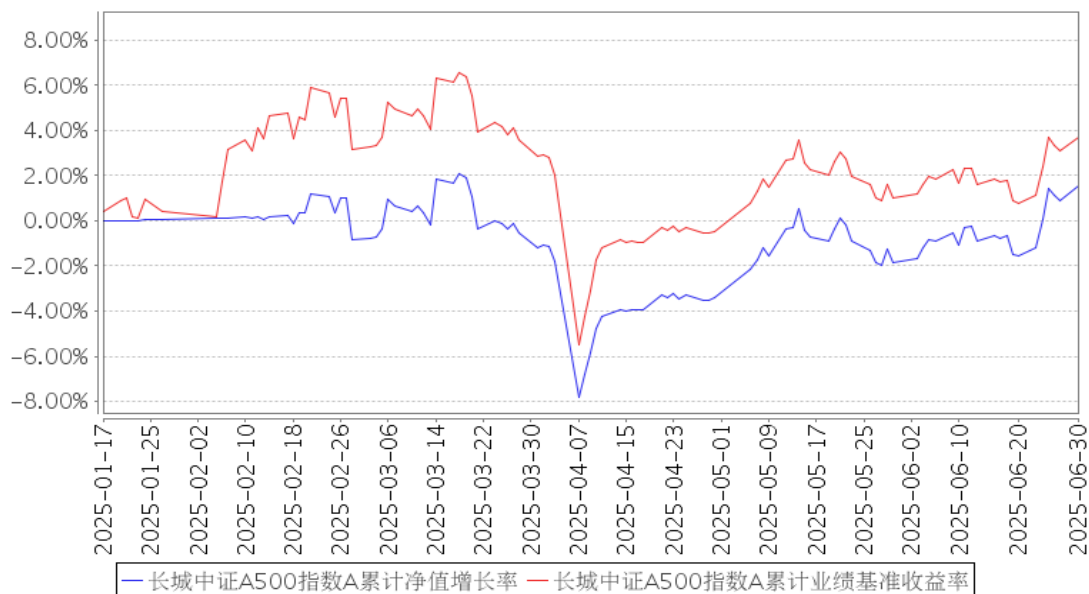
长城中证 A500 指数 C

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	3.46%	0.57%	2.68%	0.57%	0.78%	0.00%
过去三个月	2.71%	0.99%	0.83%	1.14%	1.88%	-0.15%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

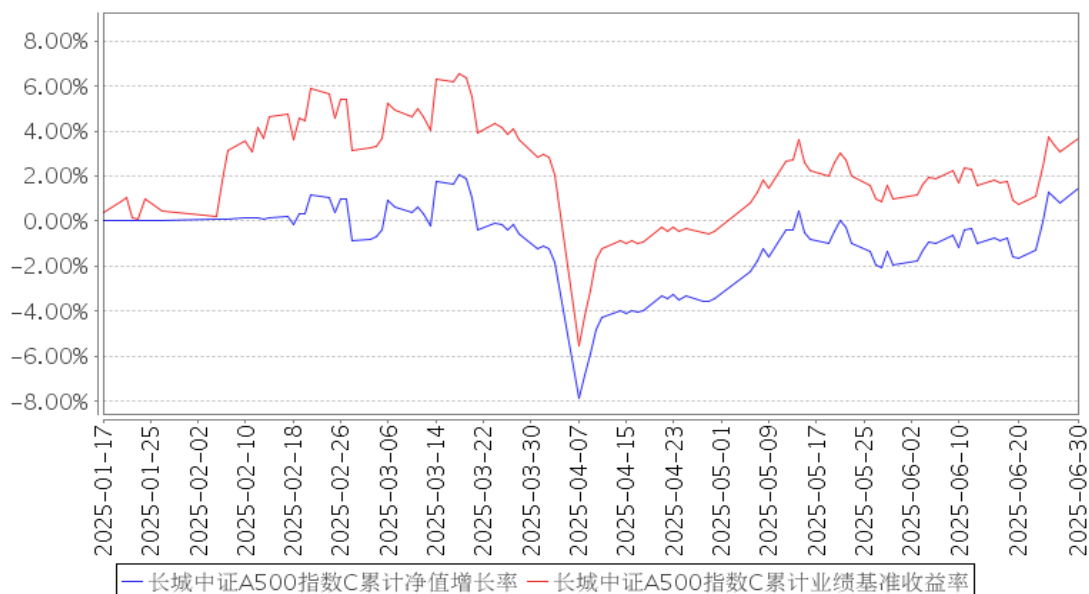
自基金合同生效 起至今	1.46%	0.83%	3.69%	1.01%	-2.23%	-0.18%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

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A500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



长城中证A500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本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓

期内。

③本基金合同于 2025 年 1 月 17 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

§ 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	2025 年 1 月 17 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。
陶曙斌	本基金的基金经理	2025 年 1 月 17 日	-	17 年	男，中国籍，硕士。曾就职于德勤会计师事务所（2005 年 7 月-2008 年 4 月）、南方基金管理股份有限公司（2008 年 4 月-2015 年 12 月）、前海开源基金管理有限公司（2016 年 1 月-2020 年 12 月）、光大保德信基金管理有限公司（2021 年 1 月-2024 年 6 月）。2024 年 6 月加入长城基金管理有限公司。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 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”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

本报告期内，市场延续去年 9 月底以来的预期。整体风格表现分化较大，微盘小盘风格相关资产占优。本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，本基金结合申购赎回情况、标的指数成份股调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。本报告期内完成建仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城中证 A500 指数 A 基金份额净值增长率为 1.57%，同期业绩比较基准收益率为 3.69%；长城中证 A500 指数 C 基金份额净值增长率为 1.46%，同期业绩比较基准收益率为 3.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，在积极政策刺激下，经济整体企稳向好。国内持续保持相对积极的货币财政政策，国债收益率下行，市场利率中枢预计中长期处于较低水平对于 A 股市场有一定促进作用。当前市场整体估值水平仍然处于历史上相对较低的位置，以中证 A500 为代表的宽基具备长期配置价值。

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其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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城中证 A500 指数型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	7,861,490.64
结算备付金		15,191.83
存出保证金		66,438.06
交易性金融资产	6.4.7.2	120,590,612.42
其中：股票投资		114,866,060.26
基金投资		-
债券投资		5,724,552.16
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		2,938,143.63
应收股利		-
应收申购款		5,972.50
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		131,477,849.08
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		8,947,100.96
应付管理人报酬		17,077.22
应付托管费		5,692.39
应付销售服务费		15,122.70
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	90,202.95
负债合计		9,075,196.22
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	120,572,946.11
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	1,829,706.75
净资产合计		122,402,652.86
负债和净资产总计		131,477,849.08

注：本基金合同生效日为 2025 年 01 月 17 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 01 月 17 日起至 2025 年 06 月 30 日止。报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 120,572,946.11 份，其中长城中证 A500 指数 A 基金份额总额 64,057,871.96 份，基金份额净值 1.0157 元；长城中证 A500 指数 C 基金份额总额 56,515,074.15 份，基金份额净值 1.0146 元。

6.2 利润表

会计主体：长城中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,591,448.89
1. 利息收入		3,068,059.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	156,074.57
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		2,911,984.77
其他利息收入		-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,745,964.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,302,145.69
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	29,173.82
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	1,414,644.60
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	776,700.73
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	724.71
减：二、营业总支出		832,871.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	298,214.28
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	99,404.77
3. 销售服务费		354,400.37
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		93.45
其中：卖出回购金融资产支出		93.45
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	80,758.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,758,577.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,758,577.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,758,577.87

6.3 净资产变动表

会计主体：长城中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,794,666,625.68	-	-	1,794,666,625.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,674,093,679.57	-	1,829,706.75	1,672,263,972.82
(一)、综合收益总额	-	-	6,758,577.87	6,758,577.87
(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)	1,674,093,679.57	-	-4,928,871.12	1,679,022,550.69
其中：1. 基金申购款	14,220,799.95	-	-143,876.52	14,076,923.43
2. 基金赎回款	1,688,314,479.52	-	-4,784,994.60	1,693,099,474.12
(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	120,572,946.11	-	1,829,706.75	122,402,652.86

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

长城中证 A500 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2024】1679 号文《关于准予长城中证 A500 指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长城基金管理有限公司作为管理人自 2025 年 1 月 2 日至 2025 年 1 月 15 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第 70015735_H01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 1 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 1,794,499,808.45 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 166,817.23 元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币 1,794,666,625.68 元，折合 1,794,666,625.68 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证 A500 指数的成份股（含存托凭证）及备选成份股（含存托凭证）、其他股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于

基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 \times 95% + 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、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 17 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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	7,861,490.64
等于：本金	7,860,891.21
加：应计利息	599.43
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	7,861,490.64

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	114,101,052.69	-	114,866,060.26	765,007.57	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,682,606.84	30,252.16	5,724,552.16	11,693.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,682,606.84	30,252.16	5,724,552.16	11,693.16
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	119,783,659.53	30,252.16	120,590,612.42	776,700.73	

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,829.80
其中：交易所市场	9,829.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	28,366.80
预提信息披露费	52,006.35
合计	90,202.95

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证 A500 指数 A

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	344,439,876.16	344,439,876.16
本期申购	4,653,506.57	4,653,506.57
本期赎回（以“-”号填列）	-285,035,510.77	-285,035,510.77
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	64,057,871.96	64,057,871.96

长城中证 A500 指数 C

项目	本期 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,450,226,749.52	1,450,226,749.52
本期申购	9,567,293.38	9,567,293.38
本期赎回（以“-”号填列）	-1,403,278,968.75	-1,403,278,968.75
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	56,515,074.15	56,515,074.15

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

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 A500 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,309,764.77	222,792.30	2,532,557.07
本期基金份额交易产生的变动数	-702,747.14	-825,404.49	-1,528,151.63
其中：基金申购款	17,845.57	-17,244.95	600.62
基金赎回款	-720,592.71	-808,159.54	-1,528,752.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,607,017.63	-602,612.19	1,004,405.44

长城中证 A500 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,672,112.37	553,908.43	4,226,020.80
本期基金份额交易产生的变动数	-2,314,439.68	-1,086,279.81	-3,400,719.49
其中：基金申购款	102,641.03	-247,118.17	-144,477.14
基金赎回款	-2,417,080.71	-839,161.64	-3,256,242.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,357,672.69	-532,371.38	825,301.31

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
活期存款利息收入	144,753.01
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	11,249.91
其他	71.65
合计	156,074.57

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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,302,145.69
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	2,302,145.69

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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日

卖出股票成交总额	125,866,905.10
减：卖出股票成本总额	123,407,410.96
减：交易费用	157,348.45
买卖股票差价收入	2,302,145.69

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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	24,054.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,119.15
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	29,173.82

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17日（基金合同生效日）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	8,819,125.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,788,302.16
减：应计利息总额	25,703.56
减：交易费用	0.77
买卖债券差价收入	5,119.15

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 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,414,644.60
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	1,414,644.60

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 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

1. 交易性金融资产	776,700.73
股票投资	765,007.57
债券投资	11,693.16
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	776,700.73

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至 2025年6月30日
基金赎回费收入	724.71
合计	724.71

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17日（基金合同生效日）至2025 年6月30日
审计费用	28,366.80
信息披露费	52,006.35
证券出借违约金	-
银行费用	385.00
合计	80,758.15

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17日(基金合同生效日)至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
东方证券	4,311,080.97	1.19

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

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17日(基金合同生效日)至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
东方证券	3,075,800,000.00	43.97

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17日（基金合同生效日）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	844.59	1.19	844.59	8.59

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17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	298,214.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	144,241.36
应支付基金管理人的净管理费	153,972.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	99,404.77

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 17 日（基金合同生效日）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 A500 指数 A	长城中证 A500 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	1.08	1.08
长城证券	-	0.27	0.27
中国建设银行	-	349,700.93	349,700.93
合计	-	349,702.28	349,702.28

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。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 17 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,861,490.64	144,753.01

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	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	125	3,325.00	10,312.50	-
301665	泰禾股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	384	3,943.68	8,597.76	-
603014	威	2025	6 个月	新股	26.50	32.68	74	1,961.00	2,418.32	-

	高血净	年5月12日		锁定						
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	-
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	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	新股锁定	22.77	39.33	193	4,394.61	7,590.69	-
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	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股锁定	47.27	124.16	119	5,625.13	14,775.04	-

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,并按照合约规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	7,861,490.64	-	-	-	-	-	7,861,490.64
结算备付金	15,191.83	-	-	-	-	-	15,191.83
存出保证金	66,438.06	-	-	-	-	-	66,438.06
交易性金融资产	-	-5,724,552.16	-	-	-114,866,060.26	-	120,590,612.42
应收申购款	-	-	-	-	-	5,972.50	5,972.50
应收清算款	-	-	-	-	-	2,938,143.63	2,938,143.63
资产总计	7,943,120.53	-5,724,552.16	-	-	-117,810,176.39	-	131,477,849.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,947,100.96	8,947,100.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,077.22	17,077.22
应付托管费	-	-	-	-	-	5,692.39	5,692.39
应付销售服务	-	-	-	-	-	15,122.70	15,122.70

费							
其他负债	-	-	-	-	-	90,202.95	90,202.95
负债总计	-	-	-	-	-	9,075,196.22	9,075,196.22
利率敏感度缺口	7,943,120.53	-5,724,552.16	-	-	-		

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）
	市场利率下降 25 个基点	7,757.23
	市场利率上升 25 个基点	-7,736.27

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。于本期末及上年度末，本基金无以外币计价的资产和负债，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资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货

货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金于本期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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	114,866,060.26	93.84
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,724,552.16	4.68
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	120,590,612.42	98.52

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）
	沪深 300 指数上升 5%	6,139,590.92
	沪深 300 指数下降 5%	-6,139,590.92

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
第一层次	114,801,122.50
第二层次	5,724,552.16
第三层次	64,937.76
合计	120,590,612.42

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	114,866,060.26	87.37
	其中：股票	114,866,060.26	87.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,724,552.16	4.35
	其中：债券	5,724,552.16	4.35
	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	7,876,682.47	5.99
8	其他各项资产	3,010,554.19	2.29
9	合计	131,477,849.08	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	622,556.00	0.51
B	采矿业	5,767,985.00	4.71
C	制造业	67,162,662.93	54.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,546,252.82	2.90
E	建筑业	2,186,306.00	1.79
F	批发和零售业	804,192.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	4,029,791.00	3.29
H	住宿和餐饮业	99,654.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,405,210.15	6.05
J	金融业	18,405,369.00	15.04
K	房地产业	1,067,454.00	0.87
L	租赁和商务服务业	1,234,706.60	1.01
M	科学研究和技术服务业	1,279,711.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	257,058.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	75,582.00	0.06
Q	卫生和社会工作	442,246.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	357,021.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	114,743,757.50	93.74

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	-	-
C	制造业	54,388.26	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,480.00	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,520.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	16,826.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,844.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	122,302.76	0.10

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	3,200	4,510,464.00	3.68
2	300750	宁德时代	13,300	3,354,526.00	2.74
3	601318	中国平安	52,900	2,934,892.00	2.40
4	600036	招商银行	63,700	2,927,015.00	2.39
5	601166	兴业银行	81,700	1,906,878.00	1.56
6	600900	长江电力	61,800	1,862,652.00	1.52
7	000333	美的集团	24,500	1,768,900.00	1.45
8	601899	紫金矿业	84,900	1,655,550.00	1.35
9	002594	比亚迪	4,700	1,559,977.00	1.27
10	300059	东方财富	63,800	1,475,694.00	1.21
11	600030	中信证券	49,600	1,369,952.00	1.12
12	601398	工商银行	170,500	1,294,095.00	1.06
13	600276	恒瑞医药	23,000	1,193,700.00	0.98
14	000858	五粮液	9,800	1,165,220.00	0.95
15	000651	格力电器	22,900	1,028,668.00	0.84
16	601328	交通银行	127,800	1,022,400.00	0.84
17	601288	农业银行	160,300	942,564.00	0.77
18	600887	伊利股份	32,300	900,524.00	0.74
19	002475	立讯精密	25,600	888,064.00	0.73
20	688981	中芯国际	9,900	872,883.00	0.71
21	601816	京沪高铁	151,400	870,550.00	0.71
22	603259	药明康德	12,400	862,420.00	0.70
23	600919	江苏银行	69,500	829,830.00	0.68
24	600000	浦发银行	58,200	807,816.00	0.66
25	002371	北方华创	1,700	751,757.00	0.61
26	000725	京东方 A	187,600	748,524.00	0.61
27	300760	迈瑞医疗	3,200	719,200.00	0.59
28	300308	中际旭创	4,600	670,956.00	0.55
29	688256	寒武纪	1,100	661,650.00	0.54
30	601088	中国神华	16,300	660,802.00	0.54
31	300502	新易盛	5,120	650,342.40	0.53
32	601601	中国太保	16,800	630,168.00	0.51
33	688041	海光信息	4,430	625,914.70	0.51
34	601728	中国电信	77,000	596,750.00	0.49
35	002352	顺丰控股	11,900	580,244.00	0.47
36	002714	牧原股份	13,600	571,336.00	0.47
37	601668	中国建筑	98,800	570,076.00	0.47
38	300124	汇川技术	8,700	561,759.00	0.46

39	000001	平安银行	46,100	556,427.00	0.45
40	601127	赛力斯	4,100	550,712.00	0.45
41	603501	豪威集团	4,300	548,895.00	0.45
42	002230	科大讯飞	11,300	541,044.00	0.44
43	600031	三一重工	29,500	529,525.00	0.43
44	000063	中兴通讯	16,000	519,840.00	0.42
45	002415	海康威视	18,600	515,778.00	0.42
46	600309	万华化学	9,500	515,470.00	0.42
47	603019	中科曙光	7,200	506,880.00	0.41
48	600941	中国移动	4,500	506,475.00	0.41
49	601857	中国石油	58,400	499,320.00	0.41
50	300274	阳光电源	7,300	494,721.00	0.40
51	601919	中远海控	31,900	479,776.00	0.39
52	600690	海尔智家	19,100	473,298.00	0.39
53	600660	福耀玻璃	8,300	473,183.00	0.39
54	688008	澜起科技	5,573	456,986.00	0.37
55	601012	隆基绿能	30,100	452,102.00	0.37
56	600406	国电南瑞	19,900	445,959.00	0.36
57	601766	中国中车	62,200	437,888.00	0.36
58	603986	兆易创新	3,400	430,202.00	0.35
59	000338	潍柴动力	27,800	427,564.00	0.35
60	600028	中国石化	75,100	423,564.00	0.35
61	000100	TCL 科技	97,200	420,876.00	0.34
62	000568	泸州老窖	3,700	419,580.00	0.34
63	600050	中国联通	78,200	417,588.00	0.34
64	300476	胜宏科技	3,100	416,578.00	0.34
65	688012	中微公司	2,175	396,502.50	0.32
66	601985	中国核电	42,400	395,168.00	0.32
67	601225	陕西煤业	20,000	384,800.00	0.31
68	601988	中国银行	67,700	380,474.00	0.31
69	601006	大秦铁路	57,600	380,160.00	0.31
70	600104	上汽集团	23,200	372,360.00	0.30
71	600150	中国船舶	11,200	364,448.00	0.30
72	688111	金山办公	1,300	364,065.00	0.30
73	300033	同花顺	1,300	354,913.00	0.29
74	601628	中国人寿	8,600	354,234.00	0.29
75	605499	东鹏饮料	1,100	345,455.00	0.28
76	600418	江淮汽车	8,600	344,774.00	0.28
77	002027	分众传媒	46,900	342,370.00	0.28
78	000425	徐工机械	42,600	331,002.00	0.27
79	600760	中航沈飞	5,600	328,272.00	0.27
80	688271	联影医疗	2,557	326,631.18	0.27
81	000792	盐湖股份	19,100	326,228.00	0.27

82	603288	海天味业	8,300	322,953.00	0.26
83	600436	片仔癀	1,600	320,016.00	0.26
84	600111	北方稀土	12,600	313,740.00	0.26
85	000625	长安汽车	24,500	312,620.00	0.26
86	600905	三峡能源	71,957	306,536.82	0.25
87	600089	特变电工	25,400	303,022.00	0.25
88	603993	洛阳钼业	35,900	302,278.00	0.25
89	002625	光启技术	7,500	299,850.00	0.24
90	601888	中国中免	4,900	298,753.00	0.24
91	601390	中国中铁	52,700	295,647.00	0.24
92	002463	沪电股份	6,900	293,802.00	0.24
93	600048	保利发展	36,200	293,220.00	0.24
94	002050	三花智控	11,100	292,818.00	0.24
95	600547	山东黄金	9,100	290,563.00	0.24
96	601600	中国铝业	41,100	289,344.00	0.24
97	002241	歌尔股份	12,400	289,168.00	0.24
98	600019	宝钢股份	43,800	288,642.00	0.24
99	300014	亿纬锂能	6,300	288,603.00	0.24
100	300015	爱尔眼科	23,100	288,288.00	0.24
101	601658	邮储银行	52,600	287,722.00	0.24
102	600938	中国海油	10,200	266,322.00	0.22
103	601989	中国重工	57,100	264,944.00	0.22
104	600415	小商品城	12,800	264,704.00	0.22
105	000977	浪潮信息	5,200	264,576.00	0.22
106	002384	东山精密	7,000	264,390.00	0.22
107	603799	华友钴业	7,100	262,842.00	0.21
108	002179	中航光电	6,400	258,304.00	0.21
109	600893	航发动力	6,700	258,218.00	0.21
110	600585	海螺水泥	12,000	257,640.00	0.21
111	000538	云南白药	4,600	256,634.00	0.21
112	600570	恒生电子	7,600	254,904.00	0.21
113	000988	华工科技	5,200	244,452.00	0.20
114	600584	长电科技	7,200	242,568.00	0.20
115	000938	紫光股份	10,000	239,900.00	0.20
116	601727	上海电气	31,900	235,741.00	0.19
117	002028	思源电气	3,100	226,021.00	0.18
118	600438	通威股份	13,400	224,450.00	0.18
119	002049	紫光国微	3,400	223,924.00	0.18
120	300433	蓝思科技	10,000	223,000.00	0.18
121	601669	中国电建	45,300	220,611.00	0.18
122	000002	万科 A	34,000	218,280.00	0.18
123	300408	三环集团	6,500	217,100.00	0.18
124	600489	中金黄金	14,500	212,135.00	0.17

125	600988	赤峰黄金	8,300	206,504.00	0.17
126	600010	宝钢股份	115,300	206,387.00	0.17
127	600009	上海机场	6,400	203,328.00	0.17
128	300339	润和软件	4,000	203,320.00	0.17
129	601689	拓普集团	4,300	203,175.00	0.17
130	600795	国电电力	41,600	201,344.00	0.16
131	002456	欧菲光	16,900	200,265.00	0.16
132	300394	天孚通信	2,500	199,600.00	0.16
133	002460	赣锋锂业	5,900	199,243.00	0.16
134	600160	巨化股份	6,800	195,024.00	0.16
135	601100	恒立液压	2,700	194,400.00	0.16
136	002252	上海莱士	27,900	191,673.00	0.16
137	688036	传音控股	2,358	187,932.60	0.15
138	000768	中航西飞	6,800	185,912.00	0.15
139	601186	XD 中国铁	23,200	185,832.00	0.15
140	000963	华东医药	4,600	185,656.00	0.15
141	600989	宝丰能源	11,400	183,996.00	0.15
142	600183	生益科技	6,100	183,915.00	0.15
143	002422	科伦药业	5,000	179,600.00	0.15
144	600839	四川长虹	18,400	178,848.00	0.15
145	000157	中联重科	24,600	177,858.00	0.15
146	601360	三六零	17,400	177,480.00	0.14
147	600115	中国东航	44,000	177,320.00	0.14
148	601058	赛轮轮胎	13,400	175,808.00	0.14
149	002074	国轩高科	5,400	175,284.00	0.14
150	000408	藏格矿业	4,100	174,947.00	0.14
151	600886	国投电力	11,800	173,932.00	0.14
152	002466	天齐锂业	5,400	173,016.00	0.14
153	002001	新 和 成	8,100	172,287.00	0.14
154	688617	惠泰医疗	580	172,260.00	0.14
155	002517	恺英网络	8,800	169,928.00	0.14
156	600066	宇通客车	6,800	169,048.00	0.14
157	000661	长春高新	1,700	168,606.00	0.14
158	000807	云铝股份	10,400	166,192.00	0.14
159	688169	石头科技	1,060	165,943.00	0.14
160	601800	中国交建	18,500	164,465.00	0.13
161	688235	百济神州	700	163,548.00	0.13
162	600196	复星医药	6,500	163,085.00	0.13
163	002340	格林美	25,600	162,560.00	0.13
164	002195	岩山科技	28,600	161,018.00	0.13
165	600426	华鲁恒升	7,400	160,358.00	0.13
166	600029	南方航空	27,000	159,300.00	0.13
167	301236	软通动力	2,900	158,456.00	0.13

168	001979	招商蛇口	18,000	157,860.00	0.13
169	002558	巨人网络	6,700	157,785.00	0.13
170	002916	深南电路	1,460	157,402.60	0.13
171	002236	大华股份	9,900	157,212.00	0.13
172	000975	山金国际	8,300	157,202.00	0.13
173	600346	恒力石化	11,000	156,860.00	0.13
174	601868	中国能建	70,200	156,546.00	0.13
175	002156	通富微电	6,100	156,282.00	0.13
176	600674	川投能源	9,700	155,588.00	0.13
177	002920	德赛西威	1,500	153,195.00	0.13
178	600487	亨通光电	10,000	153,000.00	0.12
179	300661	圣邦股份	2,100	152,817.00	0.12
180	600011	华能国际	21,400	152,796.00	0.12
181	601111	中国国航	19,300	152,277.00	0.12
182	300251	光线传媒	7,400	149,998.00	0.12
183	688126	沪硅产业	7,993	149,628.96	0.12
184	300418	昆仑万维	4,400	147,972.00	0.12
185	600745	闻泰科技	4,400	147,532.00	0.12
186	002648	卫星化学	8,500	147,305.00	0.12
187	300207	欣旺达	7,300	146,438.00	0.12
187	600460	士兰微	5,900	146,438.00	0.12
188	600372	中航机载	12,100	145,926.00	0.12
189	600096	云天化	6,600	145,002.00	0.12
190	600741	华域汽车	8,200	144,730.00	0.12
191	601021	春秋航空	2,600	144,690.00	0.12
192	601168	西部矿业	8,700	144,681.00	0.12
193	300347	泰格医药	2,700	143,964.00	0.12
194	000066	中国长城	9,700	143,560.00	0.12
195	600219	南山铝业	37,400	143,242.00	0.12
196	300782	卓胜微	2,000	142,740.00	0.12
197	002273	水晶光电	7,100	141,787.00	0.12
198	003816	中国广核	38,800	141,232.00	0.12
199	002465	海格通信	10,100	140,794.00	0.12
200	302132	中航成飞	1,600	140,704.00	0.11
201	000786	北新建材	5,300	140,344.00	0.11
202	300896	爱美客	800	139,848.00	0.11
203	601117	中国化学	18,200	139,594.00	0.11
204	002185	华天科技	13,800	139,380.00	0.11
205	600879	航天电子	13,200	138,204.00	0.11
206	002601	龙佰集团	8,500	137,785.00	0.11
207	688777	中控技术	3,065	137,649.15	0.11
208	002294	信立泰	2,900	137,257.00	0.11
209	000831	中国稀土	3,800	137,256.00	0.11

209	600256	广汇能源	22,800	137,256.00	0.11
210	300450	先导智能	5,500	136,675.00	0.11
211	000933	神火股份	8,200	136,448.00	0.11
212	600588	用友网络	10,200	136,374.00	0.11
213	600176	中国巨石	11,900	135,660.00	0.11
214	601633	长城汽车	6,300	135,324.00	0.11
215	688120	华海清科	800	134,960.00	0.11
216	600352	浙江龙盛	13,200	134,112.00	0.11
217	002555	三七互娱	7,700	133,133.00	0.11
218	688002	睿创微纳	1,900	132,468.00	0.11
219	601319	中国人保	15,200	132,392.00	0.11
220	300454	深信服	1,400	131,852.00	0.11
221	600039	四川路桥	13,300	131,670.00	0.11
222	600885	宏发股份	5,900	131,629.00	0.11
223	000630	铜陵有色	38,900	129,926.00	0.11
224	603129	春风动力	600	129,900.00	0.11
225	600085	同仁堂	3,600	129,816.00	0.11
226	688396	华润微	2,741	129,265.56	0.11
227	600482	中国动力	5,600	129,192.00	0.11
228	300017	网宿科技	12,000	128,640.00	0.11
229	601877	正泰电器	5,600	126,952.00	0.10
230	600362	XD 江西铜	5,400	126,522.00	0.10
231	002493	荣盛石化	15,200	125,856.00	0.10
232	000423	东阿阿胶	2,400	125,520.00	0.10
233	300866	安克创新	1,100	124,960.00	0.10
234	300223	北京君正	1,800	124,560.00	0.10
235	002129	TCL 中环	16,200	124,416.00	0.10
236	300474	景嘉微	1,700	124,100.00	0.10
237	002281	光迅科技	2,500	123,300.00	0.10
238	002709	天赐材料	6,800	123,216.00	0.10
239	688072	拓荆科技	800	122,968.00	0.10
240	001965	招商公路	10,200	122,400.00	0.10
241	603392	万泰生物	2,000	122,000.00	0.10
242	002180	纳思达	5,300	121,582.00	0.10
243	688099	晶晨股份	1,700	120,717.00	0.10
244	688047	龙芯中科	900	120,051.00	0.10
245	002131	利欧股份	34,200	119,700.00	0.10
246	002532	天山铝业	14,400	119,664.00	0.10
247	002738	中矿资源	3,700	118,992.00	0.10
248	002085	万丰奥威	7,400	117,586.00	0.10
249	688122	西部超导	2,266	117,560.08	0.10
250	300122	智飞生物	6,000	117,540.00	0.10
251	603596	伯特利	2,200	115,918.00	0.09

252	300058	蓝色光标	17,660	115,849.60	0.09
253	002938	鹏鼎控股	3,600	115,308.00	0.09
254	002223	鱼跃医疗	3,200	113,920.00	0.09
255	002472	双环传动	3,400	113,866.00	0.09
256	603606	东方电缆	2,200	113,762.00	0.09
257	300832	新产业	2,000	113,440.00	0.09
258	300002	神州泰岳	9,600	113,280.00	0.09
259	600161	天坛生物	5,900	113,221.00	0.09
260	002128	电投能源	5,700	112,746.00	0.09
261	002436	兴森科技	8,500	112,540.00	0.09
262	002353	杰瑞股份	3,200	112,000.00	0.09
263	002078	太阳纸业	8,300	111,718.00	0.09
264	002065	东华软件	11,600	111,360.00	0.09
265	002410	广联达	8,300	111,303.00	0.09
266	600188	兖矿能源	9,100	110,747.00	0.09
267	300346	南大光电	3,500	110,740.00	0.09
268	300759	康龙化成	4,500	110,430.00	0.09
269	000999	华润三九	3,530	110,418.40	0.09
270	000301	东方盛虹	13,200	109,956.00	0.09
271	300136	信维通信	4,900	109,760.00	0.09
272	002138	顺络电子	3,900	109,668.00	0.09
273	600862	中航高科	4,200	109,536.00	0.09
274	000034	神州数码	2,900	109,156.00	0.09
275	300054	鼎龙股份	3,800	108,984.00	0.09
276	300496	中科创达	1,900	108,718.00	0.09
277	300024	机器人	6,300	108,234.00	0.09
278	603605	珀莱雅	1,300	107,627.00	0.09
279	300395	菲利华	2,100	107,310.00	0.09
280	601618	中国中冶	36,000	107,280.00	0.09
281	600233	圆通速递	8,300	106,987.00	0.09
282	002202	金风科技	10,400	106,600.00	0.09
283	300383	光环新网	7,400	105,820.00	0.09
284	601615	明阳智能	9,200	105,708.00	0.09
285	688223	晶科能源	20,224	104,962.56	0.09
286	603087	甘李药业	1,900	104,082.00	0.09
287	300604	长川科技	2,300	103,293.00	0.08
288	603659	璞泰来	5,500	103,290.00	0.08
289	002008	大族激光	4,200	102,354.00	0.08
290	605117	德业股份	1,940	102,160.40	0.08
291	002271	东方雨虹	9,500	101,935.00	0.08
292	002405	四维图新	11,900	101,626.00	0.08
293	600845	宝信软件	4,300	101,566.00	0.08
294	600549	厦门钨业	4,800	100,416.00	0.08

295	600895	张江高科	3,900	100,230.00	0.08
296	601872	招商轮船	16,000	100,160.00	0.08
297	002624	完美世界	6,600	100,122.00	0.08
298	000733	振华科技	2,000	100,100.00	0.08
299	601799	星宇股份	800	100,000.00	0.08
300	002459	晶澳科技	10,000	99,800.00	0.08
301	300012	华测检测	8,400	98,196.00	0.08
302	600143	金发科技	9,500	97,945.00	0.08
303	300253	卫宁健康	9,200	97,520.00	0.08
304	002821	凯莱英	1,100	97,075.00	0.08
305	000617	中油资本	13,100	95,630.00	0.08
306	600332	白云山	3,600	94,896.00	0.08
307	000519	中兵红箭	4,300	94,127.00	0.08
308	601216	君正集团	17,000	93,840.00	0.08
309	600392	盛和资源	7,100	93,507.00	0.08
310	600153	建发股份	9,000	93,330.00	0.08
311	603979	金诚信	2,000	92,880.00	0.08
312	000932	华菱钢铁	21,000	92,400.00	0.08
313	601233	桐昆股份	8,700	92,220.00	0.08
314	688188	柏楚电子	700	92,162.00	0.08
315	300073	当升科技	2,100	92,127.00	0.08
316	300699	光威复材	2,900	91,843.00	0.08
317	300627	华测导航	2,620	91,700.00	0.07
318	000878	云南铜业	7,200	91,584.00	0.07
319	300037	新宙邦	2,600	91,520.00	0.07
320	300459	汤姆猫	16,300	91,280.00	0.07
321	300003	乐普医疗	6,600	90,948.00	0.07
322	300628	亿联网络	2,600	90,376.00	0.07
323	300568	星源材质	7,100	90,028.00	0.07
324	300757	罗博特科	600	89,982.00	0.07
325	002389	航天彩虹	3,500	89,600.00	0.07
326	300316	晶盛机电	3,300	89,595.00	0.07
327	600521	华海药业	4,800	89,424.00	0.07
328	002444	巨星科技	3,500	89,285.00	0.07
329	688180	君实生物	2,615	88,857.70	0.07
330	300001	特锐德	3,700	88,689.00	0.07
331	600177	雅戈尔	12,100	88,330.00	0.07
332	002414	高德红外	8,600	88,150.00	0.07
333	300142	沃森生物	8,000	88,000.00	0.07
334	002812	恩捷股份	3,000	87,870.00	0.07
335	002007	华兰生物	5,600	87,752.00	0.07
336	600803	XD 新奥股	4,600	86,940.00	0.07
337	688599	天合光能	5,955	86,526.15	0.07

338	000623	吉林敖东	5,100	86,445.00	0.07
339	600118	中国卫星	3,000	85,710.00	0.07
340	600699	均胜电子	4,900	85,456.00	0.07
341	603260	合盛硅业	1,800	85,320.00	0.07
342	600515	海南机场	24,100	85,314.00	0.07
343	002152	广电运通	6,300	84,672.00	0.07
344	600398	海澜之家	12,100	84,216.00	0.07
345	002044	美年健康	16,300	83,782.00	0.07
346	601238	广汽集团	11,100	83,139.00	0.07
347	000738	航发控制	4,000	83,000.00	0.07
348	600316	洪都航空	2,200	82,940.00	0.07
349	300413	芒果超媒	3,800	82,916.00	0.07
350	600141	兴发集团	4,000	82,120.00	0.07
351	002409	雅克科技	1,500	82,035.00	0.07
352	600704	物产中大	15,500	81,685.00	0.07
353	600038	中直股份	2,100	81,501.00	0.07
354	600497	驰宏锌锗	15,400	81,466.00	0.07
355	300724	捷佳伟创	1,500	81,450.00	0.07
356	600765	中航重机	4,800	81,024.00	0.07
357	300315	掌趣科技	13,300	80,731.00	0.07
358	601677	明泰铝业	6,500	80,730.00	0.07
359	000400	许继电气	3,700	80,549.00	0.07
360	002318	久立特材	3,400	79,526.00	0.06
361	300919	中伟股份	2,400	78,912.00	0.06
362	000960	锡业股份	5,100	78,030.00	0.06
363	002025	航天电器	1,500	77,115.00	0.06
364	600563	法拉电子	700	76,363.00	0.06
365	601567	三星医疗	3,400	76,228.00	0.06
366	002841	视源股份	2,200	76,120.00	0.06
367	603939	益丰药房	3,100	75,857.00	0.06
368	600498	烽火通信	3,600	75,708.00	0.06
369	002607	中公教育	24,700	75,582.00	0.06
370	600486	扬农化工	1,300	75,400.00	0.06
371	300558	贝达药业	1,300	75,335.00	0.06
372	600529	山东药玻	3,400	75,276.00	0.06
373	300088	长信科技	12,600	75,096.00	0.06
374	301358	湖南裕能	2,400	74,856.00	0.06
375	600018	上港集团	13,100	74,801.00	0.06
376	300763	锦浪科技	1,300	74,607.00	0.06
377	002245	蔚蓝锂芯	5,800	74,414.00	0.06
378	000039	中集集团	9,400	73,884.00	0.06
379	002407	多氟多	6,000	73,140.00	0.06
380	000887	中鼎股份	4,100	72,119.00	0.06

381	002739	万达电影	6,300	72,009.00	0.06
382	000009	中国宝安	8,100	71,928.00	0.06
383	601018	宁波港	19,600	71,736.00	0.06
384	300068	南都电源	4,500	71,640.00	0.06
385	600026	中远海能	6,900	71,277.00	0.06
386	600637	东方明珠	9,400	70,218.00	0.06
387	600763	通策医疗	1,700	70,176.00	0.06
388	600008	首创环保	23,200	70,064.00	0.06
389	603486	科沃斯	1,200	69,876.00	0.06
390	300285	国瓷材料	4,000	69,400.00	0.06
391	002130	沃尔核材	2,900	69,078.00	0.06
392	603816	顾家家居	2,700	68,904.00	0.06
393	603806	福斯特	5,300	68,688.00	0.06
394	600170	上海建工	28,700	68,593.00	0.06
395	002497	雅化集团	6,000	68,400.00	0.06
396	300182	捷成股份	12,400	68,324.00	0.06
397	600820	隧道股份	11,200	68,320.00	0.06
398	688303	大全能源	3,173	67,648.36	0.06
399	600516	方大炭素	14,500	67,280.00	0.05
400	603568	伟明环保	3,500	66,780.00	0.05
401	300144	宋城演艺	7,800	66,690.00	0.05
402	300567	精测电子	1,100	66,671.00	0.05
403	002064	华峰化学	10,000	66,100.00	0.05
404	300296	利亚德	10,800	65,880.00	0.05
405	002312	川发龙蟒	5,700	65,436.00	0.05
406	600998	九州通	12,700	65,278.00	0.05
407	605358	立昂微	2,800	65,240.00	0.05
408	300676	华大基因	1,300	64,701.00	0.05
409	000683	博源化工	13,500	64,665.00	0.05
410	688266	泽璟制药	600	64,506.00	0.05
411	601179	中国西电	10,500	64,470.00	0.05
412	600166	福田汽车	23,700	64,227.00	0.05
413	603613	国联股份	2,700	63,963.00	0.05
414	002176	江特电机	8,600	62,436.00	0.05
415	603885	吉祥航空	4,600	61,962.00	0.05
416	002432	九安医疗	1,700	61,931.00	0.05
417	688009	中国通号	11,993	61,644.02	0.05
418	600535	天士力	3,900	61,035.00	0.05
419	601000	唐山港	15,000	60,900.00	0.05
420	600323	瀚蓝环境	2,500	60,875.00	0.05
421	000830	鲁西化工	5,900	60,770.00	0.05
422	000818	航锦科技	2,700	60,750.00	0.05
423	002603	以岭药业	4,300	60,630.00	0.05

424	601155	新城控股	4,400	60,192.00	0.05
425	000629	钒钛股份	23,300	59,648.00	0.05
426	688506	百利天恒	200	59,224.00	0.05
427	002439	启明星辰	3,700	59,163.00	0.05
428	000708	中信特钢	5,000	58,800.00	0.05
429	601880	XD 辽港股	38,900	58,350.00	0.05
430	600511	国药股份	2,000	58,320.00	0.05
431	002145	中核钛白	13,900	57,685.00	0.05
432	300390	天华新能	3,000	57,210.00	0.05
433	600655	豫园股份	10,300	57,165.00	0.05
434	600499	科达制造	5,800	56,840.00	0.05
435	603000	人民网	2,800	56,588.00	0.05
436	603833	欧派家居	1,000	56,450.00	0.05
437	688005	容百科技	2,528	56,424.96	0.05
438	601966	玲珑轮胎	3,800	55,746.00	0.05
439	300751	迈为股份	800	55,648.00	0.05
440	600004	白云机场	6,100	55,510.00	0.05
441	002155	湖南黄金	3,100	55,335.00	0.05
442	000426	兴业银锡	3,500	55,300.00	0.05
443	603899	晨光股份	1,900	55,081.00	0.04
444	600325	华发股份	11,300	55,031.00	0.04
445	603077	和邦生物	31,400	54,950.00	0.04
446	600131	国网信通	3,100	54,870.00	0.04
447	600859	王府井	3,900	54,171.00	0.04
448	002756	永兴材料	1,700	53,975.00	0.04
449	000547	航天发展	6,400	53,760.00	0.04
450	601607	上海医药	2,900	51,852.00	0.04
451	300529	健帆生物	2,400	51,768.00	0.04
452	300601	康泰生物	3,400	51,646.00	0.04
453	600754	锦江酒店	2,300	51,612.00	0.04
454	000998	隆平高科	5,200	51,220.00	0.04
455	300070	碧水源	11,100	49,950.00	0.04
456	300438	鹏辉能源	1,800	49,698.00	0.04
457	600667	太极实业	7,500	49,350.00	0.04
458	002544	普天科技	2,100	49,245.00	0.04
459	601866	中远海发	19,900	49,153.00	0.04
460	002120	韵达股份	7,300	48,910.00	0.04
461	600867	通化东宝	5,900	48,380.00	0.04
462	600258	首旅酒店	3,400	48,042.00	0.04
463	300573	兴齐眼药	920	47,646.80	0.04
464	000069	华侨城 A	21,100	47,475.00	0.04
465	002831	裕同科技	2,000	46,840.00	0.04
466	000967	盈峰环境	6,700	46,565.00	0.04

467	002508	老板电器	2,400	45,624.00	0.04
468	688063	派能科技	1,000	45,080.00	0.04
469	300118	东方日升	4,600	44,068.00	0.04
470	300457	赢合科技	1,900	43,700.00	0.04
471	002292	奥飞娱乐	4,400	42,768.00	0.03
472	600129	太极集团	2,000	42,620.00	0.03
473	601636	旗滨集团	8,500	42,585.00	0.03
474	603650	彤程新材	1,300	41,795.00	0.03
475	002266	浙富控股	13,400	41,272.00	0.03
476	002572	索菲亚	2,900	40,629.00	0.03
477	300769	德方纳米	1,200	39,624.00	0.03
478	688390	固德威	900	39,105.00	0.03
479	000035	中国天楹	8,900	38,181.00	0.03
480	600315	上海家化	1,800	37,926.00	0.03
481	002091	江苏国泰	5,100	37,077.00	0.03
482	600312	平高电气	2,300	35,397.00	0.03
483	002372	伟星新材	3,200	33,152.00	0.03
484	000563	陕国投 A	8,500	30,345.00	0.02
485	000032	深桑达 A	1,400	28,322.00	0.02
486	001914	招商积余	2,200	27,214.00	0.02
487	600007	中国国贸	1,100	22,638.00	0.02
488	600335	国机汽车	3,100	19,995.00	0.02
489	301381	赛维时代	400	7,980.00	0.01

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	600167	联美控股	4,000	22,480.00	0.02
2	688775	影石创新	119	14,775.04	0.01
3	600755	厦门国贸	2,400	14,520.00	0.01
4	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
5	603588	高能环境	2,100	11,844.00	0.01
6	301662	宏工科技	125	10,312.50	0.01
7	301665	泰禾股份	384	8,597.76	0.01
8	688755	汉邦科技	193	7,590.69	0.01
9	600771	广誉远	200	4,032.00	0.00
10	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
11	603014	威高血净	74	2,418.32	0.00
12	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
13	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
14	002541	鸿路钢构	100	1,674.00	0.00
15	300595	欧普康视	100	1,527.00	0.00
16	002240	盛新锂能	100	1,288.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,187,409.00	7.51
2	300750	宁德时代	7,416,704.00	6.06
3	601318	中国平安	6,157,165.00	5.03
4	600036	招商银行	4,968,790.00	4.06
5	600900	长江电力	4,197,718.00	3.43
6	000333	美的集团	4,152,929.00	3.39
7	002594	比亚迪	3,588,549.00	2.93
8	300059	东方财富	3,244,081.00	2.65
9	601899	紫金矿业	2,923,072.00	2.39
10	601398	工商银行	2,906,974.00	2.37
11	600030	中信证券	2,863,023.00	2.34
12	601166	兴业银行	2,764,296.00	2.26
13	002475	立讯精密	2,365,028.00	1.93
14	000858	五粮液	2,330,053.00	1.90
15	600276	恒瑞医药	2,267,124.00	1.85
16	688981	中芯国际	2,142,081.36	1.75
17	601288	农业银行	2,066,652.00	1.69
18	000651	格力电器	2,021,471.00	1.65
19	603259	药明康德	1,718,930.00	1.40
20	600887	伊利股份	1,698,990.00	1.39

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,717,620.00	3.85
2	300750	宁德时代	3,937,105.00	3.22
3	601318	中国平安	3,652,656.00	2.98
4	000333	美的集团	2,590,971.00	2.12
5	600036	招商银行	2,554,548.00	2.09
6	600900	长江电力	2,430,526.00	1.99
7	002594	比亚迪	1,988,738.00	1.62
8	300059	东方财富	1,767,304.00	1.44
9	601398	工商银行	1,756,614.00	1.44
10	601899	紫金矿业	1,581,439.00	1.29
11	600030	中信证券	1,517,370.00	1.24
12	601288	农业银行	1,264,225.00	1.03

13	002475	立讯精密	1,223,995.00	1.00
14	600276	恒瑞医药	1,183,904.00	0.97
15	601166	兴业银行	1,138,688.00	0.93
16	000858	五粮液	1,090,222.00	0.89
17	000651	格力电器	1,082,838.00	0.88
18	688981	中芯国际	1,080,106.53	0.88
19	600919	江苏银行	1,068,408.00	0.87
20	300124	汇川技术	1,066,910.00	0.87

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	237,508,463.65
卖出股票收入（成交）总额	125,866,905.10

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	5,724,552.16	4.68
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	5,724,552.16	4.68

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	57,000	5,724,552.16	4.68

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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兴业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。

兴业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	66,438.06
2	应收清算款	2,938,143.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,972.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,010,554.19

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	14,775.04	0.01	首次公开发行限售
2	688757	胜科纳米	13,903.84	0.01	首次公开发行限售

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 A500 指数 A	494	129,671.81	1,974.07	0.00	64,055,897.89	100.00
长城中证 A500 指数 C	508	111,250.15	1.00	0.00	56,515,073.15	100.00
合计	1,002	120,332.28	1,975.07	0.00	120,570,971.04	100.00

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 A500 指数 A	17,904.10	0.0279
	长城中证 A500 指数 C	643.51	0.0011
	合计	18,547.61	0.0154

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 A500 指数 A	0
	长城中证 A500 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城中证 A500 指数 A	0
	长城中证 A500 指数 C	0
	合计	0

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 A500 指数 A	长城中证 A500 指数 C
基金合同生效日（2025 年 1 月 17 日）基金份额总额	344,439,876.16	1,450,226,749.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,653,506.57	9,567,293.38
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	285,035,510.77	1,403,278,968.75

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	64,057,871.96	56,515,074.15

§ 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 (%)	
招商证券股份有限公司	4	121,174,030.93	33.37	23,737.98	33.37	本期报告新增4个
长江证券	1	121,101,395.83	33.35	23,724.36	33.35	本期报告新增1个
国泰海通	4	65,663,396.31	18.08	12,862.40	18.08	本期报告新增4个
中信证券	1	28,564,375.11	7.87	5,595.43	7.87	本期报告新增1个
兴业证券	1	13,944,797.00	3.84	2,731.71	3.84	本期报告新增1个
广发证券股份有限公司	1	8,339,656.18	2.30	1,633.88	2.30	本期报告新增1个
东方证券	2	4,311,080.97	1.19	844.59	1.19	本期报告新增2个
财通证券	2	-	-	-	-	本期报告新增2个
长城证券	6	-	-	-	-	本期报告新增6个
东吴证券	1	-	-	-	-	本期

						报告 新增 1 个
东兴证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
方正证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
国金证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
国投证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
国信证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
国元证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
宏信证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
华福证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
华金证券	2	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
华泰证券	1	-	-	-	-	本期 报告

							新增 1 个
华西证券	1	-	-	-	-	-	本报告期新增 2 个、本报告期 退租 1 个
华源证券	1	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
华鑫证券	1	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
民生证券	1	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	-	本报告 期新增 2 个、 本报告 期退租 1 个
山西证券	2	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 2 个
上海证券	1	-	-	-	-	-	本期 报告 新增 1 个
申万宏源	1	-	-	-	-	-	本期

							报告新增 1 个
首创证券	1	-	-	-	-	-	本报告期新增 2 个、本报告期退租 1 个
太平洋证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
天风证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
万和证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
万联证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
五矿证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
西部证券	1	-	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
西南证券	1	-	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
银河证券	2	-	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
粤开证券	2	-	-	-	-	-	本期

						报告新增 2 个
中金财富	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
中金公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
中信建投	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
中银国际	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个

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 (%)
招商证券股份有限公司	5,284,078.00	22.73	121,800,000.00	1.74	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	17,545,312.00	75.47	-	-	-	-
中信证券	399,038.00	1.72	3,797,000,000.00	54.28	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	19,204.47	0.08	-	-	-	-
东方证券	-	-	3,075,800,000.00	43.97	-	-
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	长城中证 A500 指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 1 月 18 日
2	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
3	长城中证 A500 指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 2 月 7 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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城中证 A500 指数型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城中证 A500 指数型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日