

长城中证 A500 指数型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
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	61
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	61

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	65
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 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	40,316,739.35 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	11,441,214.26 份	28,875,525.09 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	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。 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。 1、股票投资策略 （1）组合复制策略 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。 （2）替代性策略 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。

	(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。 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。 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。 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。 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。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+活期存款利率(税后) $\times$ 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	李建军	王小飞
	联系电话	0755-29279005	021-60637103
	电子邮箱	lijj@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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日 - 2026 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	792,505.33	2,064,464.15
本期利润	1,700,102.41	4,154,022.78
加权平均基金份额本期利润	0.1467	0.1308
本期加权平均净值利润率	11.44%	10.23%
本期基金份额净值增长率	11.77%	11.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,507,736.11	6,199,078.55
期末可供分配基金份额利润	0.2192	0.2147
期末基金资产净值	15,627,744.77	39,301,643.57
期末基金份额净值	1.3659	1.3611
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	36.59%	36.11%

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认购或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 A500 指数 A

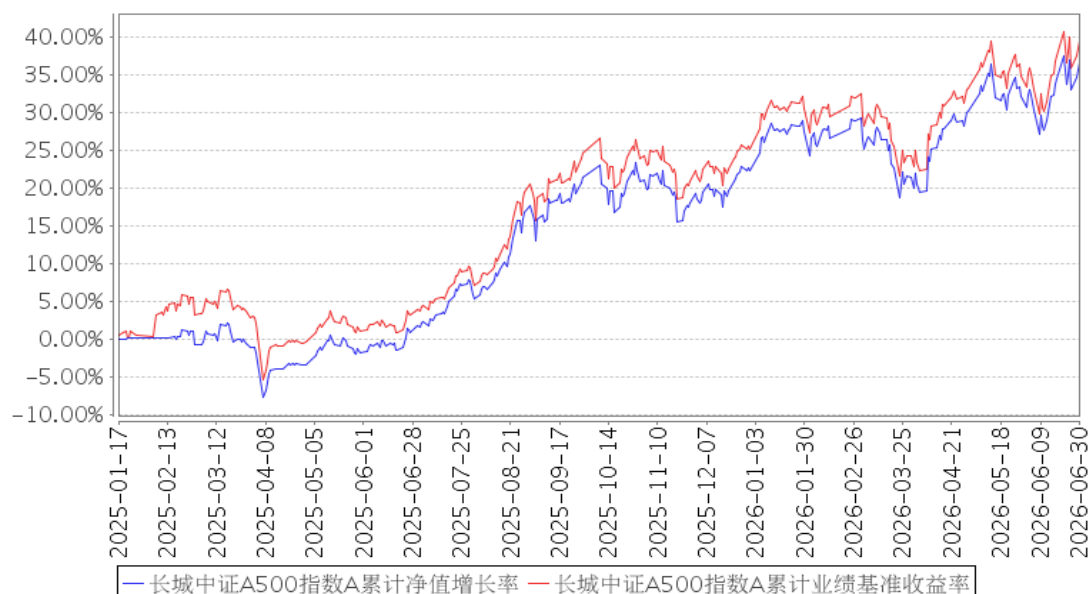
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.86%	1.31%	13.54%	1.34%	0.32%	-0.03%
过去六个月	11.77%	1.20%	11.34%	1.22%	0.43%	-0.02%
过去一年	34.48%	1.07%	34.41%	1.09%	0.07%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	36.59%	1.01%	39.36%	1.06%	-2.77%	-0.05%

长城中证 A500 指数 C

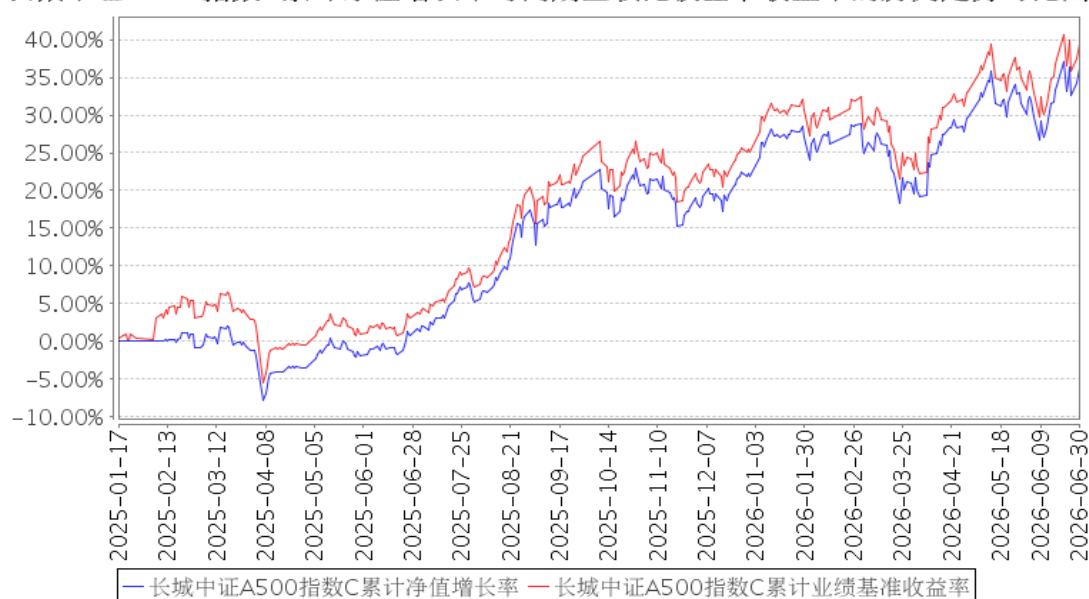
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	13.80%	1.31%	13.54%	1.34%	0.26%	-0.03%
过去六个月	11.64%	1.20%	11.34%	1.22%	0.30%	-0.02%
过去一年	34.15%	1.07%	34.41%	1.09%	-0.26%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	36.11%	1.01%	39.36%	1.06%	-3.25%	-0.05%

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，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 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 128 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		
陶曙斌	本基金的基金经理	2025 年 1 月 17 日	-	18 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 8 月至 2026 年 3 月任“长城国证自由现金流指数型证券投资基金”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 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，自 2025 年 8 月至今任“长城上证科创板综合指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 12

					月至今任“长城沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金”基金经理，自 2026 年 3 月至今任“长城国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金”基金经理，自 2026 年 3 月至今任“长城国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金”（自 2026 年 3 月 17 日由“长城国证自由现金流指数型证券投资基金”变更而来）基金经理，自 2026 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”“长城中证电池主题指数型发起式证券投资基金”“长城上证科创板芯片设计主题指数型发起式证券投资基金”基金经理。
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理	2025 年 1 月 17 日	2026 年 2 月 2 日	18 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 2025 年 1 月至 2026 年 2 月任“长城中证 A500 指数型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至 2026 年 6 月任“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 2026 年 6 月任“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至 2026 年 6 月任“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 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 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”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 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“长城恒生科技指数型证券投资基金（QDII）”基金经理，自 2026 年 5 月至今任“长城智悦均衡混合型证券投资基金”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 9.24 行情以来的预期。整体风格表现分化较大，AI 科技相关资产占优。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，以期持有人提供与之相

近的收益，并通过参与新股申购、转债套利等方式追求超额收益。

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 11.77%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；长城中证 A500 指数 C 基金份额净值增长率为 11.64%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济复苏企稳，流动性维持合理宽松，市场利率中枢预计中长期处于较低水平。海外美联储货币政策与地缘局势是主要外部扰动因素。A 股市场整体维持结构性行情为主的震荡格局，驱动力从提升估值转向企业盈利增长，资金将持续向业绩确定性强的标的集中。

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、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设立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、相关研究部门负责人、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。投资总监和相关研究部门负责人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。基金经理可以列席估值委员会会议，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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,162,836.95	2,418,437.77
结算备付金		18,787.61	284.36
存出保证金		6,086.76	26,948.71
交易性金融资产	6.4.7.2	52,406,834.59	47,849,851.82
其中：股票投资		51,897,593.45	46,838,696.75
基金投资		-	-
债券投资		509,241.14	1,011,155.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		81,971.96	12,309.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		55,676,517.87	50,307,832.26
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		582,116.61	247,217.91
应付赎回款		116,686.70	58,567.13
应付管理人报酬		6,651.38	6,384.05
应付托管费		2,217.12	2,128.06
应付销售服务费		8,010.01	7,456.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		16.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	31,431.25	22,404.63
负债合计		747,129.53	344,157.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	40,316,739.35	40,952,893.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,612,648.99	9,010,780.41
净资产合计		54,929,388.34	49,963,674.36
负债和净资产总计		55,676,517.87	50,307,832.26

注：（1）报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 40,316,739.35 份，其中长城中证 A500 指数 A 基金份额总额 11,441,214.26 份，基金份额净值 1.3659 元；长城中证 A500 指数 C 基金份额总额 28,875,525.09 份，基金份额净值 1.3611 元。

(2) 本基金基金合同于 2025 年 1 月 17 日生效，本基金上年度可比期间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）至 2025 年 12 月 31 日止。

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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		5,986,838.47	7,591,448.89
1. 利息收入		4,891.85	3,068,059.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,891.85	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）		2,984,131.67	3,745,964.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,521,161.81	2,302,145.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,656.95	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	455,312.91	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	2,997,155.71	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	659.24	724.71
减：二、营业总支出		132,713.28	832,871.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	41,143.81	298,214.28

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	13, 714. 57	99, 404. 77
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	50, 150. 55	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		4. 46	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	27, 699. 89	80, 758. 15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5, 854, 125. 19	6, 758, 577. 87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5, 854, 125. 19	6, 758, 577. 87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5, 854, 125. 19	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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	40, 952, 893. 95	-	9, 010, 780. 41	49, 963, 674. 36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	40, 952, 893. 95	-	9, 010, 780. 41	49, 963, 674. 36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-636, 154. 60	-	5, 601, 868. 58	4, 965, 713. 98
（一）、综合收益总额	-	-	5, 854, 125. 19	5, 854, 125. 19
（二）、本期基金份额交易产	-636, 154. 60	-	-252, 256. 61	-888, 411. 21

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	27,898,802.66	-	7,840,291.48	35,739,094.14
2. 基金赎回款	-28,534,957.26	-	-8,092,548.09	-36,627,505.35
（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	40,316,739.35	-	14,612,648.99	54,929,388.34
项目	上年度可比期间 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：

祝函

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向社会公开募集，经向中国证监会备案，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。本基金募集期间为 2025 年 1 月 2 日至 2025 年 1 月 15 日，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，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015735_H01 号验资报告予以验证。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”）。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

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。

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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》,中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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。

6.4.4.1 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局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《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《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

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《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《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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,162,836.95
等于：本金	3,162,563.75
加：应计利息	273.20
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,162,836.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		43,424,367.69	-	51,897,593.45	8,473,225.76
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	506,430.00	2,791.14	509,241.14	20.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	506,430.00	2,791.14	509,241.14	20.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43,930,797.69	2,791.14	52,406,834.59	8,473,245.76

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 2026 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	4,156.36
其中：交易所市场	4,156.36
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	2,479.70
预提信息披露费	24,795.19
合计	31,431.25

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,650,774.33	11,650,774.33
本期申购	6,367,464.75	6,367,464.75
本期赎回（以“-”号填列）	-6,577,024.82	-6,577,024.82
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	11,441,214.26	11,441,214.26

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,302,119.62	29,302,119.62
本期申购	21,531,337.91	21,531,337.91
本期赎回（以“-”号填列）	-21,957,932.44	-21,957,932.44
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	28,875,525.09	28,875,525.09

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（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
上年度末	1,750,863.83	836,234.18	2,587,098.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,750,863.83	836,234.18	2,587,098.01
本期利润	792,505.33	907,597.08	1,700,102.41
本期基金份额交易产生的变动数	-35,633.05	-65,036.86	-100,669.91
其中：基金申购款	1,071,432.62	714,392.54	1,785,825.16

基金赎回款	-1, 107, 065. 67	-779, 429. 40	-1, 886, 495. 07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2, 507, 736. 11	1, 678, 794. 40	4, 186, 530. 51

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
上年度末	4, 324, 140. 04	2, 099, 542. 36	6, 423, 682. 40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4, 324, 140. 04	2, 099, 542. 36	6, 423, 682. 40
本期利润	2, 064, 464. 15	2, 089, 558. 63	4, 154, 022. 78
本期基金份额交易产生的变动数	-189, 525. 64	37, 938. 94	-151, 586. 70
其中：基金申购款	3, 520, 682. 91	2, 533, 783. 41	6, 054, 466. 32
基金赎回款	-3, 710, 208. 55	-2, 495, 844. 47	-6, 206, 053. 02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6, 199, 078. 55	4, 227, 039. 93	10, 426, 118. 48

6. 4. 7. 13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4, 835. 59
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	36. 59
其他	19. 67
合计	4, 891. 85

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2, 521, 161. 81
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, 521, 161. 81

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,541,515.70
减：卖出股票成本总额	17,000,544.38
减：交易费用	19,809.51
买卖股票差价收入	2,521,161.81

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,973.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,683.43
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	7,656.95

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,228,040.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,197,316.57
减：应计利息总额	28,040.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	2,683.43

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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	455,312.91
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	455,312.91

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,997,155.71
股票投资	3,000,187.14
债券投资	-3,031.43
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	2,997,155.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	659.24
合计	659.24

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	2,479.70
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	425.00
合计	27,699.89

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	331,129.00	0.86	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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（%）	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 2026年1月1日至2026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	64.90	0.86	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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，佣金包含佣金收取方为基金提供证券研究服务而收取的费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 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	41,143.81	298,214.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,201.89	144,241.36
应支付基金管理人的净管理费	23,941.92	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：

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	13,714.57	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：

$$H=E\times\text{托管费费率}\div\text{当年天数}$$

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	10,813.16	10,813.16
中国建设银行	-	29,583.13	29,583.13
合计	-	40,396.29	40,396.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

份额单位：份

长城中证 A500 指数 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
长城嘉信 资产管理 有限公司	6,807,588.24	16.8853	6,807,588.24	16.6230

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,162,836.95	4,835.59	7,861,490.64	144,753.01

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，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（2026 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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.04	-
113704	春风转债	2026 年 6 月 10 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.14	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	367	103,053.15	322,787.51	-

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 2026 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 2026 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同责任，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要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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。

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。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

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账面价值，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 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,162,836.95	-	-	-	-	-	-3,162,836.95
结算备付金	18,787.61	-	-	-	-	-	18,787.61
存出保证金	6,086.76	-	-	-	-	-	6,086.76
交易性金融资产	-	-	503,240.96	-	6,000.18	51,897,593.45	52,406,834.59
应收申购款	-	-	-	-	-	81,971.96	81,971.96
资产总计	3,187,711.32	-	503,240.96	-	6,000.18	51,979,565.41	55,676,517.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-116,686.70	116,686.70

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,651.38	6,651.38
应付托管费	-	-	-	-	-	2,217.12	2,217.12
应付清算款	-	-	-	-	-	582,116.61	582,116.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,010.01	8,010.01
应交税费	-	-	-	-	-	16.46	16.46
其他负债	-	-	-	-	-	31,431.25	31,431.25
负债总计	-	-	-	-	-	747,129.53	747,129.53
利率敏感度缺口	3,187,711.32	-	503,240.96	-	6,000.18		
上年度末 2025 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	2,418,437.77	-	-	-	-	-2,418,437.77	
结算备付金	284.36	-	-	-	-	-284.36	
存出保证金	26,948.71	-	-	-	-	-26,948.71	
交易性金融资产	1,011,155.07	-	-	-	-	46,838,696.75	47,849,851.82
应收申购款	-	-	-	-	-	12,309.60	12,309.60
资产总计	3,456,825.91	-	-	-	-	46,851,006.35	50,307,832.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	58,567.13	58,567.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,384.05	6,384.05
应付托管费	-	-	-	-	-	2,128.06	2,128.06
应付清算款	-	-	-	-	-	247,217.91	247,217.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,456.12	7,456.12
其他负债	-	-	-	-	-	22,404.63	22,404.63
负债总计	-	-	-	-	-	344,157.90	344,157.90
利率敏感度缺口	3,456,825.91	-	-	-	-		

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	682.93	103.91
	市场利率上升 25 个基点	-681.08	-103.89

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。

本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	51,897,593.45	94.48	46,838,696.75	93.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	509,241.14	0.93	1,011,155.07	2.02
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	52,406,834.59	95.41	47,849,851.82	95.77

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,149,405.46	2,716,644.41
	沪深 300 指数下降 5%	-3,149,405.46	-2,716,644.41

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	51,574,805.94	46,560,474.50
第二层次	832,028.65	1,289,377.32
第三层次	-	-
合计	52,406,834.59	47,849,851.82

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、新发未上市和非公开发行等情况，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

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	51,897,593.45	93.21
	其中：股票	51,897,593.45	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	509,241.14	0.91
	其中：债券	509,241.14	0.91
	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	3,181,624.56	5.71
8	其他各项资产	88,058.72	0.16
9	合计	55,676,517.87	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	164,029.00	0.30
B	采矿业	2,124,083.00	3.87
C	制造业	36,805,637.29	67.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,128,632.47	2.05
E	建筑业	631,105.00	1.15
F	批发和零售业	403,593.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	1,153,938.00	2.10
H	住宿和餐饮业	24,605.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,796,661.89	5.09
J	金融业	5,013,710.00	9.13
K	房地产业	291,240.00	0.53
L	租赁和商务服务业	372,122.60	0.68
M	科学研究和技术服务业	623,843.00	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	88,918.20	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,280.00	0.03
Q	卫生和社会工作	101,885.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	40,032.00	0.07
S	综合	91,286.00	0.17
	合计	51,872,601.45	94.44

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	24,992.00	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	24,992.00	0.05

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	300308	中际旭创	1,700	2,159,000.00	3.93
2	300750	宁德时代	4,100	1,611,341.00	2.93
3	300502	新易盛	2,168	1,315,976.00	2.40
4	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	2.16
5	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	1.48
6	601318	中国平安	16,600	792,484.00	1.44
7	688256	寒武纪	438	698,850.90	1.27
8	600036	招商银行	19,300	685,150.00	1.25
9	601899	紫金矿业	25,700	646,098.00	1.18
10	002371	北方华创	725	641,306.00	1.17
11	000333	美的集团	7,600	574,028.00	1.05
12	688012	中微公司	1,206	565,011.00	1.03
13	002475	立讯精密	8,000	563,200.00	1.03

14	688041	海光信息	1,471	544,711.30	0.99
15	002384	东山精密	2,000	524,700.00	0.96
16	688008	澜起科技	1,693	524,660.70	0.96
17	600900	长江电力	19,100	505,577.00	0.92
18	688981	中芯国际	3,116	494,883.12	0.90
19	000725	京东方 A	56,800	493,024.00	0.90
20	603259	药明康德	3,900	485,589.00	0.88
21	601166	兴业银行	26,400	437,184.00	0.80
22	600030	中信证券	15,200	436,696.00	0.80
23	300059	东方财富	19,800	403,524.00	0.73
24	600183	生益科技	2,300	398,820.00	0.73
25	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.69
26	300274	阳光电源	2,300	365,746.00	0.67
27	600276	恒瑞医药	7,000	364,280.00	0.66
28	601398	工商银行	50,500	357,035.00	0.65
29	300408	三环集团	2,100	350,490.00	0.64
30	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.63
31	600487	亨通光电	3,100	338,954.00	0.62
32	002594	比亚迪	4,200	334,740.00	0.61
33	688072	拓荆科技	367	322,787.51	0.59
34	002463	沪电股份	2,100	320,880.00	0.58
35	601211	国泰海通	17,600	320,320.00	0.58
36	300394	天孚通信	980	296,626.40	0.54
37	000988	华工科技	1,600	295,376.00	0.54
38	688525	佰维存储	585	289,417.05	0.53
39	301308	江波龙	400	281,520.00	0.51
40	600176	中国巨石	3,800	276,944.00	0.50
41	601288	农业银行	44,900	272,543.00	0.50
42	601328	交通银行	41,700	268,131.00	0.49
43	000651	格力电器	7,000	262,500.00	0.48
44	600522	中天科技	4,300	260,924.00	0.48
45	603019	中科曙光	2,300	246,629.00	0.45
46	300604	长川科技	700	238,994.00	0.44
47	603993	洛阳钼业	13,600	238,680.00	0.43
48	600150	中国船舶	7,043	237,982.97	0.43
49	600887	伊利股份	9,900	237,204.00	0.43
50	000338	潍柴动力	8,400	228,900.00	0.42
51	600584	长电科技	2,200	227,810.00	0.41
52	688521	芯原股份	612	227,137.68	0.41
53	000858	五粮液	3,000	222,000.00	0.40
54	688120	华海清科	680	219,082.40	0.40
55	688347	华虹宏力	635	213,550.50	0.39
56	002916	深南电路	460	210,634.00	0.38

57	601816	京沪高铁	45,800	207,474.00	0.38
58	002281	光迅科技	800	205,552.00	0.37
59	300124	汇川技术	3,000	198,990.00	0.36
60	600309	万华化学	2,900	198,389.00	0.36
61	002008	大族激光	1,300	195,143.00	0.36
62	002415	海康威视	5,700	194,940.00	0.35
63	600111	北方稀土	4,000	192,200.00	0.35
64	000100	TCL 科技	32,500	189,150.00	0.34
65	000063	中兴通讯	5,000	180,950.00	0.33
66	600000	浦发银行	20,800	179,088.00	0.33
67	300136	信维通信	1,500	178,875.00	0.33
68	600089	特变电工	7,900	177,750.00	0.32
69	601857	中国石油	20,200	175,336.00	0.32
70	002028	思源电气	1,000	173,000.00	0.31
71	300857	协创数据	500	169,950.00	0.31
72	601088	中国神华	4,300	167,872.00	0.31
73	300433	蓝思科技	3,100	166,346.00	0.30
74	600031	三一重工	9,300	160,704.00	0.29
75	300014	亿纬锂能	2,400	156,072.00	0.28
76	601601	中国太保	5,400	154,008.00	0.28
77	002050	三花智控	3,500	153,405.00	0.28
78	002353	杰瑞股份	1,000	152,500.00	0.28
79	000001	平安银行	15,100	151,755.00	0.28
80	000792	盐湖股份	5,000	150,950.00	0.27
81	002714	牧原股份	4,300	150,457.00	0.27
82	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.27
83	300223	君正股份	600	149,340.00	0.27
84	600549	厦门钨业	1,700	144,840.00	0.26
85	002156	通富微电	1,900	144,153.00	0.26
86	600406	国电南瑞	6,300	143,955.00	0.26
87	601668	中国建筑	32,200	139,748.00	0.25
88	002436	兴森科技	2,700	137,565.00	0.25
89	000657	中钨高新	1,400	134,008.00	0.24
90	601919	中远海控	9,800	129,948.00	0.24
91	002602	世纪华通	9,200	129,720.00	0.24
92	601988	中国银行	22,300	127,556.00	0.23
93	300054	鼎龙股份	1,200	127,164.00	0.23
94	600660	福耀玻璃	2,500	126,100.00	0.23
95	601728	中国电信	24,200	125,598.00	0.23
96	601012	隆基绿能	9,500	124,640.00	0.23
97	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.23
98	603501	豪威集团	1,300	123,305.00	0.22
99	002230	科大讯飞	3,000	122,520.00	0.22

100	300760	迈瑞医疗	900	122,247.00	0.22
101	601225	陕西煤业	6,000	122,100.00	0.22
102	600941	中国移动	1,400	120,582.00	0.22
103	600690	海尔智家	5,900	120,419.00	0.22
104	002460	赣锋锂业	1,800	117,720.00	0.21
105	002938	鹏鼎控股	1,100	115,918.00	0.21
106	603799	华友钴业	2,400	115,824.00	0.21
107	002352	顺丰控股	3,700	115,662.00	0.21
108	601985	中国核电	12,800	115,584.00	0.21
109	002709	天赐材料	2,200	113,146.00	0.21
110	000977	浪潮信息	1,600	112,000.00	0.20
111	600160	巨化股份	2,100	111,321.00	0.20
112	688777	中控技术	945	111,037.50	0.20
113	300033	同花顺	460	110,860.00	0.20
114	300442	润泽科技	1,300	107,991.00	0.20
115	000938	紫光股份	3,600	103,896.00	0.19
116	688126	沪硅产业	2,596	103,554.44	0.19
117	000425	徐工机械	12,800	103,552.00	0.19
118	002202	金风科技	4,300	102,770.00	0.19
119	601600	中国铝业	12,400	101,928.00	0.19
120	300346	南大光电	1,100	101,915.00	0.19
121	600028	中国石化	22,800	101,688.00	0.19
122	600938	中国海油	3,700	100,455.00	0.18
123	300661	圣邦股份	700	100,436.00	0.18
124	002851	麦格米特	600	100,308.00	0.18
125	002600	领益智造	5,700	98,838.00	0.18
126	601766	中国中车	19,000	98,800.00	0.18
127	600460	士兰微	1,800	98,388.00	0.18
128	002466	天齐锂业	1,600	98,112.00	0.18
129	002049	紫光国微	1,100	97,625.00	0.18
130	600050	中国联通	24,400	97,600.00	0.18
131	002837	英维克	1,200	95,472.00	0.17
132	002407	多氟多	1,900	95,437.00	0.17
133	300567	精测电子	300	95,280.00	0.17
134	002138	顺络电子	1,300	95,030.00	0.17
135	300395	菲利华	700	93,611.00	0.17
136	000568	泸州老窖	1,200	93,024.00	0.17
137	002179	中航光电	2,000	92,400.00	0.17
138	601628	中国人寿	2,600	91,910.00	0.17
139	002185	华天科技	4,100	91,471.00	0.17
140	002080	中材科技	1,000	90,000.00	0.16
141	601872	招商轮船	5,100	89,607.00	0.16
142	688017	绿的谐波	213	89,004.18	0.16

143	002241	歌尔股份	3,900	87,867.00	0.16
144	600879	航天电子	4,100	87,289.00	0.16
145	603288	海天味业	2,600	86,216.00	0.16
146	601100	恒立液压	800	86,048.00	0.16
147	601006	大秦铁路	18,600	85,746.00	0.16
148	688396	华润微	871	84,966.05	0.15
149	601658	邮储银行	17,200	84,796.00	0.15
150	300751	迈为股份	300	84,738.00	0.15
151	605117	德业股份	796	84,519.28	0.15
152	300390	天华新能	900	84,159.00	0.15
153	688111	金山办公	392	83,515.60	0.15
154	000408	藏格矿业	1,200	83,184.00	0.15
155	688469	芯联集成	7,827	83,044.47	0.15
156	600905	三峡能源	22,257	82,573.47	0.15
157	002625	光启技术	2,700	81,864.00	0.15
158	600489	中金黄金	4,500	81,225.00	0.15
159	688002	睿创微纳	525	81,212.25	0.15
160	688271	联影医疗	797	80,680.31	0.15
161	601888	中国中免	1,500	80,565.00	0.15
162	600893	航发动力	2,100	80,514.00	0.15
163	000630	铜陵有色	12,600	80,136.00	0.15
164	601127	赛力斯	1,300	79,625.00	0.14
165	601689	拓普集团	1,400	78,988.00	0.14
166	600010	包钢股份	35,400	78,942.00	0.14
167	002273	水晶光电	2,200	78,056.00	0.14
168	600673	东阳光	2,300	77,234.00	0.14
169	300058	蓝色光标	5,560	76,505.60	0.14
170	002027	分众传媒	15,800	76,472.00	0.14
171	300037	新宙邦	800	74,280.00	0.14
172	600760	中航沈飞	1,800	73,980.00	0.13
173	600019	宝钢股份	13,600	73,848.00	0.13
174	600118	中国卫星	900	73,845.00	0.13
175	000807	云铝股份	3,300	73,062.00	0.13
176	000426	兴业银锡	2,200	72,512.00	0.13
177	601168	西部矿业	2,600	70,564.00	0.13
178	600104	上汽集团	7,200	70,272.00	0.13
179	605589	圣泉集团	1,100	69,927.00	0.13
180	601727	上海电气	9,900	69,300.00	0.13
181	600362	江西铜业	1,600	69,280.00	0.13
182	300450	先导智能	1,700	69,224.00	0.13
183	600989	宝丰能源	3,400	69,122.00	0.13
184	600875	东方电气	2,400	69,048.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	2,600	68,432.00	0.12

186	002001	新 和 成	2,400	68,208.00	0.12
187	688099	晶晨股份	653	67,193.70	0.12
188	600667	太极实业	2,300	67,114.00	0.12
189	601390	中国中铁	16,000	66,720.00	0.12
190	000831	中国稀土	1,200	66,588.00	0.12
191	000538	云南白药	1,400	66,318.00	0.12
192	600885	宏发股份	1,900	65,531.00	0.12
193	600392	盛和资源	2,200	65,494.00	0.12
194	002422	科伦药业	1,700	65,484.00	0.12
195	600795	国电电力	13,900	64,913.00	0.12
196	002738	中矿资源	1,100	64,889.00	0.12
197	002126	银轮股份	1,300	64,740.00	0.12
198	600547	山东黄金	2,800	64,652.00	0.12
199	600418	江淮汽车	2,500	64,575.00	0.12
200	000960	锡业股份	1,500	64,035.00	0.12
201	601669	中国电建	13,400	62,980.00	0.11
202	600585	海螺水泥	3,700	62,715.00	0.11
203	002648	卫星化学	2,600	61,074.00	0.11
204	600141	兴发集团	1,300	61,061.00	0.11
205	600096	云天化	2,000	60,800.00	0.11
206	301358	湖南裕能	800	60,696.00	0.11
207	300316	晶盛机电	1,000	60,400.00	0.11
208	300015	爱尔眼科	7,300	60,298.00	0.11
209	002812	恩捷股份	900	60,219.00	0.11
210	002129	TCL 中环	5,000	60,100.00	0.11
211	601179	中国西电	4,000	59,680.00	0.11
212	600482	中国动力	1,800	59,040.00	0.11
213	688506	百利天恒	200	58,806.00	0.11
214	600346	恒力石化	3,300	58,443.00	0.11
215	002195	岩山科技	8,900	58,206.00	0.11
215	601868	中国能建	21,800	58,206.00	0.11
216	002558	巨人网络	2,100	57,876.00	0.11
217	000066	中国长城	3,000	57,150.00	0.10
218	600497	驰宏锌锗	4,700	56,917.00	0.10
219	300418	昆仑万维	1,400	56,504.00	0.10
220	688036	传音控股	956	56,356.20	0.10
221	600066	宇通客车	2,100	56,301.00	0.10
222	600580	卧龙电驱	1,700	56,270.00	0.10
223	000625	长安汽车	7,800	55,926.00	0.10
224	600895	张江高科	1,500	55,875.00	0.10
225	600157	永泰能源	34,200	55,062.00	0.10
226	600426	华鲁恒升	2,300	55,016.00	0.10
227	300803	指南针	600	55,002.00	0.10

228	300782	卓胜微	500	54,790.00	0.10
229	002532	天山铝业	5,100	54,723.00	0.10
230	600436	片仔癀	500	54,640.00	0.10
231	600221	海航控股	40,300	54,405.00	0.10
232	000157	中联重科	7,800	54,366.00	0.10
233	000933	神火股份	2,500	53,000.00	0.10
234	002340	格林美	8,000	52,880.00	0.10
235	600711	盛屯矿业	4,800	52,656.00	0.10
236	600011	华能国际	6,900	52,371.00	0.10
237	600048	保利发展	11,200	51,856.00	0.09
238	605499	东鹏饮料	420	51,840.60	0.09
239	603129	春风动力	200	51,160.00	0.09
240	002236	大华股份	3,100	51,119.00	0.09
241	600143	金发科技	3,300	50,985.00	0.09
242	600438	通威股份	4,200	50,862.00	0.09
243	600570	恒生电子	2,400	50,856.00	0.09
244	300017	网宿科技	3,900	50,739.00	0.09
245	600115	中国东航	13,300	50,673.00	0.09
246	002493	荣盛石化	4,700	50,525.00	0.09
247	002456	欧菲光	5,300	50,138.00	0.09
248	002131	利欧股份	10,500	49,875.00	0.09
249	600352	浙江龙盛	4,100	49,651.00	0.09
250	600886	国投电力	3,700	49,247.00	0.09
251	603659	璞泰来	1,700	49,181.00	0.09
252	002821	凯莱英	300	48,600.00	0.09
253	003816	中国广核	12,300	48,093.00	0.09
254	000301	东方盛虹	4,200	48,090.00	0.09
255	601360	三六零	5,500	47,795.00	0.09
256	601233	桐昆股份	2,200	47,630.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	4,100	47,273.00	0.09
258	002074	国轩高科	1,700	46,767.00	0.09
259	600026	中远海能	2,600	46,644.00	0.08
260	300759	康龙化成	1,600	46,288.00	0.08
261	300339	润和软件	1,200	46,212.00	0.08
262	688578	艾力斯	419	45,754.80	0.08
263	002472	双环传动	1,100	45,661.00	0.08
264	300001	特锐德	1,200	45,396.00	0.08
265	688047	龙芯中科	293	45,318.31	0.08
266	002555	三七互娱	2,400	45,288.00	0.08
267	000768	中航西飞	2,200	45,056.00	0.08
268	600196	复星医药	2,000	44,940.00	0.08
269	000975	山金国际	2,600	44,200.00	0.08
270	601111	中国国航	7,300	44,165.00	0.08

271	600009	上海机场	1,900	43,890.00	0.08
272	002517	恺英网络	2,700	43,875.00	0.08
273	600415	小商品城	4,300	43,688.00	0.08
274	300207	欣旺达	2,300	43,677.00	0.08
275	600029	南方航空	8,400	43,512.00	0.08
276	300458	全志科技	1,100	43,406.00	0.08
277	600219	南山铝业	10,800	43,092.00	0.08
278	688122	西部超导	685	43,024.85	0.08
279	002601	龙佰集团	2,600	42,848.00	0.08
280	601186	中国铁建	7,200	42,840.00	0.08
281	002595	豪迈科技	915	42,639.00	0.08
282	601877	正泰电器	1,700	42,619.00	0.08
283	600233	圆通速递	2,700	42,525.00	0.08
284	600674	川投能源	3,000	42,510.00	0.08
285	301236	软通动力	1,000	42,450.00	0.08
286	300115	长盈精密	1,500	41,910.00	0.08
287	601117	中国化学	5,700	41,895.00	0.08
288	002128	电投能源	1,800	41,616.00	0.08
289	300438	鹏辉能源	500	41,425.00	0.08
290	600372	中航机载	3,800	41,230.00	0.08
291	002920	德赛西威	500	40,750.00	0.07
292	002155	湖南黄金	1,700	40,579.00	0.07
293	600839	四川长虹	5,800	40,484.00	0.07
294	002465	海格通信	3,100	39,587.00	0.07
295	000963	华东医药	1,400	39,368.00	0.07
296	300568	星源材质	2,100	39,312.00	0.07
297	603650	彤程新材	400	39,192.00	0.07
298	688213	思特威	363	38,866.41	0.07
299	600741	华域汽车	2,500	38,800.00	0.07
300	300454	深信服	400	38,480.00	0.07
301	300347	泰格医药	800	38,400.00	0.07
302	000547	航天发展	2,000	38,300.00	0.07
303	002130	沃尔核材	2,000	37,920.00	0.07
304	688169	石头科技	397	37,703.09	0.07
305	300496	中科创达	600	37,074.00	0.07
306	300024	机器人	1,900	36,727.00	0.07
307	002497	雅化集团	1,800	36,666.00	0.07
308	688331	荣昌生物	281	36,603.06	0.07
309	000878	云南铜业	2,300	36,524.00	0.07
310	601021	春秋航空	800	36,464.00	0.07
311	688676	金盘科技	429	36,310.56	0.07
312	300474	景嘉微	600	36,288.00	0.07
313	300763	锦浪科技	400	36,140.00	0.07

314	000034	神州数码	1,300	36,075.00	0.07
315	300012	华测检测	2,600	36,036.00	0.07
316	001979	招商蛇口	5,600	36,008.00	0.07
317	002414	高德红外	2,700	35,802.00	0.07
318	002271	东方雨虹	3,000	35,610.00	0.06
319	603979	金诚信	600	35,418.00	0.06
320	300083	创世纪	2,600	35,412.00	0.06
321	002432	九安医疗	500	35,340.00	0.06
322	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.06
323	688188	柏楚电子	323	34,464.10	0.06
324	002444	巨星科技	1,100	34,210.00	0.06
325	603087	甘李药业	600	34,056.00	0.06
326	000733	振华科技	600	33,984.00	0.06
326	002756	永兴材料	600	33,984.00	0.06
327	300748	金力永磁	1,100	33,935.00	0.06
328	601319	中国人保	5,000	33,800.00	0.06
329	300073	当升科技	700	33,628.00	0.06
330	000661	长春高新	500	33,300.00	0.06
331	300142	沃森生物	2,500	32,475.00	0.06
332	002078	太阳纸业	2,600	32,474.00	0.06
333	600699	均胜电子	1,500	32,415.00	0.06
334	601615	明阳智能	2,800	32,396.00	0.06
335	300432	富临精工	1,600	32,144.00	0.06
336	000423	东阿阿胶	700	31,752.00	0.06
337	002252	上海莱士	7,300	31,682.00	0.06
338	600226	亨通股份	3,300	31,647.00	0.06
339	601677	明泰铝业	1,900	31,540.00	0.06
340	601800	中国交建	5,500	31,405.00	0.06
341	000002	万 科 A	10,600	31,376.00	0.06
342	300866	安克创新	300	31,350.00	0.06
343	600039	四川路桥	4,000	31,280.00	0.06
344	603606	东方电缆	740	30,717.40	0.06
345	688599	天合光能	2,171	30,654.52	0.06
346	300919	中伟新材	700	30,625.00	0.06
347	002025	航天电器	400	30,488.00	0.06
348	688617	惠泰医疗	167	30,320.52	0.06
349	688180	君实生物	894	30,235.08	0.06
350	688223	晶科能源	6,349	30,157.75	0.05
351	688390	固德威	273	29,623.23	0.05
352	002064	华峰化学	3,100	29,419.00	0.05
353	600588	用友网络	3,200	29,376.00	0.05
354	001965	招商公路	3,200	29,312.00	0.05
355	302132	中航成飞	500	29,160.00	0.05

356	000786	北新建材	1,600	28,944.00	0.05
357	002294	信立泰	900	28,701.00	0.05
358	601633	长城汽车	1,900	28,671.00	0.05
359	688065	凯赛生物	599	28,662.15	0.05
360	002831	裕同科技	800	28,448.00	0.05
361	300724	捷佳伟创	400	28,240.00	0.05
362	301550	斯菱智驱	300	27,429.00	0.05
363	300677	英科医疗	700	27,419.00	0.05
364	688266	泽璟制药	235	27,415.10	0.05
365	000519	中兵红箭	1,300	27,391.00	0.05
366	600516	方大炭素	4,400	27,148.00	0.05
367	600177	雅戈尔	3,600	27,108.00	0.05
368	601618	中国中冶	11,100	27,084.00	0.05
369	002176	江特电机	2,700	27,027.00	0.05
370	603806	福斯特	1,600	26,864.00	0.05
371	000623	吉林敖东	1,500	26,595.00	0.05
372	000617	中油资本	4,000	26,360.00	0.05
373	002318	久立特材	1,100	26,290.00	0.05
374	601607	上海医药	1,700	26,180.00	0.05
375	300558	贝达药业	400	26,028.00	0.05
376	605090	九丰能源	700	26,019.00	0.05
377	300699	光威复材	900	25,785.00	0.05
378	002085	万丰奥威	2,300	25,507.00	0.05
378	300251	光线传媒	2,300	25,507.00	0.05
379	600085	同仁堂	1,100	25,421.00	0.05
380	300832	新产业	600	25,200.00	0.05
381	002459	晶澳科技	3,100	25,110.00	0.05
382	002065	东华软件	3,500	24,990.00	0.05
383	000032	深桑达 A	1,000	24,950.00	0.05
384	600499	科达制造	1,800	24,840.00	0.05
385	002266	浙富控股	4,900	24,794.00	0.05
386	688005	容百科技	810	24,786.00	0.05
387	600515	海南机场	9,000	24,660.00	0.04
388	002044	美年健康	4,900	24,647.00	0.04
389	688608	恒玄科技	147	24,576.93	0.04
390	603596	伯特利	984	24,442.56	0.04
391	603260	合盛硅业	500	24,130.00	0.04
392	603605	珀莱雅	400	23,968.00	0.04
393	688472	阿特斯	2,214	23,955.48	0.04
394	002405	四维图新	3,700	23,939.00	0.04
395	300409	道氏技术	1,200	23,916.00	0.04
396	000400	许继电气	1,100	23,870.00	0.04
397	300003	乐普医疗	2,000	23,700.00	0.04

397	600803	新奥股份	1,500	23,700.00	0.04
398	601216	君正集团	5,300	23,638.00	0.04
399	000415	渤海租赁	5,800	23,606.00	0.04
400	000039	中集集团	2,900	23,519.00	0.04
401	300342	天银机电	500	23,500.00	0.04
402	600862	中航高科	1,300	23,439.00	0.04
403	000999	华润三九	1,030	23,164.70	0.04
404	002223	鱼跃医疗	900	23,094.00	0.04
405	000683	博源化工	4,000	23,040.00	0.04
405	600521	华海药业	1,600	23,040.00	0.04
406	600312	平高电气	1,300	22,958.00	0.04
407	603766	隆鑫通用	1,900	22,667.00	0.04
408	600018	上港集团	4,800	22,656.00	0.04
408	600704	物产中大	4,800	22,656.00	0.04
409	300122	智飞生物	1,900	22,211.00	0.04
410	000967	盈峰环境	2,100	22,113.00	0.04
411	600332	白云山	1,100	22,044.00	0.04
412	600323	瀚蓝环境	800	21,968.00	0.04
413	600765	中航重机	1,700	21,964.00	0.04
414	600166	福田汽车	7,500	21,825.00	0.04
415	000830	鲁西化工	1,800	21,600.00	0.04
416	000887	中鼎股份	1,200	21,468.00	0.04
417	600153	建发股份	2,700	21,411.00	0.04
418	002410	广联达	2,600	21,216.00	0.04
419	688114	华大智造	409	20,891.72	0.04
420	688235	百济神州	82	20,878.02	0.04
421	002007	华兰生物	1,700	20,723.00	0.04
422	603486	科沃斯	400	20,300.00	0.04
423	600486	扬农化工	400	20,280.00	0.04
424	688116	天奈科技	520	19,864.00	0.04
425	600316	洪都航空	700	19,558.00	0.04
426	002389	航天彩虹	1,100	19,547.00	0.04
427	002603	以岭药业	1,300	19,500.00	0.04
428	688009	中国通号	4,073	19,387.48	0.04
429	600398	海澜之家	3,700	19,351.00	0.04
430	601018	宁波港	6,100	19,215.00	0.03
431	601000	唐山港	4,600	19,090.00	0.03
432	603568	伟明环保	1,240	19,071.20	0.03
433	600208	衢州发展	6,700	18,961.00	0.03
434	600998	九州通	4,000	18,760.00	0.03
435	600170	上海建工	8,400	18,648.00	0.03
436	600161	天坛生物	1,600	18,528.00	0.03
437	600008	首创环保	6,800	18,496.00	0.03

438	600529	山东药玻	1,000	18,450.00	0.03
439	000932	华菱钢铁	5,300	18,391.00	0.03
440	000738	航发控制	1,000	18,290.00	0.03
441	600820	隧道股份	3,500	18,235.00	0.03
442	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.03
443	603816	顾家家居	800	17,888.00	0.03
444	601238	广汽集团	3,500	17,780.00	0.03
445	688063	派能科技	333	17,738.91	0.03
446	300676	华大基因	500	17,530.00	0.03
447	603885	吉祥航空	1,700	17,493.00	0.03
448	300896	爱美客	200	17,440.00	0.03
449	300118	东方日升	1,400	17,430.00	0.03
450	002607	中公教育	9,600	17,280.00	0.03
451	688166	博瑞医药	492	17,224.92	0.03
452	600763	通策医疗	500	16,940.00	0.03
453	688303	大全能源	946	16,488.78	0.03
454	601567	三星电气	1,100	16,434.00	0.03
455	603392	万泰生物	600	16,182.00	0.03
455	603939	益丰药房	900	16,182.00	0.03
456	600535	天士力	1,200	15,876.00	0.03
457	601880	辽港股份	11,400	15,732.00	0.03
458	600511	国药股份	600	15,624.00	0.03
459	300049	福瑞医科	400	15,552.00	0.03
460	002244	滨江集团	2,000	15,200.00	0.03
461	600038	中直股份	600	15,174.00	0.03
462	600816	建元信托	6,200	15,128.00	0.03
463	300573	兴齐眼药	364	14,836.64	0.03
464	002120	韵达股份	2,300	14,628.00	0.03
465	300144	宋城演艺	2,500	14,525.00	0.03
466	601155	新城控股	1,400	14,364.00	0.03
467	000833	粤桂股份	600	14,052.00	0.03
468	300100	双林股份	500	13,890.00	0.03
469	000998	隆平高科	1,800	13,572.00	0.02
470	600064	南京高科	1,900	13,547.00	0.02
471	601866	中远海发	6,100	13,481.00	0.02
472	600635	大众公用	3,000	12,840.00	0.02
473	002544	普天科技	700	12,754.00	0.02
474	600655	豫园股份	3,100	12,741.00	0.02
475	300457	赢合科技	600	12,648.00	0.02
476	600754	锦江酒店	700	12,593.00	0.02
477	000035	中国天楹	2,600	12,558.00	0.02
478	300601	康泰生物	1,100	12,474.00	0.02
479	603899	晨光股份	600	12,378.00	0.02

480	600258	首旅酒店	1,100	12,012.00	0.02
481	600004	白云机场	1,600	11,616.00	0.02
482	600663	陆家嘴	1,800	11,304.00	0.02
483	600859	王府井	1,200	11,016.00	0.02
484	002091	江苏国泰	1,500	10,845.00	0.02
485	300070	碧水源	3,300	10,527.00	0.02
486	600864	哈投股份	2,000	10,380.00	0.02
487	000069	华侨城 A	6,100	10,004.00	0.02
488	301078	孩子王	1,400	9,464.00	0.02
489	002292	奥飞娱乐	1,400	9,184.00	0.02
490	603833	欧派家居	300	9,033.00	0.02
491	600325	华发股份	3,500	8,085.00	0.01
492	002891	中宠股份	300	8,016.00	0.01
493	002572	索菲亚	900	6,570.00	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	300002	神州泰岳	3,200	24,992.00	0.05

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	300750	宁德时代	617,067.00	1.24
2	600519	贵州茅台	428,746.00	0.86
3	601318	中国平安	417,751.00	0.84
4	601899	紫金矿业	406,198.00	0.81
5	300308	中际旭创	383,862.00	0.77
6	688498	源杰科技	317,000.00	0.63
7	300502	新易盛	315,914.00	0.63
8	600036	招商银行	296,275.00	0.59
9	688012	中微公司	277,820.68	0.56
10	000333	美的集团	272,744.00	0.55
11	301308	江波龙	215,524.00	0.43
12	600900	长江电力	213,872.00	0.43
13	688525	佰维存储	199,134.00	0.40
14	601166	兴业银行	197,986.00	0.40
15	300059	东方财富	189,467.00	0.38
16	002371	北方华创	183,378.00	0.37
17	002475	立讯精密	177,268.00	0.35
18	600030	中信证券	165,332.00	0.33

19	688347	华虹宏力	159,448.50	0.32
20	300274	阳光电源	158,003.00	0.32

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	300750	宁德时代	677,179.00	1.36
2	300308	中际旭创	618,413.00	1.24
3	600519	贵州茅台	423,077.00	0.85
4	300502	新易盛	407,891.40	0.82
5	601318	中国平安	367,193.00	0.73
6	601899	紫金矿业	363,166.00	0.73
7	000333	美的集团	293,475.00	0.59
8	600036	招商银行	282,838.00	0.57
9	600919	江苏银行	264,845.00	0.53
10	688256	寒武纪	249,370.00	0.50
11	688008	澜起科技	226,528.00	0.45
12	688012	中微公司	203,752.00	0.41
13	002475	立讯精密	202,014.00	0.40
14	600900	长江电力	199,468.00	0.40
15	601166	兴业银行	183,680.00	0.37
16	300059	东方财富	162,919.00	0.33
17	601088	中国神华	162,408.00	0.33
18	002594	比亚迪	160,775.00	0.32
19	300274	阳光电源	157,895.00	0.32
20	002371	北方华创	157,622.00	0.32

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,059,253.94
卖出股票收入（成交）总额	19,541,515.70

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	503,240.96	0.92
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）	6,000.18	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	509,241.14	0.93

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	019827	26 国债 01	5,000	503,240.96	0.92
2	113704	春风转债	30	3,000.14	0.01
3	111025	圣泉转债	30	3,000.04	0.01

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

本报告期内，本基金国债期货投资情况符合既定的投资政策和投资目的。

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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同约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	6,086.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	81,971.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,058.72

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 A500 指数 A	570	20,072.31	1,974.07	0.02	11,439,240.19	99.98
长城中证 A500 指数 C	985	29,315.25	6,807,589.24	23.58	22,067,935.85	76.42
合计	1,555	25,927.16	6,809,563.31	16.89	33,507,176.04	83.11

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	0.99	0.0000
	长城中证 A500 指数 C	25,492.47	0.0883
	合计	25,493.46	0.0632

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
本报告期期初基金 份额总额	11,650,774.33	29,302,119.62
本报告期基金总申 购份额	6,367,464.75	21,531,337.91
减：本报告期基金 总赎回份额	6,577,024.82	21,957,932.44
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	11,441,214.26	28,875,525.09

§ 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：

（1）自 2026 年 3 月 25 日起，邱春杨不再担任公司总经理，聘任祝函为公司总经理，同时解聘其公司督察长职务。在公司新任督察长正式任职之前，由祝函代为履行公司督察长职务。

（2）自 2026 年 6 月 23 日起，李建军正式任职公司督察长，祝函不再代为履行督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
国信证券	2	16,837,515.52	43.62	3,298.56	43.62	未变更
招商证券股份有限公司	4	9,247,226.69	23.96	1,811.25	23.95	未变更
华泰证券	1	4,288,399.00	11.11	840.15	11.11	未变更
国泰海通	2	3,517,553.43	9.11	688.83	9.11	本期报告退租2个
长江证券	1	1,898,610.00	4.92	371.98	4.92	未变更
广发证券	1	1,513,200.00	3.92	296.52	3.92	未变更
兴业证券	1	967,136.00	2.51	189.44	2.51	未变

						更
东方证券	3	331,129.00	0.86	64.90	0.86	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
国联民生 证券	1	-	-	-	-	未变更
国投证券	1	-	-	-	-	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
华西证券	1	-	-	-	-	未变更
华源证券	1	-	-	-	-	未变更
华鑫证券	1	-	-	-	-	未变更
联讯证券	2	-	-	-	-	未变更
平安证券	1	-	-	-	-	未变更
上海证券	1	-	-	-	-	未变更
申万宏源	1	-	-	-	-	未变更
首创证券	1	-	-	-	-	未变

						更
太平洋证券	2	-	-	-	-	未变更
天风证券	2	-	-	-	-	未变更
万和证券	-	-	-	-	-	本期报告 退租 2 个
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
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
中信证券	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 基金租用或者通过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 (%)
国信证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	1,700,798. 00	100.00	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
财通证	-	-	-	-	-	-

券						
长城证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联民 生证券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 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	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城中证 A500 指数型证券投资基金基金经理变更公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 2 月 3 日
2	长城基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 27 日
3	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（2025 年度）	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 30 日
4	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 6 月 24 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

2026 年 8 月 31 日