

长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 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20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06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	52

§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	56
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	长江中证 A500 指数增强发起	
基金主代码	024352	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 09 月 15 日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
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	42,244,011.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江中证 A500 指数增强发起 A	长江中证 A500 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	024352	024353
报告期末下属分级基金的份额总额	35,321,213.06 份	6,922,798.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金,在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金,力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%;同时通过量化策略进行投资组合管理,力争实现超越标的指数的投资回报,谋求基金资产的长期增值。本基金的主要投资策略包括: 1、股票投资策略; 2、债券投资策略; 3、衍生品投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、可转换债券、可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

	本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	--

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		长江证券（上海）资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨	王小飞
	联系电话	4001-166-866	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4001-166-866	021-60637228
传真		021-65779500	021-60635778
注册地址		上海市虹口区新建路 200 号 B 栋 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200080	100033
法定代表人		张波	张金良

注：自 2026 年 8 月 4 日起，长江证券（上海）资产管理有限公司法定代表人变更为张波先生。

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.cjzcgl.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 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 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	长江中证 A500 指数增强发起 A	长江中证 A500 指数增强发起 C
本期已实现收益	4,066,542.14	798,235.70
本期利润	4,680,126.09	895,547.57
加权平均基金份额本期利润	0.1039	0.1018
本期加权平均净值利润率	9.90%	9.72%
本期基金份额净值增长率	8.61%	8.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	3,008,621.58	565,729.94
期末可供分配基金份额利润	0.0852	0.0817
期末基金资产净值	38,933,957.25	7,606,405.89
期末基金份额净值	1.1023	1.0987
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	10.23%	9.87%

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）期末可供分配利润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）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（4）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。

3.2 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

长江中证 A500 指数增强发起 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	10.71%	1.36%	13.54%	1.34%	-2.83%	0.02%
过去六个月	8.61%	1.22%	11.34%	1.22%	-2.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.23%	1.03%	15.47%	1.13%	-5.24%	-0.10%

长江中证 A500 指数增强发起 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	10.59%	1.36%	13.54%	1.34%	-2.95%	0.02%
过去六个月	8.39%	1.22%	11.34%	1.22%	-2.95%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.87%	1.03%	15.47%	1.13%	-5.60%	-0.10%

注：（1）本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%；（2）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日。

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

长江中证A500指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年09月15日-2026年06月30日)



长江中证A500指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年09月15日-2026年06月30日)



注：（1）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年；（2）本基金建仓期为基金合同生效日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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

长江证券（上海）资产管理有限公司于 2014 年 9 月 16 日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江惠盈 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江楚财一年持有期混合型发起式证券投资基金、长江乐睿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长江安悦利率债债券型证券投资基金、长江长扬混合型发起式证券投资基金、长江长宏混合型发起式证券投资基金、长江 90 天持有期债券型证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江旭日混合型证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江医药健康精选混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金和长江货币管家货币市场基金。

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		
张帅	本基金的 基金经理	2025-09-15	-	9 年	国籍：中国。博士研究生，具备基金从业资格。曾任天翼电子商务有限公司财富管理部见习总裁，长江证券股份有限公司互联网金融总部金融产品工程师、证券投资部量化投资总监，长江证券（上海）资产管理有限公司综合管理部战略支持岗、量化投资部研究员。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
秦昌贵	本基金的 基金经 理、量化 投资部总 经理	2025-09-15	-	21 年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任长江证券有限责任公司衍生产品部研究员，长江证券股份有限公司资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管，长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，创金合信基金管理有限公司量化投资部副总监、CTA 投资部总监。现任长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式

					证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；（2）证券从业的含义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（1）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（2）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交

易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在 1% 数量级及以下。

（3）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年股票市场整体呈震荡上行走势，主要宽基指数中，中盘指数（中证 500、中证 1000）表现强于大盘指数（沪深 300）与小盘指数（中证 2000）。在中证 A500 指数的因子表现层面，流动性、动量、成长等因子超额表现较强，价值、杠杆、质量等因子表现较弱。

报告期内，本基金采用指数增强型投资策略，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。指数增强策略是以标的指数成份股在标的指数中的基准权重为基础，利用量化投资模型、在有限范围内对指数成份股进行超配或低配或在有限范围内配置其他股票，以构建股票组合，力争实现指数增强效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1023 元，C 类基金份额净值为 1.0987 元。本报告期内，A 类基金份额净值增长率为 8.61%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；C 类基金份额净值增长率为 8.39%，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

展望后市，随着半年度财报的陆续公布，上市公司成长预期的兑现程度将影响投资者对企业盈利能力及质量的观点再平衡，上市公司的真实盈利能力及其稳定性将是市场关注点。中证 A500 指数采用“优选三级行业龙头+互联互通+ESG 评价”的编制思路，行

业分布均衡，汇聚了各细分领域的新兴龙头企业。在标的指数成份股分布基础上，我们进一步采用量化投资模型和指数增强技术构建股票组合，力争实现超越标的指数的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《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。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券

投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金
报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,892,165.58	17,320,953.67
结算备付金		780,104.83	1,272,254.38
存出保证金		379,610.40	840,381.60
交易性金融资产	6.4.7.2	40,732,808.61	79,704,824.95
其中：股票投资		40,732,808.61	79,704,824.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		99,953.43	595,792.58
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		46,884,642.85	99,734,207.18
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		—	—
应付赎回款		210,644.43	5,540,097.02
应付管理人报酬		30,615.52	68,245.23
应付托管费		5,740.41	12,795.97
应付销售服务费		2,605.31	5,605.47
应付投资顾问费		—	—
应交税费		15,018.88	12,903.71

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	79,655.16	80,000.00
负债合计		344,279.71	5,719,647.40
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	42,244,011.87	92,651,888.58
未分配利润	6.4.7.8	4,296,351.27	1,362,671.20
净资产合计		46,540,363.14	94,014,559.78
负债和净资产总计		46,884,642.85	99,734,207.18

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 42,244,011.87 份。其中长江中证 A500 指数增强发起 A 基金份额净值 1.1023 元，基金份额总额 35,321,213.06 份；长江中证 A500 指数增强发起 C 基金份额净值 1.0987 元，基金份额总额 6,922,798.81 份。

6.2 利润表

会计主体：长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		5,946,714.77
1. 利息收入		13,874.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,874.64
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,220,691.76

其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,218,270.79
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.11	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.13	668,894.36
股利收益	6.4.7.14	333,526.61
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	710,895.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,252.55
减：二、营业总支出		371,041.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	226,206.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,413.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18,527.64
4. 投资顾问费		—
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 信用减值损失	6.4.7.17	—
7. 税金及附加		2,408.93
8. 其他费用	6.4.7.18	81,483.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,575,673.66
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,575,673.66
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		5,575,673.66

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	92,651,888.58	1,362,671.20	94,014,559.78
二、本期期初净资产	92,651,888.58	1,362,671.20	94,014,559.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,407,876.71	2,933,680.07	-47,474,196.64
（一）、综合收益总额	-	5,575,673.66	5,575,673.66
（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）	-50,407,876.71	-2,641,993.59	-53,049,870.30
其中：1. 基金申购款	5,790,202.59	315,415.19	6,105,617.78
2. 基金赎回款	-56,198,079.30	-2,957,408.78	-59,155,488.08
（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、本期期末净资产	42,244,011.87	4,296,351.27	46,540,363.14

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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：

张波	潘山	何永生
_____	_____	_____
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

长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2025]999 号文《关于准予长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江中证 A500 指数增

强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，基金存续期限为不定期，首次设立募集资金为 189,377,136.19 元，认购资金在募集期间产生的利息 49,139.38 元，合计为 189,426,275.57 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 189,426,275.57 份，业经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）众环验字（2025）0100029 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 09 月 15 日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数（即中证 A500 指数）的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券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%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下简称“企业会计准则”），以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业

实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、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。

6.4.5 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通

知》、财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税；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。存款利息收入不征收增值税；金融机构开展的质押式买入返售金融资产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；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。

公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的 A 股上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司提出申请，由中国证券登记结算有限责任公司向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国证券登记结算有限责任公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(5) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

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 06 月 30 日
活期存款	2,987,238.62
等于：本金	2,986,947.82
加：应计利息	290.80
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	1,904,926.96
等于：本金	1,904,878.36
加：应计利息	48.60
减：坏账准备	-
合计	4,892,165.58

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪服务机构基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	39,047,759.11	-	40,732,808.61	1,685,049.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	39,047,759.11	-	40,732,808.61	1,685,049.50

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,003,020.00	-	-	-
--股指期货	3,003,020.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,003,020.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2612	IC2612	1	1,708,480.00	130,760.00
IF2609	IF2609	1	1,454,940.00	29,640.00
合计				160,400.00
减：可抵销期货暂收款				160,400.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他应付	312.00
合计	79,655.16

6.4.7.7 实收基金**长江中证 A500 指数增强发起 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	75,667,754.39	75,667,754.39
本期申购	3,968,349.92	3,968,349.92
本期赎回（以“-”号填列）	-44,314,891.25	-44,314,891.25
本期末	35,321,213.06	35,321,213.06

长江中证 A500 指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,984,134.19	16,984,134.19
本期申购	1,821,852.67	1,821,852.67
本期赎回（以“-”号填列）	-11,883,188.05	-11,883,188.05
本期末	6,922,798.81	6,922,798.81

注：上述申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

长江中证 A500 指数增强发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	542,177.36	587,865.80	1,130,043.16
本期期初	542,177.36	587,865.80	1,130,043.16
本期利润	4,066,542.14	613,583.95	4,680,126.09
本期基金份额交易产生的变动数	-1,600,097.92	-597,327.14	-2,197,425.06
其中：基金申购款	250,490.09	-39,291.47	211,198.62
基金赎回款	-1,850,588.01	-558,035.67	-2,408,623.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,008,621.58	604,122.61	3,612,744.19

长江中证 A500 指数增强发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	100,879.04	131,749.00	232,628.04
本期期初	100,879.04	131,749.00	232,628.04
本期利润	798,235.70	97,311.87	895,547.57
本期基金份额交易产生的变动数	-333,384.80	-111,183.73	-444,568.53
其中：基金申购款	105,612.84	-1,396.27	104,216.57
基金赎回款	-438,997.64	-109,787.46	-548,785.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	565,729.94	117,877.14	683,607.08

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	7,541.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,222.61
结算备付金利息收入	5,110.53
其他	-
合计	13,874.64

6.4.7.10 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	151,479,503.37
减：卖出股票成本总额	147,118,156.12
减：交易费用	143,076.46
买卖股票差价收入	4,218,270.79

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货本期收益	668,894.36

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	333,526.61
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	333,526.61

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	756,362.62
——股票投资	756,362.62
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	-47,000.00
——权证投资	—
——期货投资	-47,000.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-1,533.20
合计	710,895.82

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,252.55
合计	1,252.55

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	2,140.64
合计	81,483.80

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须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**

本基金本报告期不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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人母公司、基金销售机构、证券经纪服务机构

中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江期货股份有限公司(以下简称“长江期货”)	基金管理人母公司的子公司、期货经纪服务机构

注：下述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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	258,869,280.53	100.00%

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	50,719.09	100.00%	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示，交易佣金的计算方式、佣金计算比率公允；（2）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	226,206.95

其中：应支付销售机构的客户维护费	92,119.70
应支付基金管理人的净管理费	134,087.25

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,413.79

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
-------------	---------------------------------------

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江中证 A500 指数增强发起 A	长江中证 A500 指数增强发起 C	合计
长江证券股份有限公司	—	15,131.17	15,131.17
长江证券（上海）资产管理有限公司	—	0.00	0.00
中国建设银行股份有限公司	—	3,009.40	3,009.40
合计	—	18,140.57	18,140.57

注：（1）本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的基金销售服务年费率为 0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

（2）销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期末未发生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。

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

本基金本报告期未发生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。

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

长江中证 A500 指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,005,444.99
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,005,444.99
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.33%

注：（1）基金管理人运用固有资金投资本基金，适用费率符合基金合同和招募说明书的相关约定；（2）申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额；（3）报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额；（4）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,987,238.62	7,541.50
长江证券股份有限公司	1,904,926.96	1,222.61

注：（1）上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按约定利率计息；上述证券交易结算资金由证券经纪服务机构长江证券股份有限公司保管，按约定利率计息。（2）本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 15 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金委托长江期货作为本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同。本基金支付给长江期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2026 年 06 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额（2025 年 12 月 31 日：无）。于报告期内，本基金当期交易手续费支出 251.28 元（2025 年同期：无）。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于长江期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2026 年 06 月 30 日，本基金存放于长江期货的结算备付金余额（不含应计利息）为 779,831.00 元，存出保证金余额为 379,610.40 元（2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 1,271,141.74 元，存出保证金余额 840,381.60 元）。于报告期内，本基金存放于长江期货的结算备付金利息收入为 5,110.48 元（2025 年同期：无）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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	2026-06-29	筹划发行股	832.00	2026-07-13	890.99	200	69,575.40	166,400.00	-

			份及支付现金购买资产并募集配套资金							
688121	*ST 卓然	2026-05-06	无法在法定期限内披露定期报告	6.48	2026-07-07	5.18	23,200	146,066.91	150,336.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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为 0 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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

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。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市，持有资产流动性高，本基金可通过卖出资产方式应对流动性需求。本基金管理人每日预测本基金的流动性管理，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的检测和分析。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,892,165.58	-	-	-	4,892,165.58
结算备付金	780,104.83	-	-	-	780,104.83
存出保证金	379,610.40	-	-	-	379,610.40
交易性金融资产	-	-	-	40,732,808.61	40,732,808.61
应收申购款	-	-	-	99,953.43	99,953.43
资产总计	6,051,880.81	-	-	40,832,762.04	46,884,642.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,644.43	210,644.43
应付管理人报酬	-	-	-	30,615.52	30,615.52
应付托管费	-	-	-	5,740.41	5,740.41
应付销售服务费	-	-	-	2,605.31	2,605.31
应交税费	-	-	-	15,018.88	15,018.88
其他负债	-	-	-	79,655.16	79,655.16
负债总计	-	-	-	344,279.71	344,279.71
利率敏感度缺口	6,051,880.81	-	-	40,488,482.33	46,540,363.14
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,320,953.67	-	-	-	17,320,953.67

结算备付金	1, 272, 254. 38	-	-	-	1, 272, 254. 38
存出保证金	840, 381. 60	-	-	-	840, 381. 60
交易性金融资产	-	-	-	79, 704, 824. 95	79, 704, 824. 95
应收申购款	-	-	-	595, 792. 58	595, 792. 58
资产总计	19, 433, 589. 65	-	-	80, 300, 617. 53	99, 734, 207. 18
负债					
应付赎回款	-	-	-	5, 540, 097. 02	5, 540, 097. 02
应付管理人报酬	-	-	-	68, 245. 23	68, 245. 23
应付托管费	-	-	-	12, 795. 97	12, 795. 97
应付销售服务费	-	-	-	5, 605. 47	5, 605. 47
应交税费	-	-	-	12, 903. 71	12, 903. 71
其他负债	-	-	-	80, 000. 00	80, 000. 00
负债总计	-	-	-	5, 719, 647. 40	5, 719, 647. 40
利率敏感度缺口	19, 433, 589. 65	-	-	74, 580, 970. 13	94, 014, 559. 78

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金本报告期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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及

银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 06 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	40,732,808.61	87.52	79,704,824.95	84.78
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	40,732,808.61	87.52	79,704,824.95	84.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变。		
	以下分析中，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上涨 5%	2,267,754.29	2,153,422.74
	业绩比较基准下跌 5%	-2,267,754.29	-2,153,422.74

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，组合业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	40,416,072.61	79,281,742.95
第二层次	316,736.00	423,082.00
第三层次	—	—
合计	40,732,808.61	79,704,824.95

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	40,732,808.61	86.88
	其中：股票	40,732,808.61	86.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	5,672,270.41	12.10
8	其他各项资产	479,563.83	1.02
9	合计	46,884,642.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	2,609,272.00	5.61
C	制造业	30,153,105.95	64.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	191,900.00	0.41
E	建筑业	37,061.00	0.08
F	批发和零售业	215,572.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,245,863.00	2.68
H	住宿和餐饮业	5,397.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,341,119.10	5.03
J	金融业	1,314,371.00	2.82
K	房地产业	167,530.00	0.36
L	租赁和商务服务业	52,490.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	20,251.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	264,132.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	13,581.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	23,079.00	0.05
S	综合	150,456.00	0.32
	合计	38,805,180.05	83.38

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	3,444.00	0.01
B	采矿业	2,162.00	0.00
C	制造业	1,628,154.56	3.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,590.00	0.05
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	50,468.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,850.00	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,666.00	0.24
J	金融业	100,304.00	0.22
K	房地产业	2,996.00	0.01
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	994.00	0.00
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	1,927,628.56	4.14

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	300308	中际旭创	2,500	3,175,000.00	6.82
2	300502	新易盛	3,760	2,282,320.00	4.90
3	601899	紫金矿业	46,900	1,179,066.00	2.53
4	688041	海光信息	3,117	1,154,225.10	2.48
5	002371	北方华创	1,200	1,061,472.00	2.28
6	688256	寒武纪	600	957,330.00	2.06
7	300274	阳光电源	5,900	938,218.00	2.02
8	688012	中微公司	1,898	889,213.00	1.91
9	688981	中芯国际	5,203	826,340.46	1.78
10	600887	伊利股份	32,100	769,116.00	1.65
11	300750	宁德时代	1,900	746,719.00	1.60
12	600660	福耀玻璃	14,200	716,248.00	1.54
13	300124	汇川技术	10,300	683,199.00	1.47
14	600276	恒瑞医药	11,200	582,848.00	1.25
15	600690	海尔智家	28,100	573,521.00	1.23
16	002475	立讯精密	8,100	570,240.00	1.23
17	000975	山金国际	31,900	542,300.00	1.17
18	000538	云南白药	11,300	535,281.00	1.15
19	300760	迈瑞医疗	3,800	516,154.00	1.11
20	002594	比亚迪	6,400	510,080.00	1.10
21	603288	海天味业	14,920	494,747.20	1.06
22	603986	兆易创新	600	489,000.00	1.05
23	002352	顺丰控股	15,300	478,278.00	1.03
24	601766	中国中车	87,600	455,520.00	0.98
25	002415	海康威视	13,300	454,860.00	0.98
26	600036	招商银行	12,600	447,300.00	0.96
27	601166	兴业银行	27,000	447,120.00	0.96
28	002384	东山精密	1,700	445,995.00	0.96
29	688008	澜起科技	1,400	433,860.00	0.93
30	300604	长川科技	1,200	409,704.00	0.88
31	600028	中国石化	91,300	407,198.00	0.87
32	600309	万华化学	5,400	369,414.00	0.79
33	300394	天孚通信	1,160	351,108.80	0.75
34	000858	五粮液	4,700	347,800.00	0.75
35	002444	巨星科技	11,100	345,210.00	0.74
36	601021	春秋航空	6,900	314,502.00	0.68
37	688111	金山办公	1,400	298,270.00	0.64
38	600026	中远海能	16,300	292,422.00	0.63
39	002202	金风科技	12,100	289,190.00	0.62
40	002558	巨人网络	10,300	283,868.00	0.61
41	002156	通富微电	3,700	280,719.00	0.60
42	688002	睿创微纳	1,800	278,442.00	0.60
43	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.60

44	002266	浙富控股	52,200	264,132.00	0.57
45	000333	美的集团	3,400	256,802.00	0.55
46	600436	片仔癀	2,300	251,344.00	0.54
47	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.51
48	002126	银轮股份	4,600	229,080.00	0.49
49	600885	宏发股份	6,300	217,287.00	0.47
50	000725	京东方 A	23,400	203,112.00	0.44
51	600050	中国联通	47,200	188,800.00	0.41
52	600879	航天电子	8,400	178,836.00	0.38
53	300857	协创数据	500	169,950.00	0.37
54	300059	东方财富	8,300	169,154.00	0.36
55	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.36
56	000100	TCL 科技	26,900	156,558.00	0.34
57	603993	洛阳钼业	8,900	156,195.00	0.34
58	002129	TCL 中环	12,500	150,250.00	0.32
59	300408	三环集团	900	150,210.00	0.32
60	300475	香农芯创	500	150,000.00	0.32
61	301308	江波龙	200	140,760.00	0.30
62	600183	生益科技	800	138,720.00	0.30
63	002463	沪电股份	900	137,520.00	0.30
64	600150	中国船舶	4,000	135,160.00	0.29
65	688347	华虹宏力	400	134,520.00	0.29
66	300661	圣邦股份	900	129,132.00	0.28
67	002138	顺络电子	1,700	124,270.00	0.27
68	300433	蓝思科技	2,300	123,418.00	0.27
69	002353	杰瑞股份	800	122,000.00	0.26
70	688469	芯联集成	10,913	115,786.93	0.25
71	000657	中钨高新	1,200	114,864.00	0.25
72	601816	京沪高铁	25,200	114,156.00	0.25
73	002831	裕同科技	3,165	112,547.40	0.24
74	300450	先导智能	2,700	109,944.00	0.24
75	002601	龙佰集团	6,600	108,768.00	0.23
76	002080	中材科技	1,200	108,000.00	0.23
77	300442	润泽科技	1,300	107,991.00	0.23
78	600352	浙江龙盛	8,900	107,779.00	0.23
79	002600	领益智造	6,100	105,774.00	0.23
80	688331	荣昌生物	800	104,208.00	0.22
81	688235	百济神州	400	101,844.00	0.22
82	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.21
83	600372	中航机载	9,100	98,735.00	0.21
84	300573	兴齐眼药	2,300	93,748.00	0.20
85	605090	九丰能源	2,400	89,208.00	0.19
86	002414	高德红外	6,700	88,842.00	0.19

87	603766	隆鑫通用	7,300	87,089.00	0.19
88	000833	粤桂股份	3,700	86,654.00	0.19
89	002028	思源电气	500	86,500.00	0.19
90	300432	富临精工	4,300	86,387.00	0.19
91	300677	英科医疗	2,200	86,174.00	0.19
92	300342	天银机电	1,800	84,600.00	0.18
93	600064	南京高科	11,700	83,421.00	0.18
94	300100	双林股份	2,900	80,562.00	0.17
95	600663	陆家嘴	12,800	80,384.00	0.17
96	600711	盛屯矿业	7,200	78,984.00	0.17
97	300558	贝达药业	1,200	78,084.00	0.17
98	300049	福瑞医科	2,000	77,760.00	0.17
99	300409	道氏技术	3,900	77,727.00	0.17
100	300454	深信服	800	76,960.00	0.17
101	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.16
102	300054	鼎龙股份	700	74,179.00	0.16
103	301550	斯菱智驱	800	73,144.00	0.16
104	300115	长盈精密	2,600	72,644.00	0.16
105	600635	大众公用	16,900	72,332.00	0.16
106	600875	东方电气	2,400	69,048.00	0.15
107	600570	恒生电子	3,200	67,808.00	0.15
108	688676	金盘科技	800	67,712.00	0.15
109	600487	亨通光电	600	65,604.00	0.14
110	301078	孩子王	9,700	65,572.00	0.14
111	600673	东阳光	1,900	63,802.00	0.14
112	600160	巨化股份	1,200	63,612.00	0.14
113	000426	兴业银锡	1,900	62,624.00	0.13
114	300496	中科创达	1,000	61,790.00	0.13
115	688099	晶晨股份	589	60,608.10	0.13
116	300014	亿纬锂能	900	58,527.00	0.13
117	600988	赤峰黄金	2,200	57,904.00	0.12
118	002340	格林美	8,700	57,507.00	0.12
119	300003	乐普医疗	4,800	56,880.00	0.12
120	000988	华工科技	300	55,383.00	0.12
121	601628	中国人寿	1,500	53,025.00	0.11
122	002410	广联达	6,400	52,224.00	0.11
123	000400	许继电气	2,300	49,910.00	0.11
124	300207	欣旺达	2,600	49,374.00	0.11
125	300033	同花顺	200	48,200.00	0.10
126	688126	沪硅产业	1,200	47,868.00	0.10
127	603501	豪威集团	500	47,425.00	0.10
128	002916	深南电路	100	45,790.00	0.10
129	600989	宝丰能源	2,100	42,693.00	0.09

130	000977	浪潮信息	600	42,000.00	0.09
131	600547	山东黄金	1,800	41,562.00	0.09
132	300136	信维通信	300	35,775.00	0.08
133	002273	水晶光电	1,000	35,480.00	0.08
134	601233	桐昆股份	1,600	34,640.00	0.07
135	002155	湖南黄金	1,400	33,418.00	0.07
136	601318	中国平安	700	33,418.00	0.07
137	600482	中国动力	1,000	32,800.00	0.07
138	600066	宇通客车	1,200	32,172.00	0.07
139	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.07
140	600011	华能国际	4,000	30,360.00	0.07
141	300001	特锐德	800	30,264.00	0.07
142	002074	国轩高科	1,100	30,261.00	0.07
143	603979	金诚信	500	29,515.00	0.06
144	000301	东方盛虹	2,500	28,625.00	0.06
145	002493	荣盛石化	2,600	27,950.00	0.06
146	600009	上海机场	1,200	27,720.00	0.06
147	600415	小商品城	2,600	26,416.00	0.06
148	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.06
149	600549	厦门钨业	300	25,560.00	0.05
150	605499	东鹏饮料	200	24,686.00	0.05
151	300316	晶盛机电	400	24,160.00	0.05
152	688777	中控技术	200	23,500.00	0.05
153	601728	中国电信	4,300	22,317.00	0.05
154	300782	卓胜微	200	21,916.00	0.05
155	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.05
156	000786	北新建材	1,200	21,708.00	0.05
157	688036	传音控股	366	21,575.70	0.05
158	688213	思特威	200	21,414.00	0.05
159	300759	康龙化成	700	20,251.00	0.04
160	688271	联影医疗	200	20,246.00	0.04
161	000001	平安银行	2,000	20,100.00	0.04
162	601668	中国建筑	4,600	19,964.00	0.04
163	300458	全志科技	500	19,730.00	0.04
164	688396	华润微	200	19,510.00	0.04
165	601658	邮储银行	3,900	19,227.00	0.04
166	688169	石头科技	200	18,994.00	0.04
167	300803	指南针	200	18,334.00	0.04
168	601319	中国人保	2,600	17,576.00	0.04
169	300896	爱美客	200	17,440.00	0.04
170	600941	中国移动	200	17,226.00	0.04
171	601390	中国中铁	4,100	17,097.00	0.04
172	603087	甘李药业	300	17,028.00	0.04

173	300251	光线传媒	1,400	15,526.00	0.03
174	002436	兴森科技	300	15,285.00	0.03
175	002008	大族激光	100	15,011.00	0.03
176	601211	国泰海通	800	14,560.00	0.03
177	601398	工商银行	2,000	14,140.00	0.03
178	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.03
179	000338	潍柴动力	500	13,625.00	0.03
180	000423	东阿阿胶	300	13,608.00	0.03
181	002044	美年健康	2,700	13,581.00	0.03
182	601168	西部矿业	500	13,570.00	0.03
183	000960	锡业股份	300	12,807.00	0.03
184	600166	福田汽车	4,300	12,513.00	0.03
185	603596	伯特利	500	12,420.00	0.03
186	688223	晶科能源	2,600	12,350.00	0.03
187	601328	交通银行	1,900	12,217.00	0.03
188	002318	久立特材	500	11,950.00	0.03
189	600392	盛和资源	400	11,908.00	0.03
190	002738	中矿资源	200	11,798.00	0.03
191	302132	中航成飞	200	11,664.00	0.03
192	601006	大秦铁路	2,500	11,525.00	0.02
193	000831	中国稀土	200	11,098.00	0.02
194	600497	驰宏锌锗	900	10,899.00	0.02
195	688472	阿特斯	1,000	10,820.00	0.02
196	601888	XD 中国中	200	10,742.00	0.02
197	000933	神火股份	500	10,600.00	0.02
198	300866	安克创新	100	10,450.00	0.02
199	002837	英维克	130	10,342.80	0.02
200	002407	多氟多	200	10,046.00	0.02
201	002532	天山铝业	900	9,657.00	0.02
202	300058	蓝色光标	700	9,632.00	0.02
203	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.02
204	300390	天华新能	100	9,351.00	0.02
205	300037	新宙邦	100	9,285.00	0.02
206	300346	南大光电	100	9,265.00	0.02
207	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.02
208	002185	华天科技	400	8,924.00	0.02
209	002049	紫光国微	100	8,875.00	0.02
210	688009	中国通号	1,806	8,596.56	0.02
211	300832	新产业	200	8,400.00	0.02
212	601727	上海电气	1,200	8,400.00	0.02
213	600118	中国卫星	100	8,205.00	0.02
214	000568	泸州老窖	100	7,752.00	0.02
215	600418	江淮汽车	300	7,749.00	0.02

216	300144	宋城演艺	1,300	7,553.00	0.02
217	601179	中国西电	500	7,460.00	0.02
218	600004	白云机场	1,000	7,260.00	0.02
219	002195	岩山科技	1,100	7,194.00	0.02
220	688303	大全能源	400	6,972.00	0.01
221	002128	电投能源	300	6,936.00	0.01
222	002595	豪迈科技	145	6,757.00	0.01
223	002812	恩捷股份	100	6,691.00	0.01
224	600580	卧龙电驱	200	6,620.00	0.01
225	605589	圣泉集团	100	6,357.00	0.01
226	600143	金发科技	400	6,180.00	0.01
227	002497	雅化集团	300	6,111.00	0.01
228	600096	云天化	200	6,080.00	0.01
229	603659	璞泰来	200	5,786.00	0.01
230	000066	中国长城	300	5,715.00	0.01
231	002131	利欧股份	1,200	5,700.00	0.01
232	002456	欧菲光	600	5,676.00	0.01
233	002555	三七互娱	300	5,661.00	0.01
234	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.01
235	300017	网宿科技	400	5,204.00	0.01
236	600839	四川长虹	700	4,886.00	0.01
237	002517	恺英网络	300	4,875.00	0.01
238	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.01
239	002472	双环传动	100	4,151.00	0.01
240	300339	润和软件	100	3,851.00	0.01
241	002465	海格通信	300	3,831.00	0.01
242	000547	航天发展	200	3,830.00	0.01
243	002130	沃尔核材	200	3,792.00	0.01
244	600895	张江高科	100	3,725.00	0.01
245	002271	东方雨虹	300	3,561.00	0.01
246	601615	明阳智能	300	3,471.00	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	占基金资产净值比例(%)
1	002850	科达利	800	151,440.00	0.33
2	688121	*ST 卓然	23,200	150,336.00	0.32
3	600809	山西汾酒	1,200	131,244.00	0.28
4	603298	杭叉集团	5,100	121,686.00	0.26
5	300841	康华生物	2,500	118,900.00	0.26
6	600480	凌云股份	11,700	97,227.00	0.21
7	600595	中孚实业	10,600	59,572.00	0.13

8	603617	君禾股份	8,000	56,960.00	0.12
9	300412	迦南科技	12,300	56,088.00	0.12
10	300150	世纪瑞尔	13,700	54,389.00	0.12
11	601798	蓝科高新	7,500	54,300.00	0.12
12	300787	海能实业	5,800	52,896.00	0.11
13	300636	同和药业	8,200	52,234.00	0.11
14	688285	高铁电气	7,194	51,580.98	0.11
15	601138	工业富联	700	50,505.00	0.11
16	000757	浩物股份	14,800	50,468.00	0.11
17	603321	梅轮电梯	8,700	49,764.00	0.11
18	688597	煜邦电力	7,557	49,120.50	0.11
19	300275	梅安森	6,100	48,983.00	0.11
20	688468	科美诊断	8,434	47,989.46	0.10
21	300176	鸿特科技	9,300	45,105.00	0.10
22	000848	承德露露	5,300	39,220.00	0.08
23	603699	纽威股份	700	35,210.00	0.08
24	600750	华润江中	1,200	26,484.00	0.06
25	688183	生益电子	200	26,480.00	0.06
26	600686	金龙汽车	1,900	21,451.00	0.05
27	601336	新华保险	300	17,898.00	0.04
28	000166	申万宏源	3,700	16,280.00	0.03
29	600909	XD 华安证	1,300	14,443.00	0.03
30	688187	时代电气	200	13,732.00	0.03
31	601198	东兴证券	900	12,231.00	0.03
32	002736	国信证券	1,200	11,988.00	0.03
33	688249	晶合集成	200	11,806.00	0.03
34	601991	大唐发电	1,500	10,620.00	0.02
35	603296	华勤技术	140	10,397.80	0.02
36	601099	太平洋	2,800	9,436.00	0.02
37	688568	中科星图	200	8,294.00	0.02
38	601212	白银有色	1,300	6,604.00	0.01
39	001696	宗申动力	300	6,243.00	0.01
40	603225	新凤鸣	300	5,895.00	0.01
41	600578	京能电力	900	5,805.00	0.01
42	600027	华电国际	1,300	5,785.00	0.01
43	601456	国联民生	600	5,304.00	0.01
44	002402	和而泰	200	5,166.00	0.01
45	000729	燕京啤酒	500	5,065.00	0.01
46	002926	华西证券	600	4,902.00	0.01
47	601236	红塔证券	600	4,092.00	0.01
48	688772	珠海冠宇	200	3,926.00	0.01
49	000951	中国重汽	200	3,902.00	0.01
50	601333	广深铁路	1,400	3,850.00	0.01

51	600906	财达证券	500	3,730.00	0.01
52	601118	海南橡胶	700	3,444.00	0.01
53	603737	三棵树	140	3,374.00	0.01
54	600848	上海临港	400	2,996.00	0.01
55	601608	中信重工	600	2,862.00	0.01
56	600685	中船防务	100	2,544.00	0.01
57	601808	中海油服	200	2,162.00	0.00
58	002608	江苏国信	200	1,380.00	0.00
59	300140	节能环境	200	994.00	0.00
60	688571	杭华股份	90	787.50	0.00
61	002690	美亚光电	4	57.32	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	4,192,735.00	4.46
2	601899	紫金矿业	3,987,334.00	4.24
3	300308	中际旭创	3,409,250.00	3.63
4	601872	招商轮船	2,838,558.00	3.02
5	300502	新易盛	2,374,055.00	2.53
6	000708	中信特钢	1,994,294.00	2.12
7	600066	宇通客车	1,983,812.00	2.11
8	000157	中联重科	1,764,539.00	1.88
9	000538	云南白药	1,733,867.00	1.84
10	600176	中国巨石	1,631,723.00	1.74
11	600887	伊利股份	1,603,878.00	1.71
12	688256	寒武纪	1,586,579.00	1.69
13	600233	圆通速递	1,577,393.00	1.68
14	601319	中国人保	1,482,599.00	1.58
15	603259	药明康德	1,424,716.00	1.52
16	600362	江西铜业	1,385,686.00	1.47
17	601166	兴业银行	1,322,711.00	1.41
18	600036	招商银行	1,318,418.00	1.40
19	600803	新奥股份	1,189,823.00	1.27
20	600941	中国移动	1,183,788.00	1.26

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“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	000708	中信特钢	6,002,306.00	6.38
2	600660	福耀玻璃	5,039,946.00	5.36
3	600066	宇通客车	4,625,571.00	4.92
4	601872	招商轮船	3,694,243.00	3.93
5	601899	紫金矿业	3,692,926.00	3.93
6	601318	中国平安	3,505,671.00	3.73
7	600803	新奥股份	3,060,679.25	3.26
8	603288	海天味业	2,463,947.75	2.62
9	600309	万华化学	2,374,259.00	2.53
10	600887	伊利股份	2,205,461.00	2.35
11	002415	海康威视	1,996,851.00	2.12
12	002352	顺丰控股	1,966,972.00	2.09
13	002601	龙佰集团	1,935,770.00	2.06
14	000157	中联重科	1,905,389.11	2.03
15	600690	海尔智家	1,874,178.00	1.99
16	600176	中国巨石	1,848,091.86	1.97
17	300750	宁德时代	1,787,855.00	1.90
18	688981	中芯国际	1,777,930.38	1.89
19	002371	北方华创	1,707,968.00	1.82
20	300760	迈瑞医疗	1,663,918.00	1.77

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“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	107,389,777.16
卖出股票收入（成交）总额	151,479,503.37

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

本报告期，本基金以套期保值为目的，持有流动性好、交易活跃、与标的指数相关性较高的股指期货多头合约，有效提高了本基金的资金管理效率，从而更好地跟踪标的指数，股指期货资产相关比例严格控制在基金合同约定范围之内。

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

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	379,610.40
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	99,953.43
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	479,563.83

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	688121	*ST 卓然	150,336.00	0.32	股票停牌

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
长江中证 A500 指数增强发起 A	534	66,144.59	10,105,444.99	28.61%	25,215,768.07	71.39%
长江中证 A500 指数增强发起 C	184	37,623.91	0.00	0.00%	6,922,798.81	100.00%
合计	691	61,134.60	10,105,444.99	23.92%	32,138,566.88	76.08%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	长江中证 A500 指数增强发起 A	60,652.43	0.1717%
	长江中证 A500 指数增强发起 C	7,501.25	0.1084%
	合计	68,153.68	0.1613%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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	长江中证 A500 指数增强发起 A	0~10
	长江中证 A500 指数增强发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长江中证 A500 指数增强发起 A	0~10
	长江中证 A500 指数增强发起 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,005,444.99	23.68%	10,005,444.99	23.68%	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,005,444.99	23.68%	10,005,444.99	23.68%	-

注：持有份额占基金总份额比例、发起份额占基金总份额比例的计算中，分母采用报告期末基金份额总额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江中证 A500 指数增强发起 A	长江中证 A500 指数增强发起 C
基金合同生效日（2025 年 09 月 15 日）基金份额总额	127,032,692.59	62,393,582.98
本报告期期初基金份额总额	75,667,754.39	16,984,134.19
本报告期基金总申购份额	3,968,349.92	1,821,852.67

减：本报告期基金总赎回份额	44,314,891.25	11,883,188.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	35,321,213.06	6,922,798.81

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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

本报告期内，本基金管理人无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

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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	
长江证券	2	258,869,280.53	100.00%	50,719.09	100.00%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2、本基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，委托其办理本基金的证券交易业务。证券公司的选择标准如下：

（1）公司财务状况良好，经营行为规范。

（2）具备较强的合规风控能力。

（3）具备较强的交易服务能力。

3、受托办理证券交易的证券公司选择程序如下：本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与受托证券公司签订证券经纪服务协议。

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	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网站系统暂停服务的公告	规定报刊、网站	2026-01-09
2	长江证券（上海）资产管理有限公司关于设立审计委员会并撤销监事的公告	规定报刊、网站	2026-01-13
3	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第四季度报告	规定网站	2026-01-22
4	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2026-01-22
5	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票及相关风险提示的公告	规定报刊、网站	2026-03-04
6	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资	规定网站	2026-03-31

	基金 2025 年年度报告		
7	长江证券（上海）资产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）	规定网站	2026-03-31
8	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊、网站	2026-03-31
9	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定网站	2026-04-22
10	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2026-04-22
11	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年 05 月 29 日更新）	规定网站	2026-05-29
12	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026-05-29
13	长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026-05-29

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260424-20260630	10,005,444.99	-	-	10,005,444.99	23.68%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回、延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项等，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

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

1、中国证监会准予长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金募集申请的注册文件

- 2、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为 www.cjzcgf.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇二六年八月三十一日