

景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 基金管理人及基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
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
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4 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	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金	
基金简称	景顺长城专精特新量化优选股票	
基金主代码	014062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	511,279,896.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城专精特新量化优选股票 A	景顺长城专精特新量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	014062	014063
报告期末下属分级基金的份额总额	299,534,452.86 份	211,745,443.47 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型优选符合本基金约定的专精特新主题股票，在严格控制风险及考虑流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。 2、股票投资策略 本基金的专精特新主题是指企业具有主营业务专注专业、经营管理精细高效、产品服务独具特色和创新能力强的发展特征。本基金的专精特新的本质在于专注细分市场中具备特色专业技术的创新型企业。 3、债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 4、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。 5、国债期货投资策略

	本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。 6、股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 7、资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以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，并通过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。 8、参与融资业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。 9、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。
业绩比较基准	中证 1000 指数×85%+商业银行活期存款利率(税后)×10%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金如投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临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		景顺长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	张姗
	联系电话	0755-82370388	400-61-95555
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	400-61-95555
传真		0755-22381339	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		叶才	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com

基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所
------------	------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
和指标	景顺长城专精特新量化优选股票 A	景顺长城专精特新量化优选股票 C
本期已实现收益	124,699,088.35	88,701,372.85
本期利润	96,673,304.26	71,802,129.49
加权平均基金份 额本期利润	0.2535	0.2582
本期加权平均净 值利润率	22.81%	23.44%
本期基金份额净 值增长率	24.36%	24.11%
3.1.2 期末数据	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	66,004,517.19	41,937,253.04
期末可供分配基 金份额利润	0.2204	0.1981
期末基金资产净 值	365,538,970.05	253,682,696.51
期末基金份额净 值	1.2203	1.1980
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	22.03%	19.80%

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、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

景顺长城专精特新量化优选股票 A

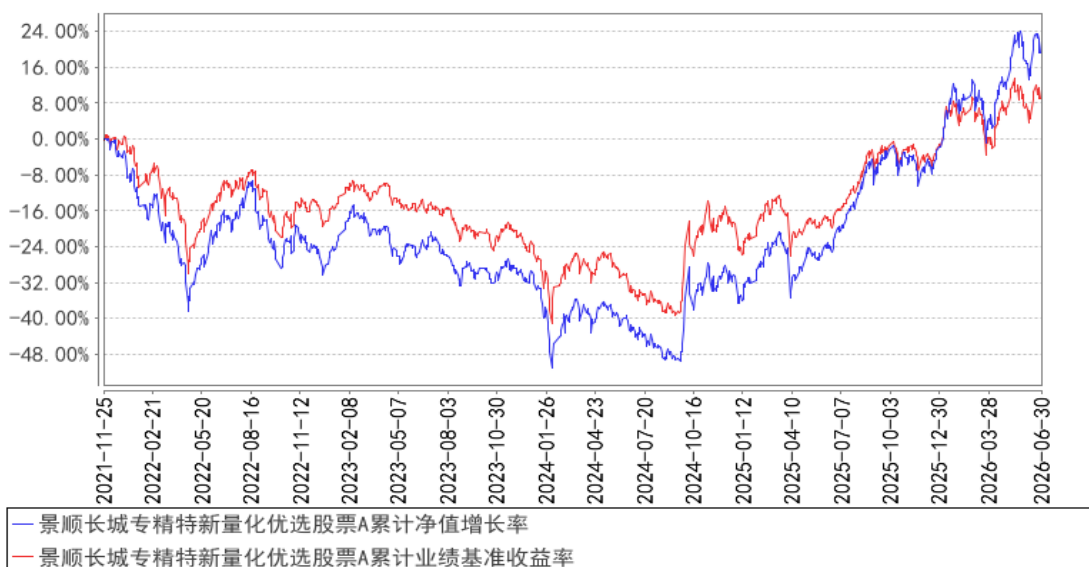
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.26%	1.52%	12.70%	1.39%	5.56%	0.13%
过去六个月	24.36%	1.61%	12.80%	1.41%	11.56%	0.20%
过去一年	52.18%	1.41%	31.74%	1.21%	20.44%	0.20%
过去三年	56.03%	1.78%	30.32%	1.45%	25.71%	0.33%
自基金合同生效起至今	22.03%	1.68%	11.30%	1.37%	10.73%	0.31%

景顺长城专精特新量化优选股票 C

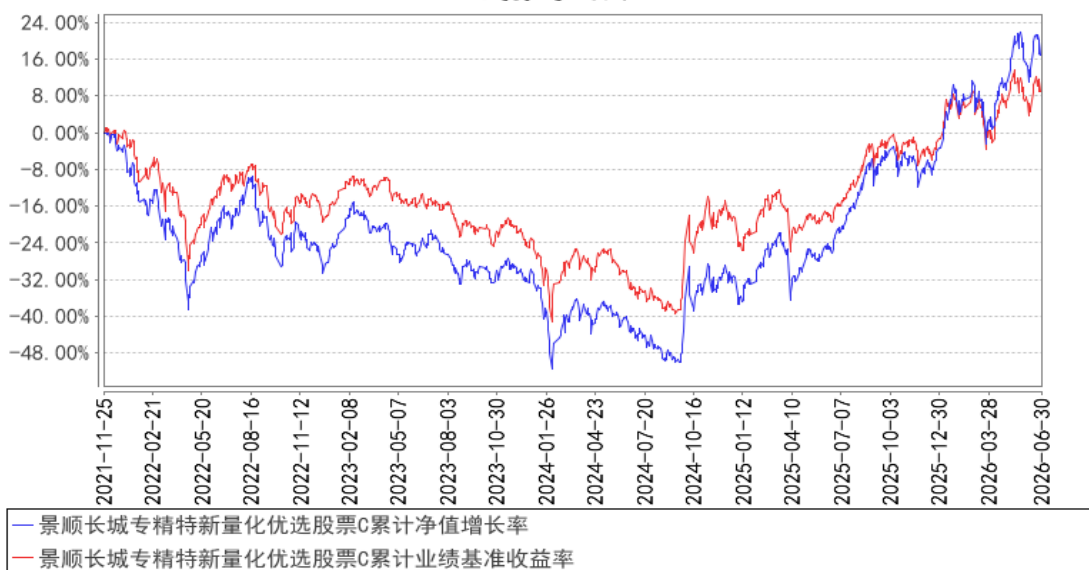
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.15%	1.52%	12.70%	1.39%	5.45%	0.13%
过去六个月	24.11%	1.61%	12.80%	1.41%	11.31%	0.20%
过去一年	51.57%	1.41%	31.74%	1.21%	19.83%	0.20%
过去三年	54.16%	1.78%	30.32%	1.45%	23.84%	0.33%
自基金合同生效起至今	19.80%	1.68%	11.30%	1.37%	8.50%	0.31%

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

景顺长城专精特新量化优选股票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



景顺长城专精特新量化优选股票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：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金界定的专精特新主题相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，港股通标的股票投资比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2021 年 11 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合

比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
曾理	本基金的基金经理	2021 年 11 月 25 日	-	12 年	工学硕士。曾任腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗。2014 年 8 月加入本公司，担任量化及指数投资部量化程序员，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2021 年 11 月 25 日	-	16 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合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%的交易共有 10 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现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，中国经济整体保持韧性，但结构分化进一步加剧。经济运行呈现出“内需偏弱、外需较强、供强需弱突出”的特征。二季度 GDP 同比增长 4.3%，上半年 GDP 累计增长 4.7%，经济增速仍处于合理区间，但内需修复力度不足成为当前经济运行中的主要矛盾。与此同时，AI 产业链、高端制造等领域景气度持续提升，全球科技成长资产表现突出，资本市场结构性行情明显。在这一背景下，专精特新企业所代表的技术创新、产业升级和国产替代方向，仍具备较强的长期投资价值。

从国内宏观看，上半年经济呈现明显的供需分化特征。消费方面，二季度社会消费品零售总

额阶段性走弱，4 月同比仅增长 0.2%，5 月进一步转为同比下降 0.6%，但 6 月在低基数及部分政策支持下回升至同比增长 1%，居民消费支出数据亦显示消费边际有所改善。整体来看，前期“以旧换新”等政策对部分消费品形成一定透支，居民消费恢复仍受到就业预期和收入预期影响。价格方面，二季度 PPI 有所修复，但核心 CPI 仍处于较低水平，终端需求不足导致价格向下游传导仍不充分。房地产方面，一线城市二手房价格表现相对较强，6 月环比上涨 0.3%，连续四个月保持较好表现，但这一改善尚未明显传导至更广泛城市以及一手房市场，房地产投资仍处于调整阶段。

投资方面，上半年固定资产投资压力较大。二季度固定资产投资延续下行趋势，4 月当月同比下降 8%，5 月降幅扩大至 10.7%，6 月仍下降 10%。其中，制造业投资跌幅有所收敛，5 月同比下降 4.2%，6 月改善至下降 3.2%；基建投资和房地产投资仍承压，6 月基建投资同比下降 10.2%，房地产投资下降 24.4%。投资走弱与企业中长期贷款偏弱相互印证，反映企业扩张意愿仍有待恢复。与此同时，外需表现持续超预期，6 月美元计价出口同比增长 27%，AI 产业链、机电产品以及部分制造业出口保持较高景气，中国供应链优势仍是出口韧性的关键支撑。在出口带动下，工业生产有所修复，6 月工业增加值同比增长 5.3%。但从供需关系看，生产恢复仍快于需求，产能利用率有所下降，供强需弱格局仍需关注。

海外方面，全球经济和政策环境仍存在较大不确定性。6 月 FOMC 会议维持政策利率在 3.5%-3.75% 不变，但通胀预测有所上调，市场对未来货币政策路径保持关注。美国 6 月非农就业人数增加 5.7 万人，低于市场预期，劳动力市场边际有所降温；6 月 CPI 同比由 4.2% 回落至 3.5%，核心 CPI 同比由 2.8% 回落至 2.6%，通胀压力有所缓解。与此同时，AI 产业趋势持续推动全球科技资产表现，半导体产业链成为全球资本市场的重要投资方向。整体来看，海外市场在经济韧性、通胀变化以及货币政策预期之间持续博弈，市场波动仍可能维持较高水平。

资本市场方面，2026 年上半年 A 股整体上涨，但结构分化特征十分明显。根据 2026 年 1 月 1 日至 6 月 30 日指数表现数据，科技成长方向表现显著领先。其中，科创 50 上涨 64.25%，创业板 50 上涨 37.01%，创业板指上涨 35.58%，创业板综上涨 24.15%；中证 500 上涨 20.97%，深证成指上涨 19.82%，中证 1000 上涨 15.99%。相比之下，沪深 300 上涨 7.55%，上证指数上涨 3.16%，上证 50 下跌 1.38%。整体来看，上半年市场上涨主要由科技成长、中小市值和创新产业方向驱动，大盘蓝筹表现相对偏弱，市场风险偏好更多集中于具备产业趋势和成长空间的领域。

海外权益市场同样体现出科技成长主线。2026 年上半年，费城半导体指数上涨 101.14%，台湾加权指数上涨 59.25%，纳斯达克 100 上涨 19.91%，标普 500 上涨 9.55%，显示全球投资者对人工智能、半导体及相关产业链的关注度持续提升。相比之下，港股市场表现较弱，恒生科技指数

下跌 18.92%，恒生指数下跌 10.73%，恒生中国企业指数下跌 15.21%，反映港股市场仍受到盈利预期、流动性环境和消费板块压力影响。全球市场表现进一步验证，AI 和科技成长仍是 2026 年上半年资本市场的重要投资主线。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 24.36%，业绩比较基准收益率为 12.80%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 24.11%，业绩比较基准收益率为 12.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从产业发展角度看，专精特新企业仍是中国制造业升级和培育新质生产力的重要力量。在全球科技竞争加速、产业链重构持续推进的背景下，具备技术壁垒、产品优势和客户认证能力的优质中小企业有望在国产替代、高端制造和产业链安全过程中获得持续发展机会。与此同时，二季度内需走弱也意味着专精特新企业内部基本面分化可能进一步加大，投资需要更加关注企业真实景气度、盈利质量、技术领先性和成长持续性。

作为专注于专精特新主题的基金，本基金将继续严格坚守专精特新赛道，力争在不偏离主题风格的基础上展现出较强的选股能力。未来将继续围绕高端制造、产业链安全、自主可控、先进制造升级以及 AI 和半导体产业链等方向，通过量化方法提升选股效率和组合质量，重点关注企业基本面、技术壁垒、产业地位和成长潜力。在市场结构分化和产业趋势持续演绎的环境下，本基金将持续优化量化投资模型，深化对专精特新企业的研究，努力识别具备长期竞争优势的优质企业，为投资者争取长期稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金

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	40,837,697.73	19,167,702.98
结算备付金		563,535.37	63,406,415.64
存出保证金		—	7,319,976.00
交易性金融资产	6.4.7.2	585,234,517.79	692,224,344.84
其中：股票投资		585,234,517.79	661,862,230.67
基金投资		—	—
债券投资		—	30,362,114.17
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		99,654.12	-
应收申购款		403,931.27	554,631.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		627,139,336.28	782,673,070.90
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		-	-
应付赎回款		6,805,883.85	5,166,763.84
应付管理人报酬		677,721.99	782,551.45
应付托管费		112,953.63	130,425.24
应付销售服务费		103,062.06	88,295.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		124,303.04	148,369.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	93,745.15	179,895.73
负债合计		7,917,669.72	6,496,301.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	511,279,896.33	795,378,479.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	107,941,770.23	-19,201,710.55
净资产合计		619,221,666.56	776,176,768.98
负债和净资产总计		627,139,336.28	782,673,070.90

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 511,279,896.33 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.2203 元，基金份额 299,534,452.86 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1980 元，基金份额 211,745,443.47 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		174,307,322.07	138,737,585.54
1. 利息收入		411,510.94	65,159.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	411,510.94	65,159.66
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）		218,725,597.34	67,343,637.38
其中：股票投资收益	6.4.7.14	199,978,731.96	61,408,881.67
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.15	227,701.02	270,868.41
资产支持证券投资	6.4.7.16	—	—
收益		—	—
贵金属投资收益	6.4.7.17	—	—
衍生工具收益	6.4.7.18	13,772,527.41	-1,459.02
股利收益	6.4.7.19	4,746,636.95	5,665,346.32
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	-44,940,924.08	71,295,130.58
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	111,137.87	33,657.92
减：二、营业总支出		5,831,888.32	5,806,093.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,358,660.07	4,438,466.90
其中：暂估管理人报酬		—	—
2. 托管费	6.4.10.2.2	726,443.29	739,744.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	609,472.73	520,067.08
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. 22	-	-
7. 税金及附加		33, 716. 70	9, 209. 95
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	103, 595. 53	98, 605. 19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		168, 475, 433. 75	132, 931, 491. 89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		168, 475, 433. 75	132, 931, 491. 89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		168, 475, 433. 75	132, 931, 491. 89

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金

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	795, 378, 479. 53	-	-19, 201, 710. 55	776, 176, 768. 98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	795, 378, 479. 53	-	-19, 201, 710. 55	776, 176, 768. 98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-284, 098, 583. 2 0	-	127, 143, 480. 78	-156, 955, 102. 42
（一）、综合收益总额	-	-	168, 475, 433. 75	168, 475, 433. 75
（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）	-284, 098, 583. 2 0	-	-41, 331, 952. 97	-325, 430, 536. 17
其中：1. 基金申购款	295, 577, 300. 81	-	29, 235, 774. 86	324, 813, 075. 67
2. 基金赎回	-579, 675, 884. 0	-	-70, 567, 727. 83	-650, 243, 611. 84

回款	1			
(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	511,279,896.33	-	107,941,770.23	619,221,666.56
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,084,023,510.93	-	-358,609,083.99	725,414,426.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,084,023,510.93	-	-358,609,083.99	725,414,426.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-99,846,240.49	-	159,670,840.04	59,824,599.55
(一)、综合收益总额	-	-	132,931,491.89	132,931,491.89
(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)	-99,846,240.49	-	26,739,348.15	-73,106,892.34
其中：1. 基金申购款	35,346,553.38	-	-9,706,798.53	25,639,754.85
2. 基金赎回款	-135,192,793.87	-	36,446,146.68	-98,746,647.19
(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	984,177,270.44	-	-198,938,243.95	785,239,026.49

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金（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[2021]第 3330 号《关于准予景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金注册的批复》注册，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城专精特新量化优选股票型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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,952,921,687.59 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1093 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金基金合同》于 2021 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,953,339,974.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 418,287.22 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为包括国内依法发行上市的股票（包含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、

可转换债券、可交换公司债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%,其中投资于本基金界定的专精特新主题相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,港股通标的股票投资比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 8 月 26 日批准报出。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

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《财政部 税务总局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、债券取得的收入及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《财政部 国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局 证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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	32,907,118.32

等于：本金	32,901,284.39
加：应计利息	5,833.93
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 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	7,930,579.41
等于：本金	7,930,421.80
加：应计利息	157.61
减：坏账准备	-
合计	40,837,697.73

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪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 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		601,040,426.95	-	585,234,517.79	-15,805,909.16
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		601,040,426.95	-	585,234,517.79	-15,805,909.16

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

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

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

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	484.70
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	91,280.45
其他	1,980.00
合计	93,745.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城专精特新量化优选股票 A

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	524,594,476.33	524,594,476.33
本期申购	39,674,309.47	39,674,309.47
本期赎回（以“-”号填列）	-264,734,332.94	-264,734,332.94
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	299,534,452.86	299,534,452.86

景顺长城专精特新量化优选股票 C

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	270,784,003.20	270,784,003.20
本期申购	255,902,991.34	255,902,991.34
本期赎回（以“-”号填列）	-314,941,551.07	-314,941,551.07
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	211,745,443.47	211,745,443.47

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城专精特新量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-42,428,287.34	32,618,687.91	-9,809,599.43
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-42,428,287.34	32,618,687.91	-9,809,599.43
本期利润	124,699,088.35	-28,025,784.09	96,673,304.26
本期基金份额交易产生的变动数	-7,140,231.09	-13,718,956.55	-20,859,187.64
其中：基金申购款	3,044,476.34	2,901,810.24	5,946,286.58
基金赎回款	-10,184,707.43	-16,620,766.79	-26,805,474.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,130,569.92	-9,126,052.73	66,004,517.19

景顺长城专精特新量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-26,008,586.10	16,616,474.98	-9,392,111.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-26,008,586.10	16,616,474.98	-9,392,111.12
本期利润	88,701,372.85	-16,899,243.36	71,802,129.49
本期基金份额交易产生的变动数	-14,480,466.22	-5,992,299.11	-20,472,765.33
其中：基金申购款	15,645,407.17	7,644,081.11	23,289,488.28
基金赎回款	-30,125,873.39	-13,636,380.22	-43,762,253.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,212,320.53	-6,275,067.49	41,937,253.04

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	63,519.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,071.46
结算备付金利息收入	343,212.05
其他	1,708.30
合计	411,510.94

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	199,978,731.96
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	199,978,731.96

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	2,831,754,973.03
减：卖出股票成本总额	2,627,518,652.72
减：交易费用	4,257,588.35
买卖股票差价收入	199,978,731.96

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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	67,568.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	160,132.77
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	227,701.02

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	30,623,292.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,135,240.00
减：应计利息总额	327,682.58
减：交易费用	237.21
买卖债券差价收入	160,132.77

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

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

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	13,772,527.41

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	4,746,636.95
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	4,746,636.95

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	-40,381,355.92
股票投资	-40,378,595.92
债券投资	-2,760.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-4,692,040.00
权证投资	-
期货投资	-4,692,040.00

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-132,471.84
合计	-44,940,924.08

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	99,854.04
基金转换费收入	11,283.83
合计	111,137.87

6.4.7.22 信用减值损失

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	7,106.43
证券组合费	708.65
合计	103,595.53

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,358,660.07	4,438,466.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,634,207.39	1,723,242.40
应支付基金管理人的净管理费	2,724,452.68	2,715,224.50

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

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 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	726,443.29	739,744.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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		
	景顺长城专精特新量	景顺长城专精特新量	合计

	化优选股票 A	化优选股票 C	
景顺长城基金管理有限公司	–	178,254.46	178,254.46
招商银行	–	139,589.50	139,589.50
长城证券	–	–	–
合计	–	317,843.96	317,843.96
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 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城专精特新量化优选股票 A	景顺长城专精特新量化优选股票 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	–	11,184.84	11,184.84
招商银行	–	180,236.40	180,236.40
长城证券	–	–	–
合计	–	191,421.24	191,421.24

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 1 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
招商银行-活期	32,907,118.32	63,519.13	24,715,881.58	24,414.37

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	4,035	40,834.20	111,890.55	-

	份	日								
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-

	份	日								
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688818	电科蓝	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

	天	日								
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,076	21,175.68	152,243.24	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金无因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。

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，本基金无因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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投

资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.02%）。

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投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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在基金运作过程中严格按照《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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

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	40,837,697.73	-	-	-	-	-	40,837,697.73

结算备付金	563,535.37	-	-	-	-	-	563,535.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	585,234,517.79	585,234,517.79
应收股利	-	-	-	-	-	99,654.12	99,654.12
应收申购款	-	-	-	-	-	403,931.27	403,931.27
资产总计	41,401,233.10	-	-	-	-	585,738,103.18	627,139,336.28
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,805,883.85	6,805,883.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	677,721.99	677,721.99
应付托管费	-	-	-	-	-	112,953.63	112,953.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	103,062.06	103,062.06
应交税费	-	-	-	-	-	124,303.04	124,303.04
其他负债	-	-	-	-	-	93,745.15	93,745.15
负债总计	-	-	-	-	-	7,917,669.72	7,917,669.72
利率敏感度缺口	41,401,233.10	-	-	-	-	-	-
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	19,167,702.98	-	-	-	-	-	19,167,702.98
结算备付金	63,406,415.64	-	-	-	-	-	63,406,415.64
存出保证金	-	-	-	-	-	7,319,976.00	7,319,976.00
交易性金融资产	-	-	30,242,112.33	-	120,001.84	661,862,230.67	692,224,344.84
应收申购款	-	-	-	-	-	554,631.44	554,631.44
资产总计	82,574,118.62	-	30,242,112.33	-	120,001.84	669,736,838.11	782,673,070.90
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,166,763.84	5,166,763.84
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	782,551.45	782,551.45
应付托管费	-	-	-	-	-	130,425.24	130,425.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	88,295.86	88,295.86

应交税费	-	-	-	-	-	148,369.80	148,369.80
其他负债	-	-	-	-	-	179,895.73	179,895.73
负债总计	-	-	-	-	-	6,496,301.92	6,496,301.92
利率敏感度缺口	82,574,118.62	-	30,242,112.33	-	120,001.84	-	-

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）
	市场利率上升25个基点	-	-33,297.62
	市场利率下降25个基点	-	33,371.11

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	20,839,987.85	-	20,839,987.85
资产合计	-	20,839,987.85	-	20,839,987.85
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净	-	20,839,987.85	-	20,839,987.85

额				
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值 5%	1, 041, 999. 39	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1, 041, 999. 39	-

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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它价格风险，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。

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	585,234,517.79	94.51	661,862,230.67	85.27
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	585,234,517.79	94.51	661,862,230.67	85.27

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%	21,245,909.08	44,809,223.59
	沪深 300 指数下降 5%	-21,245,909.08	-44,809,223.59

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	584,134,107.67	661,115,475.66

第二层次	–	30,362,114.17
第三层次	1,100,410.12	746,755.01
合计	585,234,517.79	692,224,344.84

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	585,234,517.79	93.32
	其中：股票	585,234,517.79	93.32
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	41,401,233.10	6.60
8	其他各项资产	503,585.39	0.08
9	合计	627,139,336.28	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 20,839,987.85 元，占基金资产净值的比例为 3.37%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	509,238,914.78	82.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	642,320.00	0.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,718,175.00	0.76
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	36,229,979.63	5.85
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	5,410,797.13	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	8,154,343.40	1.32
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	564,394,529.94	91.15

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	581,233.67	0.09
必需消费品	822,147.72	0.13
非必需消费品	2,665,706.74	0.43
能源	934,281.86	0.15
金融	8,503,599.58	1.37
政府	-	-
工业	658,695.30	0.11
医疗保健	747,859.77	0.12
房地产	814,067.60	0.13
科技	1,550,806.45	0.25

公用事业	576,560.86	0.09
通讯	2,985,028.30	0.48
合计	20,839,987.85	3.37

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

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

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	002833	弘亚数控	497,368	9,594,228.72	1.55
2	688155	先惠技术	114,426	9,255,919.14	1.49
3	688239	航宇科技	154,075	9,218,307.25	1.49
4	300769	德方纳米	132,927	8,839,645.50	1.43
5	301219	腾远钴业	160,693	8,805,976.40	1.42
6	002810	山东赫达	356,300	8,800,610.00	1.42
7	688257	新锐股份	86,291	8,793,052.90	1.42
8	301031	中熔电气	71,700	8,564,565.00	1.38
9	603966	法兰泰克	1,037,810	8,458,151.50	1.37
10	301308	江波龙	12,000	8,445,600.00	1.36
11	603507	振江股份	243,600	8,012,004.00	1.29
12	605305	中际联合	184,745	7,744,510.40	1.25
13	300839	博汇股份	660,600	7,735,626.00	1.25
14	688778	厦钨新能	141,515	7,698,416.00	1.24
15	688059	华锐精密	38,194	7,627,723.74	1.23
16	688269	凯立新材	238,800	7,572,348.00	1.22
17	688127	蓝特光学	77,453	7,559,412.80	1.22
18	002838	道恩股份	228,800	7,005,856.00	1.13
19	300428	立中集团	379,590	6,900,946.20	1.11
20	603579	荣泰健康	395,900	6,718,423.00	1.08
21	688208	道通科技	249,235	6,278,229.65	1.01
22	002997	瑞鹄模具	219,880	6,059,892.80	0.98
23	002812	恩捷股份	82,100	5,493,311.00	0.89
24	300855	图南股份	174,000	5,439,240.00	0.88
25	002338	奥普光电	90,700	5,188,040.00	0.84
26	300394	天孚通信	17,120	5,181,881.60	0.84
27	300452	山河药辅	441,900	5,161,392.00	0.83
28	300406	九强生物	460,200	5,029,986.00	0.81
29	600288	大恒科技	369,716	4,917,222.80	0.79
30	301162	国能日新	112,309	4,913,518.75	0.79
31	300610	晨化股份	502,200	4,896,450.00	0.79
32	300833	浩洋股份	156,700	4,729,206.00	0.76
33	688025	杰普特	10,043	4,720,210.00	0.76
34	301060	兰卫医学	577,500	4,718,175.00	0.76
35	688019	安集科技	13,829	4,694,392.34	0.76

36	002996	顺博合金	794,190	4,685,721.00	0.76
37	001207	联科科技	313,900	4,683,388.00	0.76
38	688279	峰昭科技	20,242	4,543,114.48	0.73
39	688617	惠泰医疗	24,915	4,523,567.40	0.73
40	688188	柏楚电子	42,272	4,510,422.40	0.73
41	300693	盛弘股份	91,400	4,455,750.00	0.72
42	688110	东芯股份	21,600	4,399,920.00	0.71
43	300302	同有科技	85,200	4,359,684.00	0.70
44	300515	三德科技	325,700	4,250,385.00	0.69
45	301087	可孚医疗	88,940	4,237,991.00	0.68
46	605118	力鼎光电	120,500	4,204,245.00	0.68
47	688267	中触媒	212,660	4,189,402.00	0.68
48	688016	心脉医疗	46,824	4,150,479.36	0.67
49	300236	上海新阳	31,500	4,142,250.00	0.67
50	688308	欧科亿	22,600	4,108,906.00	0.66
51	603489	八方股份	146,700	4,101,732.00	0.66
52	002392	北京利尔	489,200	3,947,844.00	0.64
53	603809	豪能股份	449,800	3,944,746.00	0.64
54	002393	力生制药	273,720	3,884,086.80	0.63
55	002757	南兴股份	214,600	3,873,530.00	0.63
56	688162	巨一科技	162,600	3,843,864.00	0.62
57	603158	腾龙股份	313,000	3,827,990.00	0.62
58	688577	浙海德曼	83,397	3,822,084.51	0.62
59	601702	华峰铝业	262,300	3,698,430.00	0.60
60	603826	坤彩科技	144,600	3,695,976.00	0.60
61	605183	确成股份	250,100	3,686,474.00	0.60
62	300357	我武生物	157,600	3,675,232.00	0.59
63	300685	艾德生物	218,100	3,672,804.00	0.59
64	002380	科远智慧	106,400	3,636,752.00	0.59
65	688063	派能科技	68,000	3,622,360.00	0.58
66	603256	宏和科技	13,400	3,555,422.00	0.57
67	002226	江南化工	754,700	3,388,603.00	0.55
68	688510	航亚科技	141,698	3,383,748.24	0.55
69	688236	春立医疗	228,938	3,310,443.48	0.53
70	688698	伟创电气	61,097	3,204,537.65	0.52
71	605016	百龙创园	122,431	3,164,841.35	0.51
72	688580	伟思医疗	58,779	3,131,157.33	0.51
73	300604	长川科技	9,100	3,106,922.00	0.50
74	001266	宏英智能	62,500	3,068,750.00	0.50
75	603590	康辰药业	105,427	3,058,437.27	0.49
76	003017	大洋生物	132,480	3,047,040.00	0.49
77	688519	南亚新材	8,000	3,040,320.00	0.49
78	688156	路德科技	99,428	3,007,697.00	0.49

79	300971	博亚精工	159,400	2,974,404.00	0.48
80	688045	必易微	36,600	2,956,548.00	0.48
81	301019	宁波色母	161,600	2,881,328.00	0.47
82	688400	凌云光	43,400	2,873,080.00	0.46
83	00005	汇丰控股	22,000	2,826,087.99	0.46
84	603396	金辰股份	106,500	2,822,250.00	0.46
85	300487	蓝晓科技	47,900	2,818,915.00	0.46
86	300875	捷强装备	96,500	2,757,005.00	0.45
87	300881	盛德鑫泰	73,200	2,741,340.00	0.44
88	688722	同益中	175,400	2,660,818.00	0.43
89	688100	威胜信息	86,400	2,642,976.00	0.43
90	300842	帝科股份	29,500	2,630,515.00	0.42
91	300613	富瀚微	32,700	2,618,616.00	0.42
92	001230	劲旅环境	169,540	2,604,134.40	0.42
93	603127	昭衍新药	67,600	2,583,672.00	0.42
94	688178	万德斯	75,200	2,542,512.00	0.41
95	688696	极米科技	39,200	2,529,968.00	0.41
96	300980	祥源新材	85,800	2,523,378.00	0.41
97	000790	华神科技	707,300	2,468,477.00	0.40
98	300988	津荣天宇	157,900	2,467,977.00	0.40
99	688699	明微电子	30,000	2,458,500.00	0.40
100	688301	奕瑞科技	19,800	2,455,200.00	0.40
101	300743	天地数码	166,600	2,430,694.00	0.39
102	688350	富淼科技	69,000	2,382,570.00	0.38
103	300661	圣邦股份	16,500	2,367,420.00	0.38
104	688625	呈和科技	27,760	2,343,221.60	0.38
105	603995	甬金股份	100,100	2,323,321.00	0.38
106	300286	安科瑞	95,000	2,294,250.00	0.37
107	688093	世华科技	61,912	2,284,552.80	0.37
108	002979	雷赛智能	40,800	2,275,824.00	0.37
109	300848	美瑞新材	162,000	2,259,900.00	0.36
110	603339	四方科技	156,920	2,242,386.80	0.36
111	301121	紫建电子	69,300	2,218,986.00	0.36
112	603439	三力制药	173,900	2,192,879.00	0.35
113	301266	宇邦新材	95,930	2,191,041.20	0.35
114	300008	天海防务	358,800	2,174,328.00	0.35
115	688113	联测科技	61,400	2,155,140.00	0.35
116	002006	精工科技	142,900	2,102,059.00	0.34
117	300817	双飞集团	133,800	2,087,280.00	0.34
118	300283	温州宏丰	99,300	2,040,615.00	0.33
119	301077	星华新材	90,100	2,034,458.00	0.33
120	603267	鸿远电子	26,000	2,014,480.00	0.33
121	688700	东威科技	22,400	2,002,560.00	0.32

122	300810	中科海讯	77,900	1,977,102.00	0.32
123	301213	观想科技	39,400	1,936,116.00	0.31
124	688399	硕世生物	42,400	1,924,536.00	0.31
125	605123	派克新材	19,300	1,872,293.00	0.30
126	300414	中光防雷	167,300	1,843,646.00	0.30
127	300407	凯发电气	169,200	1,827,360.00	0.30
128	688357	建龙微纳	61,600	1,815,352.00	0.29
129	688237	超卓航科	32,400	1,730,808.00	0.28
130	00700	腾讯控股	3,600	1,343,890.04	0.22
131	00939	建设银行	175,000	1,226,609.74	0.20
132	01299	友邦保险	19,200	1,191,511.63	0.19
133	09988	阿里巴巴-W	14,300	1,153,221.61	0.19
134	01398	工商银行	149,000	832,131.70	0.13
135	00941	中国移动	11,500	760,610.95	0.12
136	300671	富满微	8,600	740,976.00	0.12
137	300179	四方达	11,700	695,331.00	0.11
138	688233	神工股份	3,200	686,144.00	0.11
139	002119	康强电子	17,100	682,632.00	0.11
140	00388	香港交易所	2,100	662,095.67	0.11
141	688218	江苏北人	11,957	657,156.72	0.11
142	688630	芯碁微装	1,178	647,181.42	0.10
143	301127	武汉天源	31,000	642,320.00	0.10
144	301306	西测测试	4,000	633,960.00	0.10
145	301150	中一科技	9,800	618,478.00	0.10
146	688105	诺唯赞	35,520	616,272.00	0.10
147	300401	花园生物	28,100	615,109.00	0.10
148	002057	中钢天源	48,600	604,098.00	0.10
149	688598	金博股份	12,200	603,290.00	0.10
150	300346	南大光电	6,500	602,225.00	0.10
151	688332	中科蓝讯	3,800	598,500.00	0.10
152	01810	小米集团-W	31,800	597,694.42	0.10
153	300993	玉马科技	61,200	594,864.00	0.10
154	002158	汉钟精机	16,000	593,280.00	0.10
155	300990	同飞股份	5,600	588,392.00	0.10
156	300382	斯莱克	25,400	586,994.00	0.09
157	688353	华盛锂电	5,057	586,965.99	0.09
158	00981	中芯国际	7,500	582,362.78	0.09
159	688323	瑞华泰	10,200	576,300.00	0.09
160	688595	芯海科技	13,000	570,180.00	0.09
161	300398	飞凯材料	9,200	568,100.00	0.09
162	688168	安博通	8,240	566,500.00	0.09
163	03690	美团-W	9,500	565,208.91	0.09
164	688090	瑞松科技	5,290	563,120.50	0.09

165	03988	中国银行	129,000	559,094.32	0.09
166	003031	中瓷电子	3,100	558,930.00	0.09
167	688711	宏微科技	11,856	538,855.20	0.09
168	02318	中国平安	12,000	532,073.73	0.09
169	300706	阿石创	6,100	526,735.00	0.09
170	300576	容大感光	10,150	519,883.00	0.08
171	688131	皓元医药	5,400	510,840.00	0.08
172	603678	火炬电子	6,100	506,300.00	0.08
173	600105	永鼎股份	7,500	506,100.00	0.08
174	00883	中国海洋石油	28,000	494,170.21	0.08
175	300304	云意电气	27,600	492,660.00	0.08
176	605376	博迁新材	1,800	488,340.00	0.08
177	001696	宗申动力	23,200	482,792.00	0.08
178	300586	美联新材	30,800	481,712.00	0.08
179	603203	快克智能	6,227	478,109.06	0.08
180	002747	埃斯顿	12,800	477,824.00	0.08
181	688551	科威尔	6,600	463,782.00	0.07
182	600459	贵研铂业	15,900	459,192.00	0.07
183	002821	凯莱英	2,800	453,600.00	0.07
184	688138	清溢光电	9,600	451,200.00	0.07
185	688211	中科微至	13,000	447,460.00	0.07
186	300786	国林科技	17,800	446,246.00	0.07
187	301080	百普赛斯	9,237	443,376.00	0.07
188	688300	联瑞新材	1,800	439,920.00	0.07
189	300623	捷捷微电	9,700	436,403.00	0.07
190	301005	超捷股份	3,880	432,852.80	0.07
191	300806	斯迪克	3,800	425,600.00	0.07
192	688290	景业智能	6,400	424,704.00	0.07
193	688320	禾川科技	10,200	422,790.00	0.07
194	688380	中微半导	6,400	421,824.00	0.07
195	688665	四方光电	6,400	420,480.00	0.07
196	688369	致远互联	19,400	407,594.00	0.07
197	603115	海星股份	3,300	404,151.00	0.07
198	002860	星帅尔	27,700	404,143.00	0.07
199	300653	正海生物	28,000	402,080.00	0.06
200	300581	晨曦航空	35,600	400,144.00	0.06
201	01211	比亚迪股份	6,200	390,143.97	0.06
202	300835	龙磁科技	1,700	390,133.00	0.06
203	300249	依米康	24,900	383,460.00	0.06
204	688776	国光电气	6,200	380,308.00	0.06
205	300643	万通智控	21,200	379,268.00	0.06
206	300481	濮阳惠成	19,400	368,988.00	0.06
207	300162	雷曼光电	26,700	368,727.00	0.06

208	688600	皖仪科技	10,923	363,517.44	0.06
209	300841	康华生物	7,500	356,700.00	0.06
210	300811	铂科新材	3,620	343,501.80	0.06
211	300767	震安科技	15,300	341,037.00	0.06
212	688330	宏力达	10,000	338,300.00	0.05
213	688046	药康生物	13,956	337,735.20	0.05
214	00669	创科实业	3,000	337,431.68	0.05
215	603663	三祥新材	3,500	337,050.00	0.05
216	301196	唯科科技	2,670	334,871.40	0.05
217	300900	广联航空	8,500	327,845.00	0.05
218	02628	中国人寿	14,000	324,177.60	0.05
219	688212	澳华内镜	10,800	317,520.00	0.05
220	300065	海兰信	13,700	305,647.00	0.05
221	688071	华依科技	8,000	291,520.00	0.05
222	00001	长和	5,000	287,707.19	0.05
223	688179	阿拉丁	10,283	284,941.93	0.05
224	00992	联想集团	14,000	279,916.29	0.05
225	00857	中国石油股份	38,000	279,881.55	0.05
226	603078	江化微	5,500	271,810.00	0.04
227	688170	德龙激光	2,800	268,828.00	0.04
228	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
229	688120	华海清科	800	257,744.00	0.04
230	02388	中银香港	7,000	257,664.04	0.04
231	300429	强力新材	14,400	255,168.00	0.04
232	688219	会通股份	19,000	245,860.00	0.04
233	00016	新鸿基地产	2,500	243,845.41	0.04
234	688733	壹石通	5,800	239,830.00	0.04
235	02899	紫金矿业	10,000	237,982.70	0.04
236	603166	福达股份	17,440	233,172.80	0.04
237	300903	科翔股份	2,300	233,013.00	0.04
238	00002	中电控股	3,500	222,522.51	0.04
239	603938	三孚股份	3,100	222,115.00	0.04
240	003029	吉大正元	13,800	221,076.00	0.04
241	300951	博硕科技	4,300	217,150.00	0.04
242	688165	埃夫特	10,600	216,240.00	0.03
243	688065	凯赛生物	4,400	210,540.00	0.03
244	002869	金溢科技	12,800	210,048.00	0.03
245	688200	华峰测控	400	210,040.00	0.03
246	01088	中国神华	6,000	209,077.36	0.03
247	01801	信达生物	3,000	207,409.74	0.03
248	02269	药明生物	6,500	195,336.90	0.03
249	09992	泡泡玛特	1,400	188,110.56	0.03
250	688667	菱电电控	1,400	187,110.00	0.03

251	300880	迦南智能	8,700	184,875.00	0.03
252	01024	快手-W	5,000	180,658.40	0.03
253	688010	福光股份	3,600	175,068.00	0.03
254	00175	吉利汽车	11,000	161,081.28	0.03
255	02020	安踏体育	2,600	160,447.24	0.03
256	01109	华润置地	6,000	156,339.00	0.03
257	688820	盛合晶微	1,076	152,243.24	0.02
258	00386	中国石油化工股份	42,000	145,916.40	0.02
259	01113	长实集团	3,500	134,303.89	0.02
260	02057	中通快递-W	850	126,686.70	0.02
261	00006	电能实业	2,500	123,985.51	0.02
262	09633	农夫山泉	3,600	123,883.02	0.02
263	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
264	00003	香港中华煤气	21,000	118,557.08	0.02
265	001399	惠科股份	4,035	111,890.55	0.02
266	00288	万洲国际	15,500	111,604.33	0.02
267	02359	药明康德	800	106,796.91	0.02
268	01378	中国宏桥	6,000	104,538.68	0.02
269	02015	理想汽车-W	2,600	104,059.24	0.02
270	00027	银河娱乐	4,000	102,210.96	0.02
271	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
272	00066	港铁公司	3,500	92,717.71	0.01
273	00267	中信股份	10,000	92,153.16	0.01
274	688286	敏芯股份	800	92,056.00	0.01
275	00300	美的集团	1,200	86,090.68	0.01
276	01093	石药集团	14,000	84,753.11	0.01
277	02319	蒙牛乳业	6,000	83,849.82	0.01
278	00728	中国电信	22,000	81,591.59	0.01
279	06690	海尔智家	4,600	79,826.69	0.01
280	00688	中国海外发展	7,000	73,322.99	0.01
281	01177	中国生物制药	18,000	68,945.50	0.01
282	00012	恒基地产	3,000	64,620.12	0.01
283	02382	舜宇光学科技	1,200	63,577.86	0.01
284	00836	华润电力	4,000	58,783.46	0.01
285	02331	李宁	4,500	57,532.75	0.01
286	01997	九龙仓置业	3,000	55,708.80	0.01
287	06618	京东健康	1,950	55,620.20	0.01
288	00291	华润啤酒	3,000	55,448.23	0.01
289	01928	金沙中国有限公司	4,800	54,405.97	0.01
290	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
291	00762	中国联通	10,000	53,068.41	0.01
292	02688	新奥能源	1,500	52,712.30	0.01

293	01038	长江基建集团	1,000	51,852.44	0.01
294	03692	翰森制药	2,000	51,452.90	0.01
295	02313	申洲国际	1,500	51,279.19	0.01
296	02618	京东物流	4,900	50,006.77	0.01
297	01209	华润万象生活	1,400	44,601.78	0.01
298	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
299	06862	海底捞	4,000	36,896.00	0.01
300	01929	周大福	3,600	34,081.90	0.01
301	00322	康师傅控股	4,000	33,977.68	0.01
302	01099	国药控股	2,400	33,164.71	0.01
303	00241	阿里健康	12,000	32,101.61	0.01
304	00868	信义玻璃	4,000	29,634.93	0.00
305	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
306	00285	比亚迪电子	1,500	27,255.10	0.00
307	00960	龙湖集团	4,500	23,372.68	0.00
308	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
309	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
310	01876	百威亚太	3,600	19,073.36	0.00
311	01044	恒安国际	1,000	18,882.28	0.00
312	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
313	00101	恒隆地产	3,000	17,952.93	0.00
314	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
315	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
316	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
317	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
318	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
319	00968	信义光能	8,000	14,313.70	0.00
320	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
321	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
322	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
323	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
324	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
325	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
326	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
327	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
328	00881	中升控股	1,500	6,318.70	0.00
329	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
330	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
331	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
332	001312	福恩股份	134	2,248.52	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	001309	德明利	25,478,961.00	3.28
2	300302	同有科技	21,651,087.69	2.79
3	688257	新锐股份	21,113,916.24	2.72
4	688208	道通科技	20,529,523.23	2.64
5	688239	航宇科技	20,526,562.60	2.64
6	605305	中际联合	20,020,091.18	2.58
7	300693	盛弘股份	19,077,561.00	2.46
8	300604	长川科技	18,445,110.00	2.38
9	301308	江波龙	18,261,773.68	2.35
10	603966	法兰泰克	17,864,783.60	2.30
11	002833	弘亚数控	17,842,056.20	2.30
12	688155	先惠技术	17,798,495.61	2.29
13	605118	力鼎光电	17,356,944.00	2.24
14	300394	天孚通信	17,288,755.00	2.23
15	688019	安集科技	16,798,566.67	2.16
16	603590	康辰药业	16,734,354.07	2.16
17	688201	ST 信安	16,581,525.37	2.14
18	688236	春立医疗	16,501,153.03	2.13
19	603995	甬金股份	16,496,217.00	2.13
20	688059	华锐精密	16,083,543.07	2.07
21	301219	腾远钴业	15,951,207.50	2.06
22	688519	南亚新材	15,628,422.50	2.01
23	300685	艾德生物	15,616,197.00	2.01
24	603507	振江股份	15,567,603.60	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	300302	同有科技	40,305,384.24	5.19
2	001309	德明利	34,670,296.64	4.47
3	688257	新锐股份	25,998,851.65	3.35
4	301308	江波龙	25,397,133.00	3.27
5	688019	安集科技	25,342,100.27	3.26
6	688025	杰普特	25,307,374.00	3.26
7	688059	华锐精密	24,929,450.29	3.21
8	300693	盛弘股份	24,591,772.94	3.17
9	603256	宏和科技	23,328,737.00	3.01
10	605305	中际联合	22,896,225.47	2.95
11	300394	天孚通信	22,631,491.20	2.92
12	688208	道通科技	22,630,662.77	2.92
13	300604	长川科技	21,830,669.41	2.81
14	603185	弘元绿能	21,766,887.32	2.80

15	300357	我武生物	21,288,556.00	2.74
16	603995	甬金股份	21,033,188.00	2.71
17	002860	星帅尔	20,439,161.00	2.63
18	688093	世华科技	20,295,512.53	2.61
19	605118	力鼎光电	19,858,984.00	2.56
20	603681	永冠新材	19,821,081.00	2.55
21	300035	中科电气	19,510,533.00	2.51
22	300398	飞凯材料	19,334,056.00	2.49
23	688519	南亚新材	19,298,369.91	2.49
24	688236	春立医疗	18,884,247.67	2.43
25	688677	海泰新光	18,790,336.62	2.42
26	002119	康强电子	18,662,813.74	2.40
27	002829	星网宇达	18,657,368.80	2.40
28	688200	华峰测控	18,546,913.88	2.39
29	002993	奥海科技	17,756,872.50	2.29
30	688787	海天瑞声	17,637,162.38	2.27
31	300881	盛德鑫泰	17,453,998.13	2.25
32	002997	瑞鹄模具	17,399,473.00	2.24
33	002757	南兴股份	17,241,140.00	2.22
34	600459	贵研铂业	17,129,334.00	2.21
35	603663	三祥新材	17,068,590.00	2.20
36	300775	三角防务	16,827,644.00	2.17
37	301080	百普赛斯	16,782,298.00	2.16
38	301219	腾远钴业	16,714,854.00	2.15
39	300286	安科瑞	16,667,401.94	2.15
40	688179	阿拉丁	16,599,750.86	2.14
41	601702	华峰铝业	16,542,793.00	2.13
42	002057	中钢天源	16,506,491.00	2.13
43	001696	宗申动力	16,491,080.90	2.12
44	301162	国能日新	16,456,763.40	2.12
45	688625	呈和科技	16,368,669.08	2.11
46	002158	汉钟精机	16,157,945.00	2.08
47	688131	皓元医药	16,106,921.47	2.08
48	688332	中科蓝讯	16,047,910.08	2.07
49	002392	北京利尔	15,951,839.00	2.06
50	300515	三德科技	15,783,958.00	2.03

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,591,269,535.76
卖出股票收入（成交）总额	2,831,754,973.03

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），

未考虑相关交易费用。

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投资。

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投资。

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，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

(1) 时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

(2) 套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

(3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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

上海先惠自动化技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	99,654.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	403,931.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	503,585.39

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
景顺长城 专精特新 量化优选 股票 A	6,474	46,267.29	15,718,157.88	5.25	283,816,294.98	94.75
景顺长城 专精特新 量化优选 股票 C	11,100	19,076.17	56,611,908.91	26.74	155,133,534.56	73.26
合计	17,574	29,092.97	72,330,066.79	14.15	438,949,829.54	85.85

注：分级基金机构/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 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	97.96

8.3 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	景顺长城专精特新量化优选股 票 A	18,625.67	0.006218
	景顺长城专精特新量化优选股 票 C	103,610.02	0.048931
	合计	122,235.69	0.023908

8.4 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	景顺长城专精特新量化优选 股票 A	—
	景顺长城专精特新量化优选 股票 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	景顺长城专精特新量化优选 股票 A	0~10
	景顺长城专精特新量化优选 股票 C	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城专精特新量化优选股票 A	景顺长城专精特新量化优选股票 C
基金合同生效日 (2021 年 11 月 25 日) 基金份额总额	1, 275, 795, 048. 48	677, 544, 926. 33
本报告期期初基金份 额总额	524, 594, 476. 33	270, 784, 003. 20
本报告期基金总申购 份额	39, 674, 309. 47	255, 902, 991. 34
减：本报告期基金总 赎回份额	264, 734, 332. 94	314, 941, 551. 07
本报告期基金拆分变 动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	299, 534, 452. 86	211, 745, 443. 47

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金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

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

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，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

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

本报告期内，不存在基金托管人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，不存在基金托管人相关从业人员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 (%)	
招商证券股份有限公司	3	2,875,342,385.16	53.04	1,308,275.49	53.04	未变更
兴业证券股份有限公司	3	2,545,925,916.41	46.96	1,158,395.65	46.96	未变更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

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 (%)
招商证券股份有限	165,508.96	53.97	—	—	—	—

公司						
兴业证券股份有限公司	141, 179. 63	46. 03	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
3	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
9	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
10	景顺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)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
13	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
16	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2026 年 5 月 12 日

	停机维护的通知	网站	
18	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
21	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金 2026 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
22	景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 29 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 10 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 15 日
29	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增排排网销售为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 22 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于暂停浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 24 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-------	----------------	------------

	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260421-20260514	-	159,563,807.10	142,492,656.51	17,071,150.59	3.34
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险： 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； （2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一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》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； （4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； （5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； （6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城专精特新量化优选股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日