

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 盈利投资者数量占比	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
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	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛战略新兴产业混合	
基金主代码	080008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	63,574,305.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
下属分级基金的交 易代码	080008	001834
报告期末下属分级 基金的份额总额	4,140,687.55 份	59,433,617.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，分享中国经济发展的长期收益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	（1）本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高基金收益率。 （2）本基金管理人将根据自身的研究、券商研究机构的研究，并参考《国务院关于加快培育和发展战略性新兴产业的决定》，目前在我国得到业内广泛认可的战略性新兴产业包括但不限于：节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造、新能源、新材料、新能源汽车等产业。（3）战略新兴产业的行业配置上，本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例。
业绩比较基准	50%*中证新兴产业指数+50%*中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	王小飞
	联系电话	010-86497608	021-60637103
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	021-60637228
传真	010-86497999	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	胡甲	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
本期已实现收益	1,582,880.47	11,790,220.12
本期利润	1,031,255.91	7,726,957.75
加权平均基金份额本期利润	0.2368	0.1310
本期加权平均净值利润率	7.80%	7.72%
本期基金份额净值增长率	8.36%	8.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	7,990,771.86	43,358,039.18
期末可供分配基金份额利润	1.9298	0.7295
期末基金资产净值	12,822,683.00	102,791,657.17
期末基金份额净值	3.097	1.730
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	224.85%	85.17%

注：1、所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。

2、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。

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

4、本基金自 2015 年 09 月 01 日起增加 C 类基金份额，并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。

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

长盛战略新兴产业混合 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	6.21%	0.84%	19.48%	1.03%	-13.27%	-0.19%
过去六个月	8.36%	0.91%	17.57%	0.88%	-9.21%	0.03%
过去一年	24.03%	0.80%	37.68%	0.84%	-13.65%	-0.04%
过去三年	24.28%	0.75%	43.62%	0.79%	-19.34%	-0.04%
过去五年	13.15%	0.71%	26.24%	0.74%	-13.09%	-0.03%
过去七年	78.09%	0.82%	79.98%	0.75%	-1.89%	0.07%
过去十年	69.51%	0.84%	81.25%	0.72%	-11.74%	0.12%
自基金合同生效起 至今	224.85%	0.87%	120.52%	0.83%	104.33%	0.04%

长盛战略新兴产业混合 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	6.13%	0.85%	19.48%	1.03%	-13.35%	-0.18%
过去六个月	8.26%	0.91%	17.57%	0.88%	-9.31%	0.03%
过去一年	23.84%	0.80%	37.68%	0.84%	-13.84%	-0.04%
过去三年	23.57%	0.75%	43.62%	0.79%	-20.05%	-0.04%
过去五年	12.05%	0.71%	26.24%	0.74%	-14.19%	-0.03%

过去七年	73.00%	0.82%	77.14%	0.75%	-4.14%	0.07%
过去十年	84.25%	0.97%	67.70%	0.75%	16.55%	0.22%
自基金新增本类份额起至今	85.17%	0.92%	63.69%	0.80%	21.48%	0.12%

注：1、长盛战略新兴产业混合 C 分别于 2016 年 6 月 3 日至 2019 年 3 月 12 日、2019 年 6 月 26 日至 2019 年 7 月 3 日期间未持有份额。

2、根据《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 2 月 11 日起，由“沪深 300 指数×70%+中证综合债券指数×30%”变更为“50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

$$\text{业绩比较基准} = 50\% \times \text{中证新兴产业指数} + 50\% \times \text{中证综合债券指数}$$

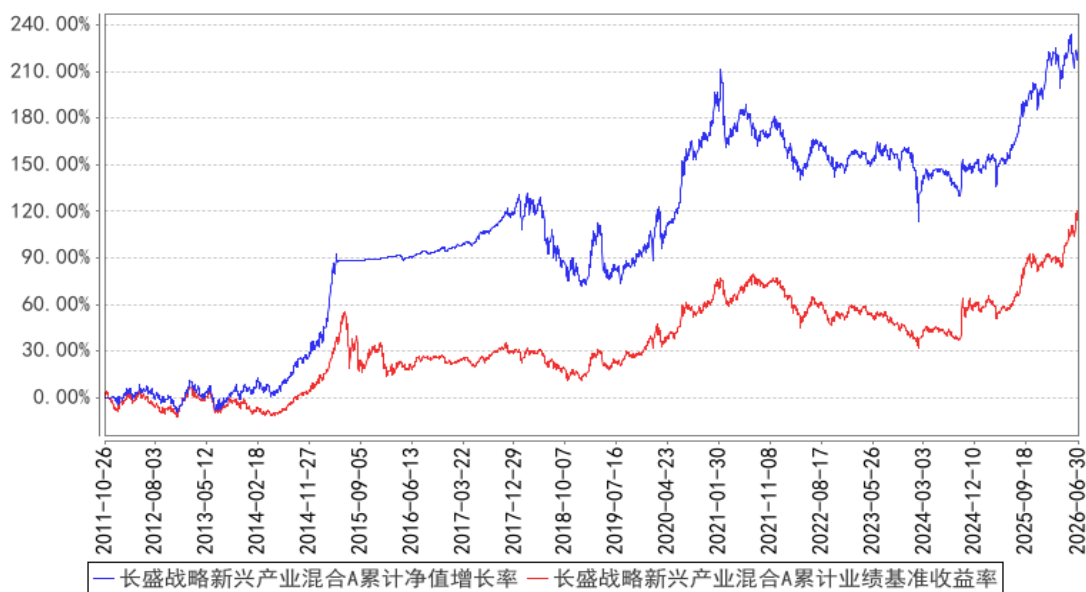
本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定中证新兴产业指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债券指数。

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制，选择上海证券交易所和深圳证券交易所两市上市的新兴产业的公司中规模大、流动性好的 100 家公司组成，以综合反映沪深两市中新兴产业公司的整体表现。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

长盛战略新兴产业混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛战略新兴产业混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长盛战略新兴产业混合C分别于2016年6月3日至2019年3月12日、2019年6月26日至2019年7月3日期间未持有份额。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 8 月 12 日	-	19 年	杨衡先生，博士、博士后。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金

资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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。

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行为。

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

1、报告期内行情回顾

2026 年上半年，中国经济的核心特征不是总量失速，而是“非对称复苏”进一步深化：生产强于需求、外需强于内需、价格修复强于终端传导、新经济显著强于旧经济。2026 年上半年，宏

观经济总体运行在合理区间，但修复动能明显依赖出口、先进制造和政策支持领域，而消费、地产、传统投资链条偏弱，导致资产价格表现高度分化。对应到资本市场，2026 年上半年，最鲜明的定价主线是“宏观弱弹性+产业强趋势”：A 股呈现极致结构分化，科创板、创业板涨幅显著超越主板，电子、通信、半导体、AI 算力链领跑；债券市场则在宽松流动性、弱信用扩张和资产荒驱动下维持强势；IPO 市场则体现出审核提速、结构偏硬科技、融资集中度提升、上市首日收益高但追高风险加大的特征。

2026 年上半年，数据显示，二季度宏观经济较一季度边际放缓，显示年初政策和外需支撑有所减弱后，呈现内生需求不足。但 GDP 绝对增量数据说明中国经济并非陷入失速，而是在更高基数和更复杂外部环境下维持了中速稳定增长。从生产端看，工业部门仍是最主要支撑，上半年规模以上工业增加值累计同比增长数据显示，二季度末工业生产有所修复。这背后主要有两层原因：一是出口链需求超预期偏强，对电子信息、装备制造、汽车、电力设备等行业形成支撑；二是高技术制造、装备制造、新质生产力相关产业仍保持扩张，产业升级对冲了地产链和传统行业的拖累。需求端则明显偏弱，内部继续分化。消费方面，社零月度同比有所回落，说明商品消费总体仍弱，政策刺激后的边际拉动开始减弱。上半年 CPI、核心 CPI 温和回升但并不强，表明居民部门真实购买力和消费意愿修复有限。这意味着消费并非没有改善，而是更多集中在服务消费和必选消费，耐用品和可选消费仍受收入预期与资产负债表约束。价格修复更多来自国际能源和上游资源品冲击，以及 AI 升级相关领域的价格支撑，而中下游价格传导有限，因此名义增长改善强于终端盈利普遍改善。综合来看，2026 年上半年，宏观经济总量平稳但斜率放缓，二季度是全年阶段性低点概率较高；出口和先进制造仍是经济主支柱，内需和地产仍是主要拖累；价格和名义增长改善已经出现，但尚未形成广泛的盈利扩散。宏观经济表现定义了上半年资产价格的主线：科技成长受益于景气和政策共振，利率债受益于弱内需和宽流动性，传统顺周期和消费链整体承压。

货币政策方面，基调是“适度宽松，但偏结构性发力而非总量强刺激”。2026 年上半年，总量宽松整体偏克制，政策重心主要在流动性管理、汇率稳定和结构性工具投放。货币政策不是“放水”，而是维持流动性宽裕、压低短端资金波动、定向支持科技和重点领域。这一政策组合效果清晰：一方面并未明显推升广谱信用扩张，另一方面显著改善了科技制造链融资条件，强化了市场对 AI、半导体、高端制造等方向的风险偏好。财政政策方面，取向依然积极，但执行节奏偏谨慎。新增政府债务总规模与上年相比增量有限，广义财政赤字率并未显著扩张。上半年财政支出节奏，未充分前倾。一方面减轻了利率债供给冲击，另一方面也使基建和顺周期板块缺乏持续基本面催化。

产业政策是上半年最具资本市场影响力的政策变量。2026 年《政府工作报告》明确提出培育

壮大新兴产业和未来产业，打造集成电路、航空航天、生物医药、低空经济等新兴支柱产业，深化拓展“人工智能+”行动，推动重点行业人工智能商业化规模化应用，实施超大规模智算集群、算电协同等新基建工程。这一政策信号意味着，宏观政策的重心不是传统地产和重基建全面刺激，而是通过产业政策塑造新增长极。资本市场制度改革也服务于这一方向。科创板“1+6”改革持续推进，其核心是设置科创成长层、重启并扩围第五套未盈利企业上市标准，同时配套资深专业机构投资者制度、IPO 预先审阅机制、扩大第五套适用范围至人工智能、商业航天、低空经济等领域、支持在审企业增资扩股、优化再融资和并购机制、完善 ETF 及衍生品体系。2026 年 6 月陆家嘴论坛又明确提出扩大科创板第五套标准适用范围至人工智能领域，进一步提高了 AI 大模型和硬科技企业的资本市场可得性。创业板改革同样是上半年重要增量，4 月 10 日证监会发布《关于深化创业板改革更好服务新质生产力发展的意见》，增设第四套上市标准，不再单纯强调盈利，转而引入营收复合增长率和研发投入指标。政策方向显著增强了资本市场对高成长、未盈利创新企业的包容性。

政策影响可以概括为三层传导：宏观层面形成“宽流动性+慢财政落地”的组合，利多债券、利多成长估值，但对传统内需链支持有限；产业层面形成“政策集中支持科技创新和新质生产力”，使 AI、半导体、先进制造成为景气与政策双升的稀缺方向；资本市场制度层面显著改善硬科技融资生态，使 IPO、并购、再融资、ETF 和中长期资金配置形成闭环，直接改变了 A 股和一级市场的结构重心。

2026 年上半年，A 股市场行情极致分化，科技成长赛道显著跑赢传统权重和红利板块，电子、通信等方向明显占优，商贸零售、食品饮料等偏内需和传统板块承压。市场并非全面牛市，而是资金和估值高度向科技硬件和 AI 链等少数高景气产业集中。AI 及其上游硬科技链条是绝对主线，反映的不是简单题材炒作，而是全球 AI 资本开支扩张、国产替代预期强化和业绩兑现共振。风格上看，A 股市场完成了从“政策预期驱动”到“产业景气驱动”的切换。年初在流动性宽松和春季躁动下出现普涨，二季度受地缘政治和外部流动性扰动影响，市场出现一致性回撤，但季末重新回归 AI 和中小盘成长抱团。这一过程中，传统大盘价值股并未获得持续资金增配，反而呈现资金从消费、金融等板块持续流出、向科技成长集中的趋势。反映的是宏观映射和结构分化：上半年经济呈现“外需强于内需、新经济强于旧经济”，市场给予出口制造、科技制造和自主可控更高溢价，而将地产链、消费链、金融链视为基本面等待验证的板块。值得注意的是，券商和非银板块在上半年并未充分受益于市场活跃度提升，显著跑输沪深 300 和科创板指数，说明市场风格偏好并没有扩散到全面风险偏好提升，而是高度集中在科技产业趋势本身，持续围绕科技主线的景气确定性与政策支持方向定价，后续需要更加重视盈利验证而非单纯扩张估值。

2026 年上半年，债券市场整体表现偏强，核心逻辑是经济弱修复、货币环境宽松、财政供给节奏偏慢、机构配置压力持续。利率债牛市来自宽流动性和弱内需，信用债行情来自资产荒和低风险偏好，可转债则在供需紧平衡下分享了权益结构行情。信用债市场“低利差、高需求”的格局，随着部分信用事件扰动和利差压到历史低位，信用债未来的资本利得空间或明显收窄。可转债方面，上半年整体跟随权益市场上行，但弹性弱于科技正股，且估值始终偏高。上半年转债市场的本质是供给偏紧、需求稳定、估值高位、结构分化。在权益主线上偏科技成长的背景下，兼具正股景气和转债弹性的品种表现更好，而单纯依赖估值抬升的品种空间有限。

2026 年上半年，A 股 IPO 市场呈现以下特征：总量及审核提速、结构硬科技化、募资集中度上升、上市表现强但分化明显、打新赚钱效应显著。上半年 IPO 板块结构方面，北交所在数量上占优，科创板在硬科技属性和单体募资规模上更突出，成为近期 IPO 募资和大项目的核心承载平台，显示 IPO 市场供给结构正在快速向硬科技倾斜，硬科技、未盈利企业和大项目逐渐成为主角。二级市场风险偏好回升叠加一级市场定价估值克制，形成了较高的新股安全垫和收益率。

2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内，我们在投资策略上始终坚持稳健操作的原则，注重加强基金投资者结构与组合资产流动性之间的匹配管理，持续跟踪基金规模变化，提前做好压力测试，积极应对可能出现的较大规模申赎。

固定收益资产配置方面，我们坚持以短期利率债为主，严格控制组合久期，未额外提升杠杆水平。同时，我们敏锐捕捉资金面松紧不均带来的交易机会，在交易所市场进行多品种、短期限的逆回购滚动操作，保持组合充裕流动性的同时，有效管理利率风险、信用风险和流动性风险。

权益投资方面，报告期内我们维持了中性略高的股票仓位，对持仓结构分散度进行了适度优化。仓位略高不代表激进，也不代表一直不动——我们根据市场变化，灵活进行小幅度的仓位优化和波段操作，及时止盈，力求在控制回撤的前提下增强收益弹性。具体配置上，我们采用哑铃型组合配置，一方面，保留红利资产作为组合的“压舱石”，这部分核心仓位有助于稳固组合、降低波动；另一方面，我们战略性地配置了科创板及新质生产力行业的相关标的，作为“卫星仓位”，积极跟随市场主线热点进行调仓和轮动，以增强组合的收益弹性，适时通过波段操作，并兑现了部分收益。报告期内，我们对仓位和结构进行了动态优化，顺应市场波动，调整了银行、电力、电信运营商及科创板标的的权重。争取每一次调仓，都是经过反复权衡风险与收益后的审慎选择。

此外，新股投资方面，在沪市股票市值满足新股网下申购要求、风控合规的前提下，我们积极参与新股网下申购，并灵活调配资金头寸，参与北交所新股申购，力求进一步获取打新收益增强。我们坚持紧密跟踪、理性定价，上市后及时变现以锁定收益，不盲目持有。

我们将继续恪守勤勉尽责的原则，在控制风险的前提下，动态优化组合，力争为持有人创造稳健、可持续的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛战略新兴产业混合 A 的基金份额净值为 3.097 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.36%，同期业绩比较基准收益率为 17.57%；截至本报告期末长盛战略新兴产业混合 C 的基金份额净值为 1.730 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.26%，同期业绩比较基准收益率为 17.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2026 年下半年宏观经济大概率在二季度阶段性探底后小幅修复，但难以出现强弹性反转，整体沿续“总量弱修复、结构强分化”的宏观态势。出口和 AI 链条可能继续保持韧性，消费和投资读数可能较上半年边际改善，但地产仍难成为增长弹性来源，全年实际 GDP 增速大概率维持在 4.7%左右。

货币政策方面，预计适度宽松基调大概率延续，但总量工具更偏相机抉择。央行已明确将根据国内外经济金融形势，综合运用准备金、逆回购、MLF 和国债买卖等工具。结合上半年未明显全面降准降息、而金融数据继续偏弱的现实，下半年或存在一次降准甚至一次小幅降息的窗口，但更可能体现为配合财政发债、稳定资金面、继续加码结构性工具，而非“大水漫灌”。财政政策方面，预计下半年比上半年更为关键。但当前最大的边际变化不在总规模，而在执行节奏。随着专项债、超长期特别国债和新型政策性金融工具落地，下半年财政有望从“蓄力”转向“形成实物工作量”，重点投向“两重”、“六张网”、城市更新、地下管网、能源电网、算力网络和民生服务领域。这意味着下半年如果顺周期板块要出现系统性修复，核心触发器是财政资金投放明确提速和项目开工落地。

A 股市场方面，预计结构性机会大概率仍多于总量性机会。上半年科技主线已经获得了显著超额收益，但下半年是否继续强势，关键将从“讲故事”切换到“看业绩”、“消化估值”。当前更值得关注的方向，一是科技自主可控，包括半导体设备材料、国产算力、AI 基础设施、工业软件；二是高端装备制造，包括机器人、工业母机、航空航天、储能设备；三是受益于低利率环境和中长期资金入市的高股息防御资产，如银行、电力、公用事业。从风格上看，下半年市场可能仍维持“K 型分化”，但内部轮动会加快。若财政落地改善投资端，建筑材料、电网设备、部分机械链和资源品存在阶段性修复机会；若内需政策加码、地产边际企稳，则消费和顺周期板块可能迎来预期修复；但在这些信号未明确前，科技成长或仍是确定性更高的主线。

债券市场方面，下半年判断或应更加中性一些。利率债的中长期支撑仍在于内需偏弱和流动

性宽松，但 10 年期国债收益率已经处于较低位置，预计继续单边大幅下行空间有限，或维持中枢震荡。风险或来自于下半年政府债券供给提速、资金面阶段性收敛，以及若政策超预期加码导致市场重新定价增长预期。信用债方面，下半年或需从“赚利差压缩的钱”切换到“赚票息和波段的钱”。当前多数中高等级信用利差已处历史低位，进一步压缩空间有限。若三季度出现供给上升、权益波动或个别信用事件扰动，可能提供更好的配置机会。可转债则仍受制于高估值和供给缩量，若权益主线继续围绕科技成长演绎，具备正股景气支撑的转债或有相对优势，但整体性价比已弱于上半年。

IPO 与新股市场下半年预计仍将维持“常态化发行+硬科技倾斜+质量优先”格局。随着科创板和创业板改革继续落地，AI、商业航天、低空经济、半导体、新型消费等赛道的上市供给可能继续增加。但要重点关注两个风险：一是超级大项目集中发行是否会对二级市场流动性阶段性抽水；二是新股上市冲高后，估值消化和回归风险或提升。

综合来看，2026 年下半年的投资重点，不是押注全面牛市或全面复苏，而是寻找“宏观弱复苏环境中的结构性、高确定性资产”。真正的超额收益，或仍将来自对“结构分化”、而非“总量改善”的准确把握。在权益上，优先看产业趋势和盈利预期兑现；在固收上，优先看票息安全垫与流动性环境；在一级市场上，优先看制度红利与供给结构变化。

2026 年下半年，或有以下风险需要警惕：第一，内需修复继续不及预期，使顺周期修复迟迟无法兑现；第二，海外流动性和地缘政治扰动，尤其是美联储路径、美元走势和大宗商品波动对全球风险偏好的冲击；第三，财政执行仍慢于预期，导致市场对政策托底失望；第四，科技主线估值过高后的业绩不及预期风险，即从“高景气预期”向“高景气验证”切换时的波动加大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，

通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	202,353.97	1,172,627.45
结算备付金		1,619,494.85	574,306.99
存出保证金		32,967.95	24,669.82
交易性金融资产	6.4.7.2	94,823,428.99	85,725,102.83
其中：股票投资		76,053,967.29	71,282,836.53
基金投资		-	-
债券投资		18,769,461.70	14,442,266.30
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	11,000,000.00	20,297,237.95
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		14,312,899.32	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,997.92	3,045.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		121,995,143.00	107,796,991.02
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		6,029,247.21	997,395.92
应付赎回款		54,246.73	57,287.75
应付管理人报酬		93,388.97	89,723.02
应付托管费		18,677.82	17,944.60
应付销售服务费		16,582.79	15,786.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		257.53	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	168,401.78	217,699.79

负债合计		6,380,802.83	1,395,838.03
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	63,574,305.54	63,068,238.19
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	52,040,034.63	43,332,914.80
净资产合计		115,614,340.17	106,401,152.99
负债和净资产总计		121,995,143.00	107,796,991.02

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛战略新兴产业混合 A 的基金份额净值为 3.097 元，份
额总额为 4,140,687.55 份;长盛战略新兴产业混合 C 的基金份额净值为 1.730 元，份额总额为
59,433,617.99 份。基金份额总额 63,574,305.54 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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		9,625,880.69	4,316,777.73
1. 利息收入		92,781.88	142,452.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,306.68	10,848.85
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		75,475.20	131,603.65
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		14,138,218.33	1,583,072.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	13,427,543.54	995,160.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	78,404.82	150,486.37
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	632,269.97	437,425.47
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	-4,614,886.93	2,590,949.62
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	9, 767. 41	303. 52
减：二、营业总支出		867, 667. 03	690, 548. 75
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	561, 726. 04	444, 961. 71
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	112, 345. 20	88, 992. 37
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	99, 209. 03	77, 577. 30
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. 00	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	94, 353. 76	79, 017. 37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8, 758, 213. 66	3, 626, 228. 98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8, 758, 213. 66	3, 626, 228. 98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8, 758, 213. 66	3, 626, 228. 98

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	63, 068, 238. 19	43, 332, 914. 80	106, 401, 152. 99
二、本期期初净资产	63, 068, 238. 19	43, 332, 914. 80	106, 401, 152. 99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	506, 067. 35	8, 707, 119. 83	9, 213, 187. 18
（一）、综合收益总额	-	8, 758, 213. 66	8, 758, 213. 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）	506, 067. 35	-51, 093. 83	454, 973. 52
其中：1. 基金申购款	2, 419, 884. 42	2, 518, 715. 97	4, 938, 600. 39
2. 基金赎回款	-1, 913, 817. 07	-2, 569, 809. 80	-4, 483, 626. 87
（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	63,574,305.54	52,040,034.63	115,614,340.17
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	63,071,954.10	26,803,656.36	89,875,610.46
二、本期期初净资产	63,071,954.10	26,803,656.36	89,875,610.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-190,607.14	3,359,300.71	3,168,693.57
（一）、综合收益总额	-	3,626,228.98	3,626,228.98
（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）	-190,607.14	-266,928.27	-457,535.41
其中：1. 基金申购款	82,041.59	106,053.94	188,095.53
2. 基金赎回款	-272,648.73	-372,982.21	-645,630.94
（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	62,881,346.96	30,162,957.07	93,044,304.03

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：

胡甲张壬午龚珉

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

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)基金份额持有人大会的决议由长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金转型而来。原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[2011]1219 号《关于核准长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金募集的批复》核准，由长盛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《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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 941,564,638.02 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 411 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 941,658,939.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,301.30 份基金份额。

原基金基金份额持有人大会自 2013 年 12 月 23 日起至 2014 年 1 月 22 日止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于修改长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议，《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2014 年 2 月 11 日生效，基金投资目标、范围和策略调整，同时“长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金”更名为“长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司 2015 年 8 月 28 日发布的《关于长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额，调低管理费率、调整赎回费率并修改基金合同的公告》，本基金自 2015 年 9 月 1 日起，根据销售服务费及申购/赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛战略新兴产业灵活配置混合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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券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。本基金投资组合中对股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者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、存出保证金及应收申购款等；投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：中证新兴产业指数*50%+中证综合债券指数*50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)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>》《证券投资基金会计核算业务指引》《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的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 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等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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[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 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，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% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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)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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、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》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	202,353.97
等于：本金	201,573.63
加：应计利息	780.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	202,353.97

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		83,845,024.99	-	76,053,967.29	-7,791,057.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	462,387.00	2,962.65	585,927.45	120,577.80
	银行间市场	18,008,838.00	173,934.25	18,183,534.25	762.00
	合计	18,471,225.00	176,896.90	18,769,461.70	121,339.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		102,316,249.99	176,896.90	94,823,428.99	-7,669,717.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	11,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	80,095.89
其中：交易所市场	79,405.89
银行间市场	690.00
应付利息	-
预提费用	83,383.76
其他	4,922.13
合计	168,401.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛战略新兴产业混合 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	4,476,543.51	4,476,543.51
本期申购	600,755.69	600,755.69
本期赎回（以“-”号填列）	-936,611.65	-936,611.65
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	4,140,687.55	4,140,687.55

长盛战略新兴产业混合 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	58,591,694.68	58,591,694.68
本期申购	1,819,128.73	1,819,128.73
本期赎回（以“-”号填列）	-977,205.42	-977,205.42
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	59,433,617.99	59,433,617.99

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

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

长盛战略新兴产业混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,022,040.50	1,294,285.80	8,316,326.30
本期期初	7,022,040.50	1,294,285.80	8,316,326.30
本期利润	1,582,880.47	-551,624.56	1,031,255.91
本期基金份额交易产生的变动数	-614,149.11	-51,437.65	-665,586.76
其中：基金申购款	1,025,124.04	200,311.54	1,225,435.58
基金赎回款	-1,639,273.15	-251,749.19	-1,891,022.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,990,771.86	691,223.59	8,681,995.45

长盛战略新兴产业混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,251,709.63	-5,235,121.13	35,016,588.50
本期期初	40,251,709.63	-5,235,121.13	35,016,588.50
本期利润	11,790,220.12	-4,063,262.37	7,726,957.75
本期基金份额交易产生的变动数	683,245.89	-68,752.96	614,492.93
其中：基金申购款	1,460,092.80	-166,812.41	1,293,280.39
基金赎回款	-776,846.91	98,059.45	-678,787.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,725,175.64	-9,367,136.46	43,358,039.18

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	15,556.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,695.35
其他	54.56
合计	17,306.68

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	13,427,543.54
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	13,427,543.54

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	138,339,924.58
减：卖出股票成本总额	124,704,477.76
减：交易费用	207,903.28
买卖股票差价收入	13,427,543.54

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	115,838.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-37,433.50
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	78,404.82

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	48,507,420.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,636,561.00
减：应计利息总额	907,420.00
减：交易费用	872.50

买卖债券差价收入	-37,433.50
----------	------------

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	632,269.97
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	632,269.97

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	-4,614,886.93
股票投资	-4,771,121.73
债券投资	156,234.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,614,886.93

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	8,619.49
基金转换费收入	1,147.92
合计	9,767.41

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,370.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	94,353.76

6.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期内，未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
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

无。

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	561,726.04	444,961.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	35,427.22	27,215.04
应支付基金管理人的净管理费	526,298.82	417,746.67

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

$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	112,345.20	88,992.37

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年托管费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛战略新兴产业混 合 A	长盛战略新兴产业混 合 C	合计
长盛基金公司	-	97,841.64	97,841.64
合计	-	97,841.64	97,841.64

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		
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C	合计
长盛基金公司	-	77,563.12	77,563.12
合计	-	77,563.12	77,563.12

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.20%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E\times \text{年销售服务费率}/\text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基础资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		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
中国建设银行	202,353.97	15,556.77	117,071.46	9,118.45
合计	202,353.97	15,556.77	117,071.46	9,118.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	限售期锁定	11.18	17.57	106	1,185.08	1,862.42	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	限售期锁定	37.88	34.86	23	871.24	801.78	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	限售期锁定	33.49	38.45	21	703.29	807.45	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	限售期锁定	21.88	25.50	37	809.56	943.50	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	限售期锁定	17.70	99.76	77	1,362.90	7,681.52	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	限售期锁定	17.52	35.90	475	8,322.00	17,052.50	-
688781	视	2026	9 个月	限售	22.68	46.82	1,086	24,630.48	50,846.52	-

	涯科技	年 3 月 18 日		期锁定						
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	限售期锁定	8.62	57.30	4,643	40,022.66	266,043.90	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	限售期锁定	92.18	462.56	29	2,673.22	13,414.24	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	限售期锁定	83.06	126.45	319	26,496.14	40,337.55	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	限售期锁定	114.28	675.74	394	45,026.32	266,241.56	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	限售期锁定	81.88	2,086.66	31	2,538.28	64,686.46	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	限售期锁定	6.41	27.75	370	2,371.70	10,267.50	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	限售期锁定	26.28	182.77	88	2,312.64	16,083.76	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	限售期锁定	55.95	57.08	46	2,573.70	2,625.68	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	限售期锁定	9.47	70.09	338	3,200.86	23,690.42	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	限售期锁定	19.68	170.81	171	3,365.28	29,208.51	-
920136	永	2026	1 个月	新股	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-

	励精密	年 6 月 25 日	内（含）	未上市						
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	1 个月内（含）	新股未上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.09	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、

由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的活期银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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，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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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》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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金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%，本基金与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上述比例限制)。

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。

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未来现金流量受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 6 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	201,573.63	-	-	780.34	202,353.97
结算备付金	1,619,353.19	-	-	141.66	1,619,494.85
存出保证金	32,964.98	-	-	2.97	32,967.95
交易性金融资产	18,309,810.00	-	282,754.80	76,230,864.19	94,823,428.99
买入返售金融资产	11,000,000.00	-	-	-	11,000,000.00
应收申购款	-	-	-	3,997.92	3,997.92
应收清算款	-	-	-	14,312,899.32	14,312,899.32
资产总计	31,163,701.80	-	282,754.80	90,548,686.40	121,995,143.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,246.73	54,246.73
应付管理人报酬	-	-	-	93,388.97	93,388.97
应付托管费	-	-	-	18,677.82	18,677.82
应付清算款	-	-	-	6,029,247.21	6,029,247.21
应付销售服务费	-	-	-	16,582.79	16,582.79
应交税费	-	-	-	257.53	257.53
其他负债	-	-	-	168,401.78	168,401.78
负债总计	-	-	-	6,380,802.83	6,380,802.83
利率敏感度缺口	31,163,701.80	-	282,754.80	84,167,883.57	115,614,340.17
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	1,172,433.94	-	-	193.51	1,172,627.45
结算备付金	574,251.19	-	-	55.80	574,306.99
存出保证金	24,667.42	-	-	2.40	24,669.82
交易性金融资产	14,005,500.00	-	-	71,719,602.83	85,725,102.83
买入返售金融资产	20,300,000.00	-	-	-2,762.05	20,297,237.95
应收申购款	-	-	-	3,045.98	3,045.98
资产总计	36,076,852.55	-	-	71,720,138.47	107,796,991.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	57,287.75	57,287.75
应付管理人报酬	-	-	-	89,723.02	89,723.02
应付托管费	-	-	-	17,944.60	17,944.60

应付清算款	-	-	-	997,395.92	997,395.92
应付销售服务费	-	-	-	15,786.95	15,786.95
其他负债	-	-	-	217,699.79	217,699.79
负债总计	-	-	-	1,395,838.03	1,395,838.03
利率敏感度缺口	36,076,852.55	-	-	70,324,300.44	106,401,152.99

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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对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上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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	76,053,967.29	65.78	71,282,836.53	66.99
合计	76,053,967.29	65.78	71,282,836.53	66.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4, 212, 219. 45	4, 146, 185. 33
	2. 业绩比较基准下降 5%	-4, 212, 219. 45	-4, 146, 185. 33

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	75, 509, 183. 68	70, 853, 592. 10
第二层次	18, 501, 650. 04	14, 442, 266. 30
第三层次	812, 595. 27	429, 244. 43
合计	94, 823, 428. 99	85, 725, 102. 83

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	76,053,967.29	62.34
	其中：股票	76,053,967.29	62.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,769,461.70	15.39
	其中：债券	18,769,461.70	15.39
	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	11,000,000.00	9.02
	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	1,821,848.82	1.49
8	其他各项资产	14,349,865.19	11.76
9	合计	121,995,143.00	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	202,392.00	0.18
C	制造业	31,680,429.94	27.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,725,730.00	11.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,328,533.35	16.72
J	金融业	11,116,882.00	9.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,053,967.29	65.78

7.2.2 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投资股票。

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	600900	长江电力	189,100	5,005,477.00	4.33
2	601288	农业银行	757,700	4,599,239.00	3.98
3	600941	中国移动	51,600	4,444,308.00	3.84
4	601728	中国电信	799,200	4,147,848.00	3.59
5	601398	工商银行	505,500	3,573,885.00	3.09
6	688282	理工导航	52,056	3,029,659.20	2.62
7	600236	桂冠电力	335,500	2,945,690.00	2.55
8	601988	中国银行	395,900	2,264,548.00	1.96
9	688258	卓易信息	18,840	2,233,293.60	1.93
10	600549	厦门钨业	26,100	2,223,720.00	1.92
11	688291	金橙子	37,861	2,214,111.28	1.92
12	688041	海光信息	5,794	2,145,518.20	1.86
13	600795	国电电力	415,000	1,938,050.00	1.68
14	688517	金冠电气	104,046	1,818,724.08	1.57
15	601985	中国核电	181,400	1,638,042.00	1.42
16	688048	长光华芯	2,760	1,385,520.00	1.20
17	603124	江南新材	6,800	1,271,464.00	1.10
18	600050	中国联通	313,900	1,255,600.00	1.09
19	601208	东材科技	17,700	1,252,983.00	1.08
20	600886	国投电力	94,100	1,252,471.00	1.08
21	605358	立昂微	15,100	1,171,760.00	1.01
22	688591	泰凌微	34,056	1,170,845.28	1.01

23	688566	吉贝尔	40,892	1,046,426.28	0.91
24	688388	嘉元科技	22,832	1,004,608.00	0.87
25	601778	晶科科技	220,000	946,000.00	0.82
26	603444	吉比特	2,600	931,892.00	0.81
27	688167	炬光科技	2,488	881,274.48	0.76
28	688307	中润光学	10,776	861,541.20	0.75
29	688195	腾景科技	4,374	842,344.92	0.73
30	688543	国科军工	21,098	832,316.10	0.72
31	688558	国盛智科	25,121	825,476.06	0.71
32	688100	威胜信息	26,262	803,354.58	0.69
33	688356	键凯科技	10,273	791,842.84	0.68
34	688368	晶丰明源	3,640	788,132.80	0.68
35	688615	合合信息	6,430	727,233.00	0.63
36	688267	中触媒	36,522	719,483.40	0.62
37	600104	上汽集团	73,400	716,384.00	0.62
38	688536	思瑞浦	1,963	714,708.67	0.62
39	688377	迪威尔	28,946	682,546.68	0.59
40	688699	明微电子	7,965	652,731.75	0.56
41	688691	灿芯股份	5,475	634,716.75	0.55
42	688236	春立医疗	41,448	599,338.08	0.52
43	688099	晶晨股份	5,675	583,957.50	0.51
44	301020	密封科技	25,600	559,104.00	0.48
45	688050	爱博医疗	15,307	557,940.15	0.48
46	688114	华大智造	10,033	512,485.64	0.44
47	688247	宣泰医药	52,440	394,348.80	0.34
48	603111	康尼机电	66,600	376,956.00	0.33
49	601319	中国人保	53,700	363,012.00	0.31
50	600873	梅花生物	47,000	345,450.00	0.30
51	688200	华峰测控	606	318,210.60	0.28
52	601336	新华保险	5,300	316,198.00	0.27
53	603109	神驰机电	18,500	297,850.00	0.26
54	600496	精工钢构	95,000	294,500.00	0.25
55	688617	惠泰医疗	1,558	282,870.48	0.24
56	688217	睿昂基因	13,662	282,256.92	0.24
57	688795	摩尔线程	394	266,241.56	0.23
58	688783	西安奕材	4,643	266,043.90	0.23
59	688001	华兴源创	2,471	211,764.70	0.18
60	601958	金钼股份	7,200	202,392.00	0.18
61	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.16
62	603345	安井食品	1,700	136,323.00	0.12
63	688808	联讯仪器	31	64,686.46	0.06
64	688781	视涯科技	1,086	50,846.52	0.04
65	688790	昂瑞微	319	40,337.55	0.03

66	688820	盛合晶微	171	29,208.51	0.03
67	688818	电科蓝天	338	23,690.42	0.02
68	688809	强一股份	32	19,936.00	0.02
69	688712	北芯生命	475	17,052.50	0.01
70	688813	泰金新能	88	16,083.76	0.01
71	688785	恒运昌	29	13,414.24	0.01
72	688811	有研复材	370	10,267.50	0.01
73	603459	红板科技	77	7,681.52	0.01
74	920136	永励精密	300	5,784.00	0.01
75	688816	易思维	46	2,625.68	0.00
76	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
77	601112	振石股份	106	1,862.42	0.00
78	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
79	603352	至信股份	37	943.50	0.00
80	603293	埃泰克	21	807.45	0.00
81	603284	林平发展	23	801.78	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	601288	农业银行	6,233,934.00	5.86
2	601398	工商银行	5,274,744.00	4.96
3	688282	理工导航	4,700,773.60	4.42
4	603890	春秋电子	3,442,979.00	3.24
5	600941	中国移动	3,394,952.00	3.19
6	600236	桂冠电力	3,394,418.00	3.19
7	601728	中国电信	3,347,514.00	3.15
8	688629	华丰科技	3,118,355.77	2.93
9	601988	中国银行	2,847,777.00	2.68
10	688106	金宏气体	2,758,671.97	2.59
11	688280	精进电动	2,664,488.19	2.50
12	688258	卓易信息	2,348,973.33	2.21
13	688517	金冠电气	2,199,610.84	2.07
14	600549	厦门钨业	2,188,453.00	2.06
15	688291	金橙子	2,049,827.29	1.93
16	688720	艾森股份	2,031,546.98	1.91
17	688372	伟测科技	1,979,175.94	1.86
18	688041	海光信息	1,651,917.74	1.55
19	688307	中润光学	1,599,480.71	1.50
20	688503	聚和材料	1,549,660.31	1.46

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	603890	春秋电子	4,491,050.00	4.22
2	688629	华丰科技	3,509,330.73	3.30
3	688106	金宏气体	3,394,652.00	3.19
4	688372	伟测科技	3,320,451.02	3.12
5	601288	农业银行	3,077,095.00	2.89
6	600961	株冶集团	2,926,036.00	2.75
7	688280	精进电动	2,335,163.68	2.19
8	688720	艾森股份	2,303,439.32	2.16
9	688691	灿芯股份	2,280,194.41	2.14
10	000758	中色股份	2,210,819.00	2.08
11	601117	中国化学	2,064,072.00	1.94
12	688700	东威科技	1,959,121.40	1.84
13	688677	海泰新光	1,928,294.37	1.81
14	601398	工商银行	1,868,372.00	1.76
15	002155	湖南黄金	1,815,472.00	1.71
16	688503	聚和材料	1,795,057.18	1.69
17	688325	赛微微电	1,735,904.29	1.63
18	688118	普元信息	1,716,921.00	1.61
19	688079	美迪凯	1,714,656.96	1.61
20	603290	斯达半导	1,620,918.00	1.52

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	134,246,730.25
卖出股票收入（成交）总额	138,339,924.58

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	303,147.70	0.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,183,534.25	15.73
	其中：政策性金融债	18,183,534.25	15.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	282,779.75	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,769,461.70	16.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	250211	25 国开 11	120,000	12,154,389.04	10.51
2	260411	26 农发 11	60,000	6,029,145.21	5.21
3	019792	25 国债 19	3,000	303,147.70	0.26
4	118068	迪威转债	1,120	176,178.06	0.15
5	113702	斯达转债	310	83,178.16	0.07

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

25 国开 11：

2025 年 7 月 25 日，京汇罚(2025)30 号显示，国家开发银行存在违规办理内保外贷业务等多项违法违规事实，被处警告，罚款，没收违法所得，罚没合计 1,394.42 万元。2025 年 9 月 30 日，银罚决字(2025)66 号显示，国家开发银行存在违反金融统计相关规定的违法违规事实，被处警告，罚款 123 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

26 农发 11：

2025 年 8 月 1 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国农业发展银行存在信贷资金投向不合规、贷后管理不到位等违法违规事实，被处罚款 1,020 万元。本基金对上述

主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

农业银行：

2025 年 10 月 31 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国农业银行股份有限公司存在相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等违法违规事实，被处罚款 2,720 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

工商银行：

2025 年 12 月 18 日，京汇罚(2025)49 号显示，中国工商银行股份有限公司存在未经批准办理跨境资产转让业务等多项违法违规事实，被处警告，罚款，没收违法所得，罚没合计 1,142.59 万元。2025 年 12 月 19 日，银罚决字(2025)110 号显示，中国工商银行股份有限公司存在违反金融统计相关规定等 10 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 434.570857 万元，罚款 3,961.50 万元。2026 年 6 月 5 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国工商银行股份有限公司存在重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等违法违规事实，被处罚款 105 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

中国银行：

2025 年 10 月 31 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国银行股份有限公司存在相关公司治理、贷款、同业、票据、资产质量、不良资产处置等业务管理不审慎的违法违规事实，被处罚款 9,790 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,967.95
2	应收清算款	14,312,899.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,997.92

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,349,865.19

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情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
长盛战略新兴产业混合 A	909	4,555.21	1,549.58	0.04	4,139,137.97	99.96
长盛战略新兴产业混合 C	3,504	16,961.65	58,166,373.69	97.87	1,267,244.30	2.13
合计	4,413	14,406.14	58,167,923.27	91.50	5,406,382.27	8.50

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，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），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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（%）	79.47

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	长盛战略新兴产业混合 A	9,662.92	0.2334
	长盛战略新兴产业混合 C	0.00	0.0000
	合计	9,662.92	0.0152

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

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	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
基金合同生效日（2011 年 10 月 26 日）基金份额总额	941,658,939.32	—
本报告期期初基金份额总额	4,476,543.51	58,591,694.68
本报告期基金总申购份额	600,755.69	1,819,128.73
减：本报告期基金总赎回份额	936,611.65	977,205.42
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	4,140,687.55	59,433,617.99

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况
根据公司 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议，公司副总经理郭堃同志不再

担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”，专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未发生变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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，本基金管理人未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国联民生证券	1	146,942,395.75	54.02	65,521.48	54.05	-
中信证券	2	124,168,926.43	45.65	55,366.79	45.67	-

招商证券	1	911,347.35	0.34	341.76	0.28	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国联民生证券	1,200,516.00	41.39	517,400,000.00	49.35	-	-
中信证券	1,699,915.00	58.61	531,080,000.00	50.65	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准：

- (1) 具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。
- (2) 具有较强的研究服务能力、有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

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	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
2	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（长盛战略新兴产业混合 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
3	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（长盛战略新兴产业混合 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日

5	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
6	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
7	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
8	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 15 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
11	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 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	20260101~20260630	22,517,552.12	0.00	0.00	22,517,552.12	35.42
	2	20260101~20260630	35,648,821.57	0.00	0.00	35,648,821.57	56.07
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日