

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	6
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	40

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	40
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	40
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	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 盈利投资者数量占比	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	43
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	44
10.8 其他重大事件	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同益成长回报混合（LOF）
场内简称	长盛同益 LOF
基金主代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,657,010.76 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。
投资策略	本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标和政策因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。 股票投资策略上，本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的 market value 分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
--------	--

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	郭明
	联系电话	010-86497608	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95588
传真		010-86497999	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100029	100140
法定代表人		胡甲	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	15,541,239.09
本期利润	19,900,010.97
加权平均基金份额本期利润	0.3999
本期加权平均净值利润率	15.86%
本期基金份额净值增长率	16.94%
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	85,912,911.74
期末可供分配基金份额利润	1.8027
期末基金资产净值	133,538,369.94
期末基金份额净值	2.802
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	177.93%
-------------	---------

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、本基金由同益证券投资基金转型而来，转型日为 2014 年 4 月 4 日。

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

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	23.71%	1.59%	6.54%	0.63%	17.17%	0.96%
过去六个月	16.94%	1.54%	4.94%	0.57%	12.00%	0.97%
过去一年	37.76%	1.41%	13.76%	0.51%	24.00%	0.90%
过去三年	44.73%	1.34%	22.49%	0.55%	22.24%	0.79%
过去五年	1.37%	1.24%	10.69%	0.55%	-9.32%	0.69%
过去七年	108.48%	1.28%	35.79%	0.58%	72.69%	0.70%
过去十年	103.93%	1.18%	59.51%	0.57%	44.42%	0.61%
自基金转型起至今	177.93%	1.33%	114.45%	0.67%	63.48%	0.66%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

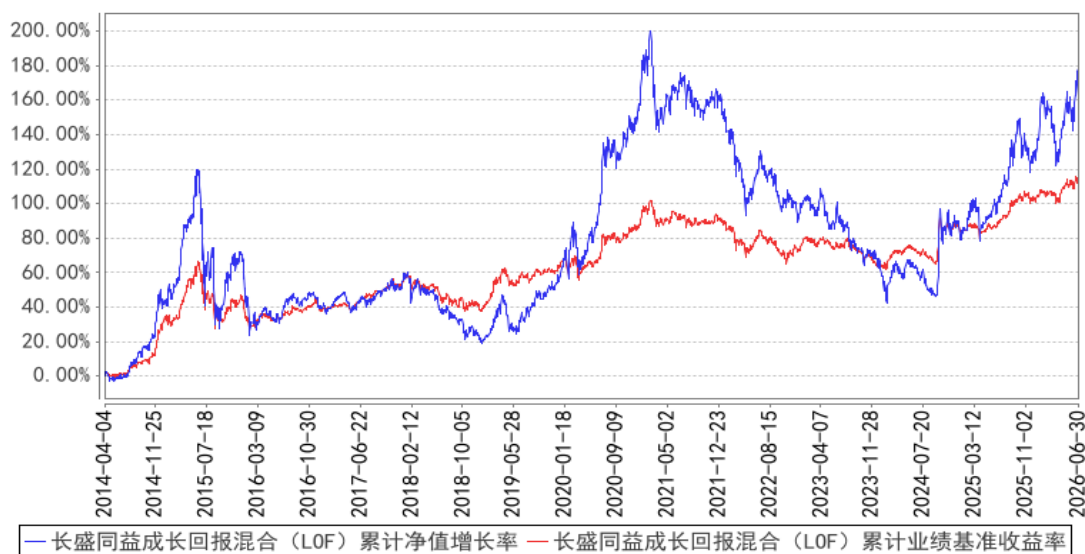
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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 自基金转型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

长盛同益成长回报混合（LOF）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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 4 月 4 日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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		
张 谊 然	本基金基金经理，长盛成长精选混合型证券投资基金基金经理，权益投资部总经理，研究部总经理。	2019 年 5 月 22 日	-	18 年	张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究员。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。

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

2026 年上半年，A 股市场整体震荡上行，但板块与行业之间显著分化，科技成长显著占优。指数层面，偏大盘价值类指数上证指数、沪深 300 分别上涨 7.5%、3.2%；偏大盘成长类指数创业板指、科创 50 上涨 64.3%、35.6%；偏中小盘指数中证 1000、国证 2000 上涨 16%、9.1%；红利指数下跌 6%。具体看，1-2 月，春季躁动带动下，市场进一步上行，成交量放大，周期与 AI 方向表现较好；3 月，美伊冲突爆发且短期内未结束，油价冲上 100 美元，全球风险资产进入 risk off 模式，市场整体调整，煤炭、石油、公用事业、电力设备相对抗跌；4 月市场震荡整固阶段，外部地缘冲突、美联储政策预期变化以及对增量刺激政策的博弈使风险偏好一度承压，但随着年报一季报陆续披露，市场逐渐从纯估值修复转向业绩与景气验证，科技成长仍保持主线地位，高股息、防御板块相对走弱。5 月上中旬市场风险偏好明显回升，A 股日均成交额超过 3 万亿元，较 4 月显著提升，表明资金活跃度显著改善，板块上，电子、通信、建筑材料、机械设备等景气方向继续领涨。5 月中下旬，美伊谈判反复叠加部分成长板块拥挤度上升，前期强势板块有所调整。6 月，A 股日均成交额维持在 3 万亿元高位，显示活跃资金仍在场内，同时资金更加聚焦于 AI 产业链、半导体、通信、机械设备、高端制造及部分涨价链方向。上半年，电子、通信、建材分别上涨 86.3%、73.6%、46.3%，商贸零售、农林牧渔、美容护理分别下跌 29.4%、25.3%、24.9%，行业

涨跌幅首尾行业相差超过 100%，行业间显著分化。

报告期内，本组合维持中高仓位，以沪深 300 行业权重为基准，超配 TMT、同时根据市场节奏与行业估值水平，动态调整周期、金融、制造的比例，消费持续低配。具体看，基于对 AI 产业的看好，组合整体持续对于 TMT 维持超配，但考虑 AI 对于软件的影响不确定性提升，组合降低了传媒与计算机的配置，主要持仓集中于 AI 硬件与国产算力及部分 AI 上游材料。基于 PPI 回升的逻辑，组合提升化工、煤炭的比例，同时对于有色板块内部细分子行业进行调整。此外，年初组合提升对新能源制造的配置比例，主要基于行业中有不少龙头公司凭借技术与成本的优势，通过出海与出口进一步增厚利润，但步入二季度，制造板块整体受到上游成本端涨价与下游需求走弱的双重压力，业绩不确定性提升，组合适度下调比例。二季度，券商板块受益于权益市场的回暖以及科技股跟投的收益，且估值处在历史较低分位，组合加大对券商的配置比例。对于消费板块，基于消费相关数据走弱，组合整体对于消费板块维持低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.802 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.94%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们依然看好权益市场以及 AI 方向，但上半年市场 K 型分化极致，下半年大概率将有所收敛。首先，AI 景气度上行叠加 PPI 转正有望带动企业盈利进一步改善，基本面的角度有支撑；其次，暂时未看到海外、国内大厂 AI 资本开支放缓的迹象，AI 景气向上的趋势未打破；此外，主动管理公募基金发行与申购回暖形成增量资金来源。但同时我们也注意到与 AI 相关的板块如电子、通信估值分位均处在历史高位，且交易相对拥挤，若出现流动性边际变化（比如美联储加息预期升温）或个股业绩低预期，可能导致相关板块波动加大。板块层面，AI 及相关产业链依然是核心方向，但从交易层面，AI 与非 AI 板块行业表现差距已达到偏极值的方向，未来存在着适度回归的可能性。

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	17,483,667.73	15,415,893.79
结算备付金		463,968.66	97,906.59
存出保证金		43,204.95	26,991.14
交易性金融资产	6.4.7.2	118,318,729.39	111,351,709.61
其中：股票投资		118,318,729.39	111,351,709.61
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		109.10	1,235.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		136,309,679.83	126,893,736.97
负 债 和 净 资 产			
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		73,632.52	932,625.55
应付赎回款		867,949.51	243,144.84

应付管理人报酬		123,936.88	123,127.69
应付托管费		20,656.16	20,521.28
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		815,699.68	815,699.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	869,435.14	863,207.55
负债合计		2,771,309.89	2,998,326.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	47,625,458.20	51,677,888.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	85,912,911.74	72,217,521.91
净资产合计		133,538,369.94	123,895,410.38
负债和净资产总计		136,309,679.83	126,893,736.97

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.802 元，基金份额总额 47,657,010.76 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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		20,869,836.78	9,300,619.51
1. 利息收入		26,488.15	29,380.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	26,488.15	29,380.09
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）		16,472,157.67	5,829,793.67
其中：股票投资收益	6.4.7.14	15,869,558.82	4,949,702.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	602,598.85	880,091.27

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, 358, 771. 88	3, 436, 917. 96
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	12, 419. 08	4, 527. 79
减：二、营业总支出		969, 825. 81	857, 532. 37
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	747, 026. 20	650, 816. 75
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	124, 504. 45	108, 469. 46
3. 销售服务费		-	-
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	98, 295. 16	98, 246. 16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19, 900, 010. 97	8, 443, 087. 14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19, 900, 010. 97	8, 443, 087. 14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19, 900, 010. 97	8, 443, 087. 14

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

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	51, 677, 888. 47	72, 217, 521. 91	123, 895, 410. 38
二、本期期初净资产	51, 677, 888. 47	72, 217, 521. 91	123, 895, 410. 38
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-4, 052, 430. 27	13, 695, 389. 83	9, 642, 959. 56
（一）、综合收益总额	-	19, 900, 010. 97	19, 900, 010. 97
（二）、本期基金份额交易产生的净资	-4, 052, 430. 27	-6, 204, 621. 14	-10, 257, 051. 41

产变动数 （净资产减少以“-” 号填列）			
其中：1. 基金申购款	186,195.83	292,456.88	478,652.71
2. 基金赎回 款	-4,238,626.10	-6,497,078.02	-10,735,704.12
（三）、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动（净资产减少以 “-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	47,625,458.20	85,912,911.74	133,538,369.94
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	57,213,903.84	50,732,727.29	107,946,631.13
二、本期期初净资产	57,213,903.84	50,732,727.29	107,946,631.13
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	-1,555,438.92	6,889,683.33	5,334,244.41
（一）、综合收益总 额	-	8,443,087.14	8,443,087.14
（二）、本期基金份 额交易产生的净资 产变动数 （净资产减少以“-” 号填列）	-1,555,438.92	-1,553,403.81	-3,108,842.73
其中：1. 基金申购款	409,310.81	341,845.88	751,156.69
2. 基金赎回 款	-1,964,749.73	-1,895,249.69	-3,859,999.42
（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	55,658,464.92	57,622,410.62	113,280,875.54

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

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金（以下简称“基金同益”）转型而成。根据基金同益的基金份额持有人大会审议通过的《关于同益证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150 号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]118 号）的同意，基金同益于 2014 年 4 月 3 日进行终止上市权益登记，2014 年 4 月 4 日终止上市。自基金同益终止上市之日起，基金同益转型为长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同益证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同益证券投资基金转换所得长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的公告》等相关规定，基金管理人确定 2014 年 5 月 14 日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币 1.000821371 元，折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第 9 位。本基金管理人按照 1:1.000821371 的折算比例对基金同益进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数，所产生的误差归入基金资产。折算前基金同益份额总额为 20 亿份，折算后基金份额总额为 2,001,642,742.00 份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 5 月 16 日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 4 月 14 日至 2014 年 5 月 9 日期间内开放集中申购，集中申购款扣除申购费后的净申购金额为人民币 686,467,684.84 元，折合 686,467,684.84 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 182,782.70 元，折合 182,782.70 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 686,650,467.54 元，折合 686,650,467.54 份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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）、股指期货、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（但须符合中国证监会相关规

定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的 0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,现金或到期日在一年期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。本基金的业绩比较基准为:50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

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>》,以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、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值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

6.4.6.2 增值税

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 826 号文《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 号文《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，对公募证券投资基金（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、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《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，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，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

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，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

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	17,483,667.73
等于：本金	17,482,340.89
加：应计利息	1,326.84
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	17,483,667.73

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		100,097,947.66	-	118,318,729.39	18,220,781.73
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		100,097,947.66	-	118,318,729.39	18,220,781.73

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

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	555,208.31
应付赎回费	3,223.89
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	128,772.92
其中：交易所市场	128,772.92
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	88,343.16
其他	93,886.86
合计	869,435.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,712,062.04	51,677,888.47
本期申购	186,320.85	186,195.83
本期赎回（以“-”号填列）	-4,241,372.13	-4,238,626.10
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	47,657,010.76	47,625,458.20

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	88,591,724.41	-16,374,202.50	72,217,521.91
本期期初	88,591,724.41	-16,374,202.50	72,217,521.91
本期利润	15,541,239.09	4,358,771.88	19,900,010.97
本期基金份额交易产生的变动数	-7,808,502.70	1,603,881.56	-6,204,621.14
其中：基金申购款	357,830.58	-65,373.70	292,456.88
基金赎回款	-8,166,333.28	1,669,255.26	-6,497,078.02

本期已分配利润	-	-	-
本期末	96,324,460.80	-10,411,549.06	85,912,911.74

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	25,978.07
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	446.52
其他	63.56
合计	26,488.15

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	15,869,558.82
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	15,869,558.82

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	246,154,287.96
减：卖出股票成本总额	229,917,690.90
减：交易费用	367,038.24
买卖股票差价收入	15,869,558.82

6.4.7.15 债券投资收益

无。

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	602,598.85
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	602,598.85

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	4,358,771.88
股票投资	4,358,771.88
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	4,358,771.88

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	12,215.14
基金转换费收入	203.94
合计	12,419.08

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	352.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	98,295.16

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
国元期货有限公司（“国元期货”）	基金管理人股东的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国元证券	-	-	54,157,250.65	21.68

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	24,148.83	21.68	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的研究服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	747,026.20	650,816.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	149,625.29	53,964.00
应支付基金管理人的净管理费	597,400.91	596,852.75

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1.20%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
----	----------------------------	---------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	124,504.45	108,469.46

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

6.4.10.3 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 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
中国工商银行	17,483,667.73	25,978.07	18,579,764.77	29,003.34
合计	17,483,667.73	25,978.07	18,579,764.77	29,003.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于国元期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按约定利率计息，存出保证金不计息。于 2026 年 6 月 30 日，本基金存放于国元期货的结算备付金余额为人民币 896.97 元，无存出保证金余额(2025 年 6 月 30 日：结算备付金余额为人民币 889.67 元，无存出保证金余额)。于 2026 年上半年度，本基金当期结算备付金利息收入为人民币 3.62 元(2025 年上半年度：人民币 3.62 元)。

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	123	1,375.14	2,161.11	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	限售期锁定	37.88	34.86	26	984.88	906.36	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	限售期锁定	33.49	38.45	22	736.78	845.90	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	限售期锁定	21.88	25.50	43	940.84	1,096.50	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	限售期锁定	17.70	99.76	78	1,380.60	7,781.28	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	限售期锁定	17.52	35.90	542	9,495.84	19,457.80	-

688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	限售期锁定	22.68	46.82	1,154	26,172.72	54,030.28	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	9个月	限售期锁定	8.62	57.30	5,628	48,513.36	322,484.40	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	限售期锁定	92.18	462.56	31	2,857.58	14,339.36	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	限售期锁定	83.06	126.45	348	28,904.88	44,004.60	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	限售期锁定	114.28	675.74	443	50,626.04	299,352.82	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	限售期锁定	104.66	768.38	333	34,851.78	255,870.54	-
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	374	2,397.34	10,378.50	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	限售期锁定	26.28	182.77	92	2,417.76	16,814.84	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	限售期锁定	55.95	57.08	53	2,965.35	3,025.24	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	限售期锁定	9.47	70.09	387	3,664.89	27,124.83	-

688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	限售期锁定	19.68	170.81	175	3,444.00	29,891.75	-
--------	------	-----------------	------	-------	-------	--------	-----	----------	-----------	---

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；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的 风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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，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，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其

上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 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	17,482,340.89	-	-	1,326.84	17,483,667.73
结算备付金	463,926.34	-	-	42.32	463,968.66
存出保证金	43,201.17	-	-	3.78	43,204.95
交易性金融资产	-	-	-	118,318,729.39	118,318,729.39
应收申购款	-	-	-	109.10	109.10
资产总计	17,989,468.40	-	-	118,320,211.43	136,309,679.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	867,949.51	867,949.51
应付管理人报酬	-	-	-	123,936.88	123,936.88
应付托管费	-	-	-	20,656.16	20,656.16
应付清算款	-	-	-	73,632.52	73,632.52
应交税费	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	869,435.14	869,435.14
负债总计	-	-	-	2,771,309.89	2,771,309.89
利率敏感度缺口	17,989,468.40	-	-	115,548,901.54	133,538,369.94
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	15,414,299.11	-	-	1,594.68	15,415,893.79
结算备付金	97,895.25	-	-	11.34	97,906.59
存出保证金	26,988.54	-	-	2.60	26,991.14
交易性金融资产	-	-	-	111,351,709.61	111,351,709.61
应收申购款	-	-	-	1,235.84	1,235.84
资产总计	15,539,182.90	-	-	111,354,554.07	126,893,736.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	243,144.84	243,144.84
应付管理人报酬	-	-	-	123,127.69	123,127.69
应付托管费	-	-	-	20,521.28	20,521.28
应付清算款	-	-	-	932,625.55	932,625.55
应交税费	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	863,207.55	863,207.55
负债总计	-	-	-	2,998,326.59	2,998,326.59
利率敏感度缺口	15,539,182.90	-	-	108,356,227.48	123,895,410.38

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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	118,318,729.39	88.60	111,351,709.61	89.88
合计	118,318,729.39	88.60	111,351,709.61	89.88

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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	15,953,251.50	15,103,188.76
	2. 业绩比较基准下降 5%	-15,953,251.50	-15,103,188.76

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	117,144,476.82	107,510,979.66
第二层次	—	3,156,188.56
第三层次	1,174,252.57	684,541.39
合计	118,318,729.39	111,351,709.61

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（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义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。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。

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	118,318,729.39	86.80
	其中：股票	118,318,729.39	86.80
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	17,947,636.39	13.17
8	其他各项资产	43,314.05	0.03
9	合计	136,309,679.83	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	6,204,451.00	4.65
C	制造业	84,572,027.92	63.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,737,508.71	7.29
J	金融业	16,133,637.00	12.08
K	房地产业	78,014.00	0.06
L	租赁和商务服务业	2,500.56	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,590,590.20	1.19
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	118,318,729.39	88.60

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	603986	兆易创新	9,600	7,824,000.00	5.86
2	688041	海光信息	17,533	6,492,469.90	4.86
3	002142	宁波银行	194,500	5,774,705.00	4.32
4	600909	华安证券	450,200	5,001,722.00	3.75
5	300408	三环集团	22,900	3,822,010.00	2.86
6	002371	北方华创	4,300	3,803,608.00	2.85
7	688702	盛科通信	9,257	3,610,137.43	2.70
8	600309	万华化学	51,600	3,529,956.00	2.64
9	688519	南亚新材	8,971	3,409,338.84	2.55
10	000636	风华高科	44,900	3,243,576.00	2.43
11	600188	兖矿能源	171,600	3,049,332.00	2.28
12	002422	科伦药业	77,600	2,989,152.00	2.24
13	000100	TCL 科技	510,000	2,968,200.00	2.22

14	600999	招商证券	127,100	2,681,810.00	2.01
15	601211	国泰海通	147,000	2,675,400.00	2.00
16	002475	立讯精密	37,700	2,654,080.00	1.99
17	688627	精智达	3,645	2,606,175.00	1.95
18	688382	益方生物	140,941	2,536,938.00	1.90
19	605376	博迁新材	9,000	2,441,700.00	1.83
20	002384	东山精密	8,900	2,334,915.00	1.75
21	688981	中芯国际	14,273	2,266,837.86	1.70
22	688256	寒武纪	1,347	2,149,205.85	1.61
23	600941	中国移动	24,000	2,067,120.00	1.55
24	601225	陕西煤业	89,300	1,817,255.00	1.36
25	600111	北方稀土	37,800	1,816,290.00	1.36
26	600549	厦门钨业	20,800	1,772,160.00	1.33
27	002859	洁美科技	16,100	1,763,111.00	1.32
28	300274	阳光电源	10,000	1,590,200.00	1.19
29	688008	澜起科技	4,926	1,526,567.40	1.14
30	603259	药明康德	12,100	1,506,571.00	1.13
31	300054	鼎龙股份	13,500	1,430,595.00	1.07
32	688777	中控技术	11,551	1,357,242.50	1.02
33	000408	藏格矿业	19,400	1,344,808.00	1.01
34	600426	华鲁恒升	55,000	1,315,600.00	0.99
35	920045	衡东光	2,063	1,299,916.93	0.97
36	605589	圣泉集团	18,700	1,188,759.00	0.89
37	301486	致尚科技	5,600	1,166,592.00	0.87
38	300757	罗博特科	1,600	990,400.00	0.74
39	688120	华海清科	2,965	955,263.70	0.72
40	600519	贵州茅台	800	948,392.00	0.71
41	002240	盛新锂能	21,100	945,913.00	0.71
42	600391	航发科技	27,300	913,185.00	0.68
43	000338	潍柴动力	32,200	877,450.00	0.66
44	600988	赤峰黄金	32,300	850,136.00	0.64
45	688169	石头科技	8,324	790,530.28	0.59
46	603786	科博达	17,200	703,652.00	0.53
47	688028	沃尔德	4,491	700,012.17	0.52
48	688808	联讯仪器	301	691,715.56	0.52
49	600872	中炬高新	38,100	661,416.00	0.50
50	002484	江海股份	6,000	630,000.00	0.47
51	688516	奥特维	10,477	601,275.03	0.45
52	688102	斯瑞新材	12,181	574,699.58	0.43
53	600893	航发动力	14,300	548,262.00	0.41
54	600259	中稀有色	4,800	487,728.00	0.37
55	301171	易点天下	13,700	465,252.00	0.35
56	300136	信维通信	3,600	429,300.00	0.32

57	300548	长芯博创	1,500	417,000.00	0.31
58	688802	沐曦股份	512	404,136.24	0.30
59	688661	和林微纳	2,400	381,552.00	0.29
60	688795	摩尔线程	513	349,507.12	0.26
61	300570	太辰光	1,400	345,394.00	0.26
62	688783	西安奕材	5,628	322,484.40	0.24
63	688818	电科蓝天	3,862	284,796.08	0.21
64	688813	泰金新能	913	189,224.84	0.14
65	688775	影石创新	1,062	147,246.30	0.11
66	688820	盛合晶微	523	97,268.03	0.07
67	688796	百奥赛图	768	84,019.20	0.06
68	688188	柏楚电子	784	83,652.80	0.06
69	688410	山外山	5,821	83,589.56	0.06
70	688790	昂瑞微	579	74,919.33	0.06
71	920522	纳科诺尔	2,801	66,383.70	0.05
72	688781	视涯科技	1,154	54,030.28	0.04
73	601155	新城控股	3,900	40,014.00	0.03
74	601026	道生天合	2,715	39,584.70	0.03
75	002244	滨江集团	5,000	38,000.00	0.03
76	688809	强一股份	38	23,674.00	0.02
77	601112	振石股份	1,223	22,214.11	0.02
78	688807	优迅股份	50	20,121.50	0.02
79	688712	北芯生命	542	19,457.80	0.01
80	603014	威高血净	566	18,525.18	0.01
81	603334	丰倍生物	486	17,267.58	0.01
82	688785	恒运昌	31	14,339.36	0.01
83	603352	至信股份	426	11,065.99	0.01
84	688811	有研复材	374	10,378.50	0.01
85	002294	信立泰	300	9,567.00	0.01
86	603284	林平发展	257	9,125.34	0.01
87	603293	埃泰克	214	8,740.94	0.01
88	603459	红板科技	78	7,781.28	0.01
89	688591	泰凌微	163	5,603.94	0.00
90	688479	友车科技	129	4,898.13	0.00
91	688653	康希通信	248	4,310.24	0.00
92	688816	易思维	59	3,378.70	0.00
93	603400	华之杰	50	2,701.00	0.00
94	603373	安邦护卫	69	2,500.56	0.00
95	603092	德力佳	32	1,727.04	0.00
96	603370	华新精科	47	1,691.06	0.00
97	603004	鼎龙科技	61	1,469.49	0.00
98	603418	友升股份	32	1,413.44	0.00
99	603193	润本股份	72	1,335.60	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	002475	立讯精密	6,613,569.00	5.34
2	688041	海光信息	5,635,706.86	4.55
3	600188	兖矿能源	5,423,679.50	4.38
4	688519	南亚新材	5,228,227.09	4.22
5	600309	万华化学	5,122,232.00	4.13
6	002142	宁波银行	4,028,532.00	3.25
7	688008	澜起科技	3,939,196.44	3.18
8	688382	益方生物	3,786,456.64	3.06
9	600909	华安证券	3,773,950.40	3.05
10	002371	北方华创	3,773,853.00	3.05
11	002384	东山精密	3,685,007.00	2.97
12	601225	陕西煤业	3,661,677.00	2.96
13	688256	寒武纪	3,427,893.13	2.77
14	600872	中炬高新	3,381,297.00	2.73
15	600111	北方稀土	3,334,454.00	2.69
16	688702	盛科通信	3,261,847.25	2.63
17	603986	兆易创新	3,208,472.00	2.59
18	002709	天赐材料	3,080,684.00	2.49
19	600487	亨通光电	3,055,275.00	2.47
20	601211	国泰海通	3,033,663.26	2.45
21	000408	藏格矿业	2,929,573.00	2.36
22	300408	三环集团	2,889,056.50	2.33
23	002422	科伦药业	2,844,182.00	2.30
24	601318	中国平安	2,763,768.00	2.23
25	688516	奥特维	2,687,822.01	2.17
26	600999	招商证券	2,589,401.00	2.09
27	002859	洁美科技	2,588,623.00	2.09
28	920045	衡东光	2,575,919.16	2.08
29	688223	晶科能源	2,562,095.28	2.07
30	002466	天齐锂业	2,483,764.00	2.00

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	002475	立讯精密	6,221,368.00	5.02
2	688256	寒武纪	5,805,832.72	4.69
3	603119	浙江荣泰	5,189,961.60	4.19
4	600487	亨通光电	5,169,357.00	4.17
5	688008	澜起科技	4,872,240.84	3.93
6	600183	生益科技	4,761,869.39	3.84

7	688519	南亚新材	4,504,029.88	3.64
8	300033	同花顺	4,329,111.00	3.49
9	688012	中微公司	4,249,696.68	3.43
10	002517	恺英网络	4,019,067.64	3.24
11	002709	天赐材料	3,727,877.00	3.01
12	688382	益方生物	3,709,762.52	2.99
13	000408	藏格矿业	3,676,662.00	2.97
14	688313	仕佳光子	3,665,990.06	2.96
15	601688	华泰证券	3,599,298.00	2.91
16	603920	世运电路	3,526,695.00	2.85
17	601318	中国平安	3,432,222.00	2.77
18	002384	东山精密	3,374,660.00	2.72
19	603986	兆易创新	3,349,044.00	2.70
20	601899	紫金矿业	3,196,938.00	2.58
21	603087	甘李药业	3,192,604.00	2.58
22	300413	芒果超媒	3,027,660.00	2.44
23	688047	龙芯中科	2,907,319.42	2.35
24	600036	招商银行	2,887,644.00	2.33
25	000776	广发证券	2,621,317.00	2.12
26	300442	润泽科技	2,539,306.48	2.05
27	600893	航发动力	2,520,186.00	2.03
28	600486	扬农化工	2,487,189.00	2.01

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	232,525,938.80
卖出股票收入（成交）总额	246,154,287.96

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

宁波银行：

2025 年 11 月 25 日，甬银罚决字(2025)18 号显示，宁波银行股份有限公司存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定的违法违规事实，被处罚款 98.80 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	43,204.95
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	109.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	43,314.05

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

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 (%)
4,973	9,583.15	221,368.90	0.46	47,435,641.86	99.54

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

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（%）	98.36

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	143,169.39	0.3004

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 4 月 4 日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	51,712,062.04
本报告期基金总申购份额	186,320.85
减：本报告期基金总赎回份额	4,241,372.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	47,657,010.76

§ 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

本报告期内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的重大人事变动情况

本报告期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安永华明会计师事务所（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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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 (%)	
申万宏源	3	329,036,623.50	68.79	146,431.77	68.74	-
浙商证券	1	108,901,176.24	22.77	48,557.29	22.80	-
长城证券	1	14,400,683.88	3.01	6,421.08	3.01	-
华创证券	1	12,286,312.58	2.57	5,478.78	2.57	-
招商证券	1	11,956,631.91	2.50	5,331.34	2.50	-
中信建投	1	1,771,831.00	0.37	790.07	0.37	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
2	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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
3	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
4	长盛基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 2 月 11 日

5	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
6	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
7	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
8	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 17 日
9	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 17 日
10	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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
11	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
12	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 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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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