

长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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 and 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	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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
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	37
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	41
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	41

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	41
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	41
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	41
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 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	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	44
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	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
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	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)
基金简称	长盛中证申万一带一路指数（LOF）
场内简称	一带一路 LOF
基金主代码	502013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	166,873,216.30 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 9 日

注：本基金由“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金”终止分级运作转型而来，上述基金合同生效日为《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、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	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66596688
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		胡甲	葛海蛟

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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	7,166,573.72
本期利润	-2,443,511.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0137
本期加权平均净值利润率	-0.94%
本期基金份额净值增长率	-1.21%
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	-210,736,356.24
期末可供分配基金份额利润	-1.2629
期末基金资产净值	235,016,143.56
期末基金份额净值	1.4084
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	-0.89%

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、本基金由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 日（即基金合同生效日）。

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

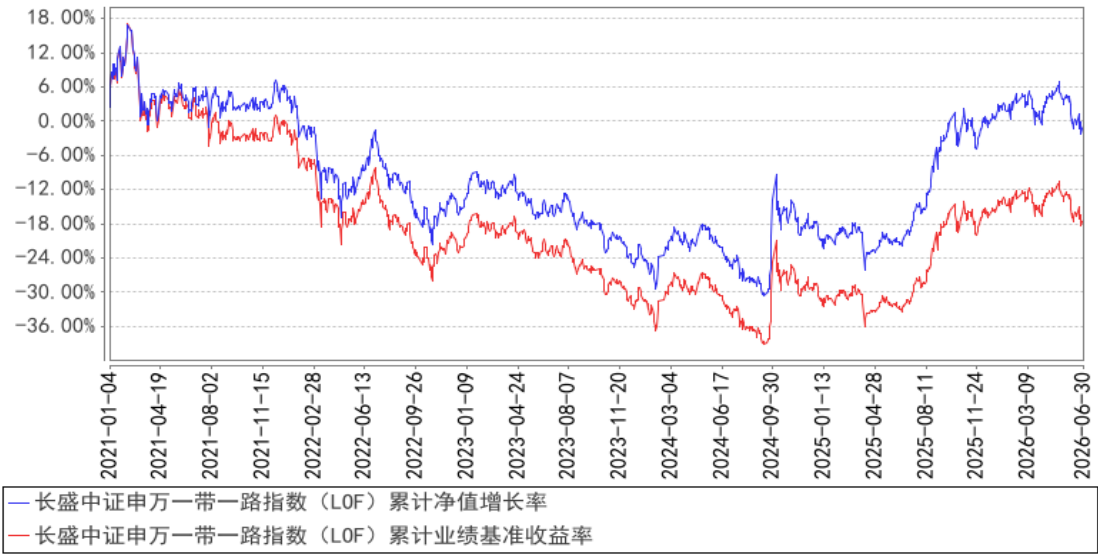
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-1.22%	0.96%	-1.74%	0.97%	0.52%	-0.01%
过去六个月	-1.21%	0.93%	-1.66%	0.94%	0.45%	-0.01%
过去一年	23.90%	0.98%	21.53%	0.99%	2.37%	-0.01%
过去三年	17.36%	1.06%	6.79%	1.08%	10.57%	-0.02%
过去五年	-6.48%	1.05%	-20.50%	1.06%	14.02%	-0.01%
自基金转型起至今	-0.89%	1.08%	-17.33%	1.09%	16.44%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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，业绩比较基准中中证申万一带一路主题指数、银行活期存款利率每日按照 95%、5% 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

长盛中证申万一带一路指数（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、本基金由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 日（即基金合同生效日）。

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		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证 A100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理，长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛	2021 年 1 月 1 日	-	17 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金

	中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，长盛上证科创板芯片指数发起式证券投资基金基金经理，长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，长盛聚利债券型证券投资基金基金经理，量化投资部总经理助理。				经理助理。
石晓冉	本基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证 A500 指数增强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。	2026 年 6 月 8 日	-	9 年	石晓冉先生，硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员，中国人保资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理，万柏私募基金管理有限公司投资经理。2025 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

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；

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自 2026 年 7 月 2 日起，陈亘斯同志不再担任长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理。

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 股市场整体在经历 2025 年四季度的震荡调整后，在 1 月初重新启动快速上涨且成交量同步急剧放大，其中科技出海板块的光通信、电路板及其上游的玻纤、光纤等细分板块上行动能充沛，而红利板块走势呈现明显的负相关性。其后在主要宽基 ETF 的资金大幅流出的引导下，市场的波动率有所降低，价格水平在高位保持震荡。2 月底 3 月初受到中东地缘冲突的突发影响，国际油价大幅调升并在高位剧烈震荡，使得全球投资者对于美联储本年度的降息空间转向极为谨慎的态度，对于滞胀风险的评估显著提升，风险偏好快速下降，进而传导至 A 股市场，使得国内股市发生显著的大面积回调，即使基本面受益的石油石化、储存芯片等板块亦冲高回落，而红利板块则走势相对稳健。

其后在二季度由于国内适度宽松的政策托底、新质生产力相关产业的持续落地，以及外部地缘风险的边际缓和，市场在 4 月后逐步修复并呈现结构性行情。本季度市场整体呈现“K 型分化”

特征，科技成长板块一枝独秀，而传统消费、金融地产等板块普遍承压。在板块结构上，AI 硬科技产业链成为绝对主线。成长板块内部，电子、通信、半导体设备等细分领域受 AI 产业资本开支扩张、国产替代加速驱动，全季度涨幅位居行业前列，成为拉动 A 股指数的核心动力；成长板块内部亦呈现明显的结构性轮动，资金精准流向业绩落地、技术突破的上游细分环节，对缺乏业绩支撑的纯概念标的逐步规避。红利与价值板块方面，受消费复苏不及预期、地产行业持续承压影响，食品饮料、银行、非银金融、房地产等板块普遍出现下跌，仅高股息、业绩确定性强的地方性银行、公用事业板块展现出一定的抗跌性，成为市场震荡中的防御性选择。此外，本季度市场日均成交金额维持在 3 万亿左右的高位，但交易集中度显著提升，“一九行情”特征凸显，多数个股难以跑赢指数，需警惕板块极致分化后出现的风格再均衡带来的短期波动风险。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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 1.4084 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.21%，同期业绩比较基准收益率为-1.66%。本报告期内日均跟踪偏离度为 0.0271%，年度化跟踪误差为 0.7794%。

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，美国科技巨头的资本开支在经历两年的大幅扩张的爆发期后，后续大概率进入边际增速放缓的平台期，目前 AI 应用在编程等方面的企业用户端有显著突破，但普通消费者端的应用性价比仍有待观察。AI 科技行业的设备原料相关的 PPI 持续处于高企状态，即所谓的 AI 产业链通胀，使得 AI 科技行业能在高企的美债利率背景下持续吸引资本流入形成正循环，但目前我们一看到部分巨头对于算力的利用率出现裂隙，并且叠加巨头们开始普遍进行债务融资，现金流压力陡增，使得市场对于美国科技行业尤其是上游设备材料的定价开始由分子端转向分母端。我们预计 AI 科技行业的景气度大概率仍会持续一段时间，但其股价受到的影响因素可能会进入成长预期和建设成本二者的拉扯阶段。此外再考虑到上半年全球科技股极致走势所吸引的杠杆资金的入场比重，杠杆率对于波动率的敏感性大概率使得其股价走势的波动率加大，风险收益率比值下降，动量因子难以维持，而反转因子很可能重新回到历史水平。A 股的科技板块受日韩和美国股市影响，亦容易进入类似的状态，但我们对 A 股市场整体仍维持震荡向上的较为乐观的态度，因为在上半年的极致分化行情中，以医药、消费、银行、公用事业为代表的红利板块和质量板块已经调整出有效的配置空间，并且当下我们看到国内宏观政策已经开始将注意力转向内需消费和居民收入提升。如果美国 AI 科技的成长预期无法维持高增速，外加中东地缘冲突的持续对于

滞胀的引导，那么科技产业链的出口一旦受到较大压力，我们预计国内刺激政策会相应加码作为对冲来扭转 K 型经济走势，而这一转变目前是市场尚未充分预期的，也是未来收益弹性的希望所在。未来 AI 应用的大面积落地和形成有效的商业闭环可能亦需要居民的收入和消费信心的修复和提升来形成发育的土壤。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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	14,163,911.40	13,488,668.83
结算备付金		21,565.80	-
存出保证金		24,828.03	12,297.85
交易性金融资产	6.4.7.2	222,209,854.45	231,697,023.15
其中：股票投资		222,209,854.45	231,697,023.15
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		-	1,950,158.32
应收股利		-	-
应收申购款		18,048.21	12,593.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		236,438,207.89	247,160,741.16
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		1,067,328.84	2,121,926.66
应付管理人报酬		200,248.48	211,339.60
应付托管费		40,049.69	42,267.92
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	114,437.32	194,818.71
负债合计		1,422,064.33	2,570,352.89
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	385,561,376.73	396,397,730.07
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-150,545,233.17	-151,807,341.80
净资产合计		235,016,143.56	244,590,388.27
负债和净资产总计		236,438,207.89	247,160,741.16

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4084 元，基金份额总额 166,873,216.30 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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		-801,502.67	-3,255,279.71

1. 利息收入		28,491.52	23,454.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,491.52	23,454.88
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）		8,747,353.08	1,814,527.24
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,766,784.27	-1,916,296.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-10,711.23
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	2,980,568.81	3,741,534.74
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	-9,610,085.10	-5,096,249.47
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	32,737.83	2,987.64
减：二、营业总支出		1,642,008.71	1,520,562.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,294,861.40	1,154,922.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	258,972.30	230,984.47
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	88,175.01	134,655.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,443,511.38	-4,775,842.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,443,511.38	-4,775,842.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,443,511.38	-4,775,842.27

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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	396,397,730.07	-151,807,341.80	244,590,388.27
二、本期期初净资产	396,397,730.07	-151,807,341.80	244,590,388.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,836,353.34	1,262,108.63	-9,574,244.71
（一）、综合收益总额	-	-2,443,511.38	-2,443,511.38
（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）	-10,836,353.34	3,705,620.01	-7,130,733.33
其中：1. 基金申购款	73,113,985.06	-27,161,688.76	45,952,296.30
2. 基金赎回款	-83,950,338.40	30,867,308.77	-53,083,029.63
（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	385,561,376.73	-150,545,233.17	235,016,143.56
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	490,071,066.20	-244,334,359.14	245,736,707.06
二、本期期初净资产	490,071,066.20	-244,334,359.14	245,736,707.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-28,247,793.10	9,711,580.57	-18,536,212.53
（一）、综合收益总额	-	-4,775,842.27	-4,775,842.27
（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）	-28,247,793.10	14,487,422.84	-13,760,370.26
其中：1. 基金申购款	2,771,366.49	-1,427,007.58	1,344,358.91
2. 基金赎回款	-31,019,159.59	15,914,430.42	-15,104,729.17
（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	461,823,273.10	-234,622,778.57	227,200,494.53
-----------	----------------	-----------------	----------------

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

根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》约定，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止长盛中证申万一带一路 A 份额与长盛中证申万一带一路 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在规定媒介发布《长盛基金管理有限公司关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向上海证券交易所申请长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的两类子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）为上市契约型开放式（LOF），存续期限为不定期。本基金的管理人为长盛基金管理有限公司，托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等，权证投资不高于基金资产净值的 3%。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。本基金的业绩比较基准为：中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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	14,163,911.40
等于：本金	14,162,534.57
加：应计利息	1,376.83
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	14,163,911.40

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		216,437,934.84	-	222,209,854.45	5,771,919.61
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		216,437,934.84	-	222,209,854.45	5,771,919.61

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	-
应付赎回费	2,693.42
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	27,441.34
其中：交易所市场	27,441.34
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56

合计	114,437.32
----	------------

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	171,562,983.08	396,397,730.07
本期申购	31,644,292.76	73,113,985.06
本期赎回（以“-”号填列）	-36,334,059.54	-83,950,338.40
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	166,873,216.30	385,561,376.73

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	-223,460,321.89	71,652,980.09	-151,807,341.80
本期期初	-223,460,321.89	71,652,980.09	-151,807,341.80
本期利润	7,166,573.72	-9,610,085.10	-2,443,511.38
本期基金份额交易产生的变动数	5,557,391.93	-1,851,771.92	3,705,620.01
其中：基金申购款	-40,931,279.44	13,769,590.68	-27,161,688.76
基金赎回款	46,488,671.37	-15,621,362.60	30,867,308.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-210,736,356.24	60,191,123.07	-150,545,233.17

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	28,245.60
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	210.26
其他	35.66
合计	28,491.52

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	5,766,784.27
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	5,766,784.27

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	110,820,346.88
减：卖出股票成本总额	104,942,168.63
减：交易费用	111,393.98
买卖股票差价收入	5,766,784.27

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	2,980,568.81
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	2,980,568.81

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	-9,610,085.10
股票投资	-9,610,085.10
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	-9,610,085.10

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	32,737.01
基金转换费收入	0.82
合计	32,737.83

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	3,872.45
合计	88,175.01

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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	215,307,013.38	100.00	86,360,184.35	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	42,182.55	100.00	27,441.34	100.00

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	16,916.10	100.00	15,652.47	100.00

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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	1,294,861.40	1,154,922.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	546,193.16	438,255.97
应支付基金管理人的净管理费	748,668.24	716,666.44

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	258,972.30	230,984.47

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
中国银行	14,163,911.40	28,245.60	12,851,927.89	23,244.96
合计	14,163,911.40	28,245.60	12,851,927.89	23,244.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	限售期锁定	28.00	27.77	57	1,596.00	1,582.89	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	限售期锁定	10.11	10.11	8,242	83,326.62	83,326.62	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	3,532	35,708.52	35,708.52	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	限售期锁定	7.82	25.28	1,122	8,774.04	28,364.16	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	限售期锁定	18.38	18.20	102	1,874.76	1,856.40	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	限售期锁定	26.66	63.44	138	3,679.08	8,754.72	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	限售期锁定	46.08	571.99	418	19,261.44	239,091.82	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	限售期锁定	58.00	112.13	89	5,162.00	9,979.57	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	限售期锁定	69.66	159.94	247	17,206.02	39,505.18	-
301683	慧	2026	6个月	限售	78.38	129.27	61	4,781.18	7,885.47	-

	谷新材	年 3 月 24 日		期锁定						
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	限售期锁定	21.93	76.74	195	4,276.35	14,964.30	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	限售期锁定	24.68	104.80	175	4,319.00	18,340.00	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	限售期锁定	11.18	17.57	239	2,672.02	4,199.23	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	限售期锁定	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	限售期锁定	33.49	38.45	51	1,707.99	1,960.95	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	限售期锁定	21.88	25.50	86	1,881.68	2,193.00	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	限售期锁定	17.70	99.76	180	3,186.00	17,956.80	-

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風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。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風險控制在限定的范围之内，使本基金在風險和收益之间取得最佳的平衡以实现“風險和收益相匹配”的風險收益目标。本基金的基金管理人对于金融工具的風險管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估測各种風險产生的可能損失。从定性分析的角度出发，判断風險損失的严重程度和出现同类風險損失的頻度。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風險量化指标、模型，日常的量化报告，确定風險損失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种風險进行监督、检查和评估，并通过相应决策，將風險控制在可承受的范围內。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易过程中因交易对手未履約合約責任，或者基金所投资證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的資信狀況进行了充分的评估，通过对投资品种信用等級评估来控制證券發行人的信用風險，且通过分散化投资以分散信用風險。本基金投资于一家公司發行的證券市值不超过基金資產淨值的 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證券，不得超过该證券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国證券登記結算有限責任公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在进行銀行間同業市場交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用風險。

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	14,162,534.57	-	-	1,376.83	14,163,911.40
结算备付金	21,563.91	-	-	1.89	21,565.80
存出保证金	24,825.87	-	-	2.16	24,828.03
交易性金融资产	-	-	-	-222,209,854.45	222,209,854.45
应收申购款	-	-	-	18,048.21	18,048.21
资产总计	14,208,924.35	-	-	-222,229,283.54	236,438,207.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,067,328.84	1,067,328.84
应付管理人报酬	-	-	-	200,248.48	200,248.48
应付托管费	-	-	-	40,049.69	40,049.69
其他负债	-	-	-	114,437.32	114,437.32
负债总计	-	-	-	1,422,064.33	1,422,064.33
利率敏感度缺口	14,208,924.35	-	-	-220,807,219.21	235,016,143.56
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	13,487,332.80	-	-	1,336.03	13,488,668.83
存出保证金	12,296.65	-	-	1.20	12,297.85
交易性金融资产	-	-	-	-231,697,023.15	231,697,023.15
应收申购款	-	-	-	12,593.01	12,593.01
应收清算款	-	-	-	1,950,158.32	1,950,158.32
资产总计	13,499,629.45	-	-	-233,661,111.71	247,160,741.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,121,926.66	2,121,926.66
应付管理人报酬	-	-	-	211,339.60	211,339.60
应付托管费	-	-	-	42,267.92	42,267.92
其他负债	-	-	-	194,818.71	194,818.71
负债总计	-	-	-	2,570,352.89	2,570,352.89
利率敏感度缺口	13,499,629.45	-	-	-231,090,758.82	244,590,388.27

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	222,209,854.45	94.55	231,697,023.15	94.73
合计	222,209,854.45	94.55	231,697,023.15	94.73

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%	11,654,631.52	12,120,890.71
	2. 业绩比较基准下降 5%	-11,654,631.52	-12,120,890.71

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	221,692,581.26	231,408,175.42
第二层次	119,035.14	-
第三层次	398,238.05	288,847.73
合计	222,209,854.45	231,697,023.15

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。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	222,209,854.45	93.98
	其中：股票	222,209,854.45	93.98
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	14,185,477.20	6.00
8	其他各项资产	42,876.24	0.02
9	合计	236,438,207.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,269,223.00	7.35
C	制造业	146,898,419.34	62.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,954,650.00	5.51
E	建筑业	1,305,696.00	0.56
F	批发和零售业	1,339,956.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	4,004,711.80	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,802,338.80	2.04
J	金融业	16,652,690.00	7.09
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	14,916,537.00	6.35
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	1,540,250.46	0.66
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	221,684,472.40	94.33

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	28,364.16	0.01
C	制造业	373,955.88	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,035.14	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,582.89	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	2,443.98	0.00
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	525,382.05	0.22

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	117,900	14,679,729.00	6.25
2	300502	新易盛	21,500	13,050,500.00	5.55
3	300274	阳光电源	74,800	11,894,696.00	5.06
4	300750	宁德时代	28,000	11,004,280.00	4.68
5	600900	长江电力	409,300	10,834,171.00	4.61
6	600519	贵州茅台	8,900	10,550,861.00	4.49
7	000333	美的集团	137,280	10,368,758.40	4.41
8	601899	紫金矿业	403,200	10,136,448.00	4.31
9	300394	天孚通信	32,860	9,946,064.80	4.23
10	000651	格力电器	176,000	6,600,000.00	2.81
11	002463	沪电股份	38,800	5,928,640.00	2.52
12	601288	农业银行	883,900	5,365,273.00	2.28
13	601328	交通银行	797,000	5,124,710.00	2.18
14	600406	国电南瑞	210,168	4,802,338.80	2.04
15	002050	三花智控	86,400	3,786,912.00	1.61
16	300760	迈瑞医疗	26,300	3,572,329.00	1.52
17	002353	杰瑞股份	22,900	3,492,250.00	1.49
18	601857	中国石油	390,300	3,387,804.00	1.44
19	002028	思源电气	18,200	3,148,600.00	1.34
20	000792	盐湖股份	98,600	2,976,734.00	1.27
21	600660	福耀玻璃	58,800	2,965,872.00	1.26
22	000568	泸州老窖	37,100	2,875,992.00	1.22
23	600690	海尔智家	138,700	2,830,867.00	1.20
24	002142	宁波银行	92,700	2,752,263.00	1.17
25	600938	中国海油	98,600	2,676,990.00	1.14
26	605117	德业股份	24,776	2,630,715.68	1.12
27	300033	同花顺	8,900	2,144,900.00	0.91
28	688019	安集科技	5,768	1,958,005.28	0.83
29	600096	云天化	63,700	1,936,480.00	0.82
30	000807	云铝股份	83,900	1,857,546.00	0.79
31	601872	招商轮船	103,500	1,818,495.00	0.77
32	601100	恒立液压	16,800	1,807,008.00	0.77
33	600885	宏发股份	51,060	1,761,059.40	0.75
34	002595	豪迈科技	33,245	1,549,217.00	0.66
35	300015	爱尔眼科	186,471	1,540,250.46	0.66
36	002222	福晶科技	15,600	1,439,568.00	0.61
37	000538	云南白药	29,300	1,387,941.00	0.59
38	603929	亚翔集成	4,800	1,305,696.00	0.56
39	600563	法拉电子	6,100	1,163,880.00	0.50

40	601877	正泰电器	45,400	1,138,178.00	0.48
41	000963	华东医药	39,900	1,121,988.00	0.48
42	600886	国投电力	82,800	1,102,068.00	0.47
43	002311	海大集团	24,200	1,079,562.00	0.46
44	600600	青岛啤酒	20,200	1,055,046.00	0.45
45	603629	利通电子	5,900	1,054,979.00	0.45
46	600233	圆通速递	66,500	1,047,375.00	0.45
47	601998	中信银行	146,400	1,014,552.00	0.43
48	601126	四方股份	16,000	1,011,200.00	0.43
49	002850	科达利	5,100	965,430.00	0.41
50	603129	春风动力	3,600	920,880.00	0.39
51	688617	惠泰医疗	5,056	917,967.36	0.39
52	300628	亿联网络	26,925	910,603.50	0.39
53	603699	纽威股份	17,300	870,190.00	0.37
54	603979	金诚信	14,300	844,129.00	0.36
55	600298	安琪酵母	23,000	832,600.00	0.35
56	002444	巨星科技	26,000	808,600.00	0.34
57	300487	蓝晓科技	13,150	773,877.50	0.33
58	300724	捷佳伟创	10,700	755,420.00	0.32
59	002831	裕同科技	20,998	746,688.88	0.32
60	603195	公牛集团	18,952	741,970.80	0.32
61	300832	新产业	17,100	718,200.00	0.31
62	002130	沃尔核材	36,800	697,728.00	0.30
63	603606	东方电缆	16,060	666,650.60	0.28
64	603596	伯特利	25,576	635,307.84	0.27
65	600025	华能水电	66,100	587,629.00	0.25
66	603298	杭叉集团	23,300	555,938.00	0.24
67	603816	顾家家居	21,200	474,032.00	0.20
68	603338	浙江鼎力	11,100	471,750.00	0.20
69	688278	特宝生物	8,605	468,112.00	0.20
70	600562	国睿科技	22,000	466,840.00	0.20
71	300718	长盛轴承	7,600	463,372.00	0.20
72	000598	兴蓉环境	67,100	430,782.00	0.18
73	603662	柯力传感	5,100	362,967.00	0.15
74	688009	中国通号	75,825	360,927.00	0.15
75	600211	西藏药业	9,600	358,944.00	0.15
76	603871	嘉友国际	34,980	357,145.80	0.15
77	000513	丽珠集团	11,800	340,902.00	0.15
78	601156	东航物流	20,900	336,908.00	0.14
79	002032	苏泊尔	8,390	332,244.00	0.14
80	300979	华利集团	10,600	315,350.00	0.13
81	002270	华明装备	16,000	301,600.00	0.13
82	688029	南微医学	4,002	287,343.60	0.12

83	002690	美亚光电	18,000	257,940.00	0.11
84	601963	重庆银行	24,900	250,992.00	0.11
85	601965	中国汽研	19,800	236,808.00	0.10
86	000506	招金黄金	19,100	223,852.00	0.10
87	600377	宁沪高速	19,300	223,301.00	0.10
88	600350	山东高速	19,900	221,487.00	0.09
89	600710	苏美达	22,800	217,968.00	0.09
90	600062	华润双鹤	12,800	205,312.00	0.09
91	002043	兔宝宝	18,100	200,548.00	0.09
92	605016	百龙创园	7,000	180,950.00	0.08
93	688100	威胜信息	5,488	167,877.92	0.07
94	603730	岱美股份	14,900	166,433.00	0.07
95	688128	中国电研	3,797	90,140.78	0.04
96	605099	共创草坪	2,600	83,720.00	0.04
97	002287	奇正藏药	3,900	73,476.00	0.03
98	002801	微光股份	2,500	69,000.00	0.03
99	603013	亚普股份	3,600	56,844.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301666	大普微	418	239,091.82	0.10
2	001248	华润新能源	11,774	119,035.14	0.05
3	301682	宏明电子	247	39,505.18	0.02
4	001257	盛龙股份	1,122	28,364.16	0.01
5	301696	三瑞智能	175	18,340.00	0.01
6	603459	红板科技	180	17,956.80	0.01
7	301687	新广益	195	14,964.30	0.01
8	301680	固德电材	89	9,979.57	0.00
9	301513	尚水智能	138	8,754.72	0.00
10	301683	慧谷新材	61	7,885.47	0.00
11	001369	双欣材料	419	5,664.88	0.00
12	601112	振石股份	239	4,199.23	0.00
13	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
14	603352	至信股份	86	2,193.00	0.00
15	603293	埃泰克	51	1,960.95	0.00
16	001312	福恩股份	102	1,856.40	0.00
17	603284	林平发展	46	1,603.56	0.00
18	001220	世盟股份	57	1,582.89	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	300502	新易盛	11,732,634.40	4.80
2	300274	阳光电源	6,003,394.00	2.45
3	601288	农业银行	5,811,565.00	2.38
4	601328	交通银行	5,525,122.00	2.26
5	300394	天孚通信	4,045,287.60	1.65
6	601899	紫金矿业	3,869,301.00	1.58
7	002353	杰瑞股份	3,604,132.00	1.47
8	000792	盐湖股份	3,095,565.00	1.27
9	002142	宁波银行	2,914,019.00	1.19
10	600519	贵州茅台	2,586,862.00	1.06
11	300750	宁德时代	2,250,903.00	0.92
12	002475	立讯精密	2,161,595.00	0.88
13	000333	美的集团	2,082,405.00	0.85
14	603259	药明康德	2,049,664.00	0.84
15	300033	同花顺	1,942,534.00	0.79
16	600900	长江电力	1,889,834.00	0.77
17	601088	中国神华	1,888,449.00	0.77
18	000858	五粮液	1,718,480.00	0.70
19	601857	中国石油	1,703,266.00	0.70
20	600406	国电南瑞	1,520,168.84	0.62

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	15,033,857.00	6.15
2	000858	五粮液	9,574,340.00	3.91
3	601088	中国神华	7,330,982.00	3.00
4	000651	格力电器	4,566,199.00	1.87
5	300274	阳光电源	3,998,344.00	1.63
6	300750	宁德时代	3,138,216.00	1.28
7	603259	药明康德	3,050,064.00	1.25
8	601899	紫金矿业	2,870,749.00	1.17
9	600406	国电南瑞	2,843,880.00	1.16
10	688313	仕佳光子	2,760,588.52	1.13
11	002463	沪电股份	2,693,663.00	1.10
12	000333	美的集团	2,563,307.00	1.05
13	601857	中国石油	2,560,227.00	1.05
14	300394	天孚通信	2,307,774.16	0.94
15	002028	思源电气	2,253,472.00	0.92
16	600900	长江电力	2,177,530.00	0.89
17	600436	片仔癀	1,671,480.00	0.68
18	600519	贵州茅台	1,654,894.00	0.68
19	601872	招商轮船	1,576,458.00	0.64
20	600690	海尔智家	1,548,240.00	0.63

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	105,065,085.03
卖出股票收入（成交）总额	110,820,346.88

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**

本报告期内本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，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	24,828.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,048.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,876.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301666	大普微	239,091.82	0.10	限售期锁定
2	001248	华润新能源	119,035.14	0.05	新股未上市
3	301682	宏明电子	39,505.18	0.02	限售期锁定
4	001257	盛龙股份	28,364.16	0.01	限售期锁定
5	301696	三瑞智能	18,340.00	0.01	限售期锁定

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（%）
23,694	7,042.85	608,854.96	0.36	166,264,361.34	99.64

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 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	1.91	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2021 年 1 月 1 日）基金份额总额	350,198,092.48
本报告期期初基金份额总额	171,562,983.08
本报告期基金总申购份额	31,644,292.76
减：本报告期基金总赎回份额	36,334,059.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	166,873,216.30

§ 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

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2026 年 6 月 8 日起，石晓冉同志担任长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理。

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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国元证券	2	215,307,013.38	100.00	42,182.55	100.00	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

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：

（1）报告期内，本基金新增租用：中邮证券 2 个交易单元。

（2）报告期内，本基金停止租用：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	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (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
5	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 2025 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
6	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
7	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (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
8	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
9	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
10	长盛基金管理有限公司关于调整长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 10 日
11	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日

	新		
12	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（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的办公地址和/或基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/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