

长信利富债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

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 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 1 月 1 日起至 2026 年 6 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.11 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利富债券型证券投资基金	
基金简称	长信利富债券	
基金主代码	519967	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 6 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
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	42,013,491.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信利富债券 A	长信利富债券 C
下属分级基金的场内简称	长信利富	-
下属分级基金的交易代码	519967	013558
报告期末下属分级基金的份额总额	37,984,417.27 份	4,029,073.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的资产管理和严格的风险控制，在保持基金资产流动性和严格控制基金资产风险的前提下，力争为投资者提供稳定增长的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。 2、债券投资策略 本基金主要采用积极管理型的投资策略，自上而下分为战略性策略和战术性策略两个层面，结合对各市场上不同投资品种的具体分析，共同构成本基金的投资策略结构。 3、股票投资策略 （1）行业配置策略 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。 （2）个股投资策略 本基金将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现基金资产的长期稳健增值。 （3）存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

	4、其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下，本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。
业绩比较基准	中证全债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏低的投资品种。

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		长信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	郭明
	联系电话	021-61009999	010-66105799
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95588
传真		021-61009800	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		肖剑	廖林

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	www.cxfund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、北京市西城区复兴门内大街 55 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司；C 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号；C 类份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

§ 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)	
	长信利富债券 A	长信利富债券 C
本期已实现收益	102,285.96	-46,567.26
本期利润	80,171.16	-270,521.92

加权平均基金份额本期利润	0.0024	-0.0167
本期加权平均净值利润率	0.18%	-1.29%
本期基金份额净值增长率	2.49%	2.29%
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	11,099,068.57	1,163,916.24
期末可供分配基金份额利润	0.2922	0.2889
期末基金资产净值	49,959,176.87	5,192,990.22
期末基金份额净值	1.3153	1.2889
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	44.90%	-2.39%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 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

长信利富债券 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	1.40%	0.46%	3.77%	0.28%	-2.37%	0.18%
过去六个月	2.49%	0.51%	4.08%	0.25%	-1.59%	0.26%
过去一年	8.05%	0.44%	7.54%	0.22%	0.51%	0.22%
过去三年	6.37%	0.34%	19.19%	0.23%	-12.82%	0.11%
过去五年	6.16%	0.52%	22.63%	0.22%	-16.47%	0.30%
过去七年	44.58%	0.62%	33.49%	0.19%	11.09%	0.43%
过去十年	41.60%	0.59%	51.64%	0.16%	-10.04%	0.43%
自基金合同生效起	44.90%	0.61%	59.65%	0.15%	-14.75%	0.46%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

长信利富债券 C

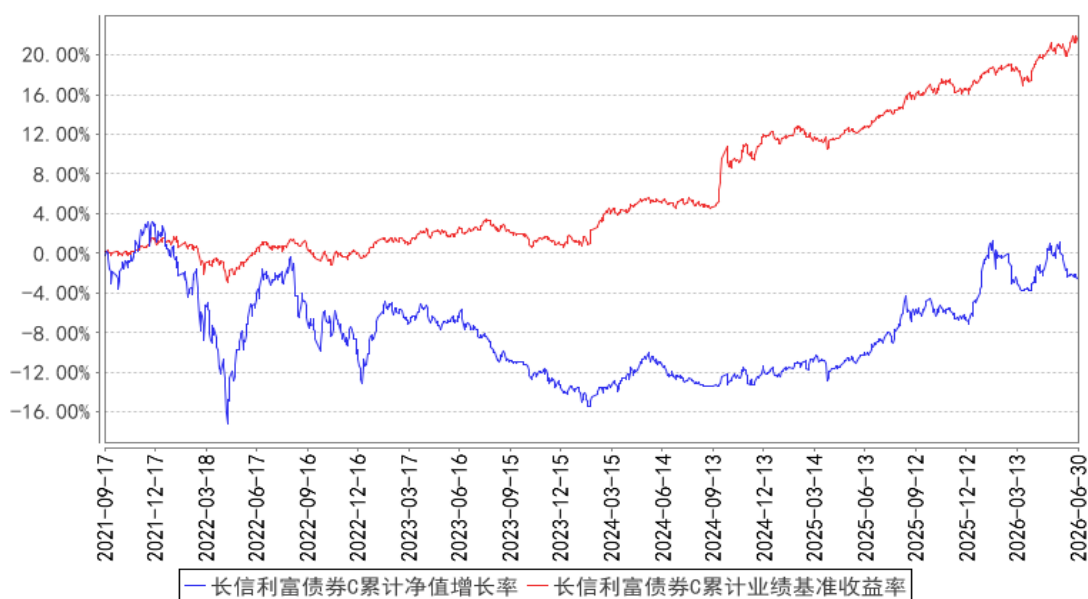
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.29%	0.46%	3.77%	0.28%	-2.48%	0.18%
过去六个月	2.29%	0.51%	4.08%	0.25%	-1.79%	0.26%
过去一年	7.53%	0.44%	7.54%	0.22%	-0.01%	0.22%
过去三年	5.03%	0.34%	19.19%	0.23%	-14.16%	0.11%
自份额增加日起至 今	-2.39%	0.51%	21.87%	0.22%	-24.26%	0.29%

注：基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准，具体情况请参见公告。

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



长信利富债券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、基金管理人自 2021 年 9 月 17 日起对长信利富债券型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信利富债券 A 图示日期为 2015 年 5 月 6 日至 2026 年 6 月 30 日，长信利富债券 C 图示日期为 2021 年 9 月 17 日（份额增加日）至 2026 年 6 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基

金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资

基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金、长信均衡配置混合型证券投资基金、长信稳健汇利 90 天持有期债券型证券投资基金、长信汇众量化选股混合型证券投资基金、长信北证 50 成份指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
肖文劲	长信可转债债 券型证券投资 基金、长信利 富债券型证券 投资基金和长 信利丰债券型 证券投资基金的基金经理、 固收研究部总 监	2025 年 1 月 3 日	-	10 年	澳大利亚墨尔本大学金融学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任建信期货有限责任公司研究员、天风证券股份有限公司研究所研究员，2021 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任固收研究部研究员，现任固收研究部总监、长信可转债债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金和长信利丰债券型证券投资基金的基金经理。
李仆	长信利保债券 型证券投资基 金、长信利富 债券型证券投 资基金、长信 稳健成长混合 型证券投资基 金、长信稳健 均衡 6 个月持 有期混合型证 券投资基金和 长信易进混合 型证券投资基 金的基金经 理、固收投资 管理中心总经 理兼固收专户 投资部总监	2026 年 4 月 17 日	-	26 年	硕士学历，具有基金从业资格，中国国籍。历任宝钢集团及其下属各金融机构投资部门投资经理，信诚基金管理有限公司投资研究部基金经理，东方基金管理有限公司基金经理及固收总监，华润元大基金管理有限公司基金经理和高级管理人员。2025 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任固收专户投资经理，现任固收投资管理中心总经理兼固收专户投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信利保债券型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金和长信易进混合型证券投资基金的基金经理。
胡梦承	长信稳健均衡	2026 年	-	7 年	南开大学国际商务硕士研究生毕业，具

	6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金和长信易进混合型证券投资基金的基金经理	4 月 9 日			有基金从业资格，中国国籍。曾任职于上海君和立成投资管理中心（有限合伙），担任投资经理。2021 年 8 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任固收研究部研究员，现任长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金和长信易进混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	---------	--	--	---

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形，未

发现异常交易行为。

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

上半年市场结构分化加剧，权益与债券走势明显背离。内部经济在政策支持下保持平稳，生产端边际修复，但需求端仍偏弱、地产延续调整，消费修复弹性有限，出口在全球 AI 产业链需求带动下维持韧性。货币政策延续适度宽松，流动性保持相对充裕，资金价格跨季前后先上后下，利率整体维持区间震荡、重心略有下移。权益市场呈现结构行情，成长科技方向大幅领涨，市场资金高度集中于少数景气主线。转债市场跟随权益回暖但整体弹性相对有限，在纯债波动加大背景下配置需求有所增加，估值抬升至历史较高水平。

面对市场的分化和波动，我们通过资产结构调整，努力实现组合回报。具体操作上，纯债维持中性久期和中高等级的持仓结构，以票息策略为主并对评级调整风险保持审慎。权益部分保持在中枢仓位寻找结构性机会。转债部分适度增配偏债型品种以增强组合的防御性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，长信利富债券 A 基金份额净值为 1.3153 元，份额累计净值为 1.4413 元，本报告期内长信利富债券 A 净值增长率为 2.49%；长信利富债券 C 基金份额净值为 1.2889 元，份额累计净值为 1.3549 元，本报告期内长信利富债券 C 净值增长率为 2.29%，同期业绩比较基准收益率为 4.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，上半年经济增速总体平稳，从完成全年目标的角度看短期政策加码的必要性有所下降，加之政策偏前置，后续内需亮点可能更偏结构性。地产仍然制约经济周期，量价表现偏弱。通胀及通胀预期仍然偏低迷，反内卷和落后产能出清政策或许能对通胀产生积极效果并影响中期利率走势，仍需等待政策落地情况。外需仍需重点跟踪，海外需求与关税节奏尚不明朗。流动性方面，从央行表态和季末操作来看，未来一段时间流动性相对宽松状态有望维持，但政府债供给高峰、缴税及中长期资金到期构成阶段性影响。

权益市场方面，我们判断三季度 A 股大概率延续震荡格局。在上半年成长科技大幅领涨之后，部分热门行业的交易拥挤度已明显提升，同时市场逐步进入中报业绩披露期，需要回避缺乏业绩支撑的高估值品种。从结构上看，我们将重点关注两类标的：（1）继续围绕 AI 产业链挖掘具有边际催化、业绩较好、估值合理的相关标的，把握从算力硬件向 AI 应用与端侧延伸过程中的结构性机会；（2）在前期 beta 较弱的行业里，挖掘业绩较优、估值处于低位、盈利指标优于同类企业的相关龙头标的，把握其在行业趋势或政策催化下的修复机会。债券仍然以票息策略为主，同时关

注利率调整后的性价比和金融机构资本债的投资机会；鉴于信用利差已处历史低位、评级调整风险上升，本基金将久期重心向 3 年以内流动性较好的中高等品种收敛。转债方面，偏股型转债在高位估值下容易面临平价与估值双杀，偏债型转债经调整后距离债底更近，权益调整期内我们更侧重偏债型品种；待权益市场企稳后，重点关注临近或已公告强赎的低溢价率转债与景气度较高的次新科技类转债。

我们将继续秉承谨慎原则，密切关注经济走势和政策动向，寻找权益资产的增强机会。坚持对信用风险的严格把控，加强组合的流动性管理，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在保证流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2025 年 10 月 28 日至 2026 年 2 月 2 日。

§ 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——长信基金管理有限责任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

本托管人依法对长信基金管理有限责任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：长信利富债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,196,360.99	349,615.03
结算备付金		1,522,914.93	15,873.18
存出保证金		44,211.20	14,785.81
交易性金融资产	6.4.7.2	51,878,306.85	15,921,219.44
其中：股票投资		4,875,884.00	2,965,716.11
基金投资		-	-
债券投资		47,002,422.85	12,955,503.33
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		3,243,157.73	741,471.52
应收股利		-	-
应收申购款		3,238.94	2,130.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		60,888,190.64	17,045,095.10
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		5,510,129.45	1,049,384.99
应付清算款		-	790,216.99
应付赎回款		26,902.40	993.13
应付管理人报酬		34,987.75	8,831.02
应付托管费		9,996.50	2,523.12
应付销售服务费		3,455.26	67.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,077.51	117.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	149,474.68	122,929.08
负债合计		5,736,023.55	1,975,063.74
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	42,013,491.25	11,746,030.51
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	13,138,675.84	3,324,000.85
净资产合计		55,152,167.09	15,070,031.36
负债和净资产总计		60,888,190.64	17,045,095.10

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，长信利富债券 A 份额净值 1.3153 元，长信利富债券 C 份额净值 1.2889 元，基金份额总额为 42,013,491.25 份，其中长信利富债券 A 份额 37,984,417.27 份。长信利富债券 C 份额 4,029,073.98 份。

6.2 利润表

会计主体：长信利富债券型证券投资基金

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		203,709.89	4,895,959.46
1. 利息收入		11,805.74	12,615.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,421.03	7,243.63
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		1,384.71	5,372.30
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		430,088.48	3,379,737.20
其中：股票投资收益	6.4.7.14	346,090.83	-14,962.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	18,064.11	3,116,506.03
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	65,933.54	278,193.96
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-246,069.46	1,503,570.38
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	7,885.13	35.95
减：二、营业总支出		394,060.65	925,782.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	226,010.78	526,433.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,574.58	150,409.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	42,709.23	95,440.90
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		54,655.20	53,000.70
其中：卖出回购金融资产支出		54,655.20	53,000.70
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		603.46	2,071.64

8. 其他费用	6.4.7.23	5,507.40	98,426.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-190,350.76	3,970,176.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-190,350.76	3,970,176.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-190,350.76	3,970,176.78

6.3 净资产变动表

会计主体：长信利富债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,746,030.51	-	3,324,000.85	15,070,031.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,746,030.51	-	3,324,000.85	15,070,031.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	30,267,460.74	-	9,814,674.99	40,082,135.73
（一）、综合收益总额	-	-	-190,350.76	-190,350.76
（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）	30,267,460.74	-	10,005,025.75	40,272,486.49
其中：1. 基金申购款	70,256,405.05	-	22,279,073.78	92,535,478.83
2. 基金赎回款	-39,988,944.31	-	-12,274,048.03	-52,262,992.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	42,013,491.25	-	13,138,675.84	55,152,167.09

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	151,481,849.31	-	26,594,820.68	178,076,669.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	151,481,849.31	-	26,594,820.68	178,076,669.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64,894,009.48	-	-8,544,684.20	-73,438,693.68
（一）、综合收益总额	-	-	3,970,176.78	3,970,176.78
（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）	-64,894,009.48	-	-12,514,860.98	-77,408,870.46
其中：1. 基金申购款	150,980.42	-	27,603.83	178,584.25
2. 基金赎回款	-65,044,989.90	-	-12,542,464.81	-77,587,454.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	86,587,839.83	-	18,050,136.48	104,637,976.31

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：

肖剑

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利富债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信利富债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会

会”)以证监许可[2015]65 号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金, 存续期限为不定期, 首次设立募集规模为 568,039,225.55 份, 经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证, 并出具了编号为毕马威华振验字第 1500369 号验资报告。基金合同于 2015 年 5 月 6 日生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金管理人于 2021 年 9 月 15 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利富债券型证券投资基金增设 C 类基金份额相关事项的公告》, 从 2021 年 9 月 17 日起, 本基金增设 C 类份额(以下简称“长信利富债券 C”), 长信利富债券 C 的年销售服务费率为 0.40%。本基金分类后, 原有基金份额将自动划归为本基金 A 类基金份额(以下简称“长信利富债券 A”), 长信利富债券 A 不收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信利富债券型证券投资基金招募说明书》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)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、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的相关规定)。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具, 包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债及分离交易可转债、中小企业私募债、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具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)。本基金还可持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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, 其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%, 投资于权益类资产的比例不超过基金资产的 20%, 现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 中证全债指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%”。

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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]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》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金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，以基金管理人为增值税纳税人，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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、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。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

(6)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	4,196,360.99
等于：本金	4,195,655.14
加：应计利息	705.85
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	4,196,360.99

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		4,862,263.13	-	4,875,884.00	13,620.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,538,949.69	473,972.85	47,002,422.85	-10,499.69
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,538,949.69	473,972.85	47,002,422.85	-10,499.69
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,401,212.82	473,972.85	51,878,306.85	3,121.18

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	4.37
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	148,374.51
其中：交易所市场	148,374.51
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	1,095.80
合计	149,474.68

注：自 2026 年 1 月 21 日起，本基金迷你期间的相关固定费用由基金管理人承担。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信利富债券 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	11,603,928.07	11,603,928.07
本期申购	31,559,995.87	31,559,995.87
本期赎回（以“-”号填列）	-5,179,506.67	-5,179,506.67
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	37,984,417.27	37,984,417.27

长信利富债券 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	142,102.44	142,102.44
本期申购	38,696,409.18	38,696,409.18
本期赎回（以“-”号填列）	-34,809,437.64	-34,809,437.64
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	4,029,073.98	4,029,073.98

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信利富债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,788,996.83	498,045.32	3,287,042.15
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,788,996.83	498,045.32	3,287,042.15
本期利润	102,285.96	-22,114.80	80,171.16
本期基金份额交易产生的变动数	8,207,785.78	399,760.51	8,607,546.29
其中：基金申购款	9,747,019.18	639,274.88	10,386,294.06
基金赎回款	-1,539,233.40	-239,514.37	-1,778,747.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,099,068.57	875,691.03	11,974,759.60

长信利富债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,101.58	-22,142.88	36,958.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	59,101.58	-22,142.88	36,958.70
本期利润	-46,567.26	-223,954.66	-270,521.92
本期基金份额交易产生的变动数	1,857,708.08	-460,228.62	1,397,479.46
其中：基金申购款	18,172,187.71	-6,279,407.99	11,892,779.72
基金赎回款	-16,314,479.63	5,819,179.37	-10,495,300.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,870,242.40	-706,326.16	1,163,916.24

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	7,707.49
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	1,791.08
其他	922.46
合计	10,421.03

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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	223,266,030.29
减：卖出股票成本总额	222,575,744.49
减：交易费用	344,194.97
买卖股票差价收入	346,090.83

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	337,350.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-319,286.56
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	18,064.11

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	254,099,997.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	253,211,956.17
减：应计利息总额	1,194,984.08
减：交易费用	12,343.33
买卖债券差价收入	-319,286.56

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	65,933.54
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	65,933.54

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	-246,069.46
股票投资	-194,896.93
债券投资	-51,172.53
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	-246,069.46

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	6,894.26
基金转换费收入	990.87

合计	7,885.13
----	----------

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余不低于赎回费总额的 25%应归基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

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	1,095.80
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	2,066.60
银行费用	2,345.00
合计	5,507.40

注：自 2026 年 1 月 21 日起，本基金迷你期间的相关固定费用由基金管理人承担。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	226,010.78	526,433.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	33,682.38	150,459.43
应支付基金管理人的净管理费	192,328.40	375,974.26

注：支付基金管理人长信基金的基金管理费按前一日基金资产净值×0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.70%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,574.58	150,409.59

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率计提逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利富债券 A	长信利富债券 C	合计

长信基金	-	17,838.17	17,838.17
工商银行	-	372.16	372.16
合计	-	18,210.33	18,210.33
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		
	长信利富债券 A	长信利富债券 C	合计
长信基金	-	3.61	3.61
工商银行	-	91.97	91.97
合计	-	95.58	95.58

注：根据基金合同的规定，长信利富债券 A 不收取销售服务费，长信利富债券 C 的销售服务费按基金前一日资产净值×0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×销售服务费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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	4,196,360.99	7,707.49	1,113,166.30	5,586.69

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2026 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2025 年 6 月 30 日：同）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 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

本基金本报告期末未持有认购新发/增发证券等流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,510,129.45 元，于 2026 年 7 月 1 日、2026 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，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发行的证券，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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	44,695,971.51	8,463,045.90
合计	44,695,971.51	8,463,045.90

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	440,719.05
AAA 以下	-	2,469,322.32
未评级	2,306,451.34	1,582,416.06
合计	2,306,451.34	4,492,457.43

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

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。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人 对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	4,196,360.99	-	-	-	-	4,196,360.99
结算备付金	1,522,914.93	-	-	-	-	1,522,914.93
存出保证金	44,211.20	-	-	-	-	44,211.20
交易性金融资产	44,695,971.51	2,306,451.34	-	-	4,875,884.00	51,878,306.85
应收申购款	-	-	-	-	3,238.94	3,238.94
应收清算款	-	-	-	-	3,243,157.73	3,243,157.73
资产总计	50,459,458.63	2,306,451.34	-	-	8,122,280.67	60,888,190.64
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	26,902.40	26,902.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	34,987.75	34,987.75
应付托管费	-	-	-	-	9,996.50	9,996.50
卖出回购金融资产款	5,510,129.45	-	-	-	-	5,510,129.45
应付销售服务费	-	-	-	-	3,455.26	3,455.26
应交税费	-	-	-	-	1,077.51	1,077.51
其他负债	-	-	-	-	149,474.68	149,474.68
负债总计	5,510,129.45	-	-	-	225,894.10	5,736,023.55

利率敏感度缺口	44,949,329.18	2,306,451.34	-	-	-7,896,386.57	55,152,167.09
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	349,615.03	-	-	-	-	349,615.03
结算备付金	15,873.18	-	-	-	-	15,873.18
存出保证金	14,785.81	-	-	-	-	14,785.81
交易性金融资产	5,662,348.11	5,710,739.16	201,692.33	1,380,723.73	2,965,716.11	15,921,219.44
应收申购款	-	-	-	-	2,130.12	2,130.12
应收清算款	-	-	-	-	741,471.52	741,471.52
资产总计	6,042,622.13	5,710,739.16	201,692.33	1,380,723.73	3,709,317.75	17,045,095.10
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	993.13	993.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,831.02	8,831.02
应付托管费	-	-	-	-	2,523.12	2,523.12
应付清算款	-	-	-	-	790,216.99	790,216.99
卖出回购金融资产款	1,049,384.99	-	-	-	-	1,049,384.99
应付销售服务费	-	-	-	-	67.67	67.67
应交税费	-	-	-	-	117.74	117.74
其他负债	-	-	-	-	122,929.08	122,929.08
负债总计	1,049,384.99	-	-	-	925,678.75	1,975,063.74
利率敏感度缺口	4,993,237.14	5,710,739.16	201,692.33	1,380,723.73	2,783,639.00	15,070,031.36

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 27 个基点	-31,719.75	-62,897.87
	市场利率下降 27 个基点	31,719.75	62,897.87

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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

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	4,875,884.00	8.84	2,965,716.11	19.68
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	47,002,422.85	85.22	12,955,503.33	85.97
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	51,878,306.85	94.06	15,921,219.44	105.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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）

	VaR 值为 0.41%(2025 年 12 月 31 日 VaR 值为 0.95%)	-223,598.47	-143,634.94
--	---	-------------	-------------

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2025 年的分析同样基于该假设。

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	4,875,884.00	5,875,757.48
第二层次	47,002,422.85	10,045,461.96
第三层次	-	-
合计	51,878,306.85	15,921,219.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金分别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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	4,875,884.00	8.01
	其中：股票	4,875,884.00	8.01
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	47,002,422.85	77.19
	其中：债券	47,002,422.85	77.19
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	5,719,275.92	9.39
8	其他各项资产	3,290,607.87	5.40
9	合计	60,888,190.64	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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	46,576.00	0.08
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,266,211.00	5.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	662,222.00	1.20
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	397,261.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	53,550.00	0.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,546.00	0.10

J	金融业	-	-
K	房地产业	171,398.00	0.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	170,280.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	51,840.00	0.09
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	4,875,884.00	8.84

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通过港股通交易机制投资港股。

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	300972	万辰集团	1,300	225,433.00	0.41
2	300558	贝达药业	2,900	188,703.00	0.34
3	300199	翰宇药业	8,400	185,472.00	0.34
4	000672	上峰材料	7,700	182,336.00	0.33
5	600060	海信视像	6,500	181,155.00	0.33
6	002317	众生药业	7,300	179,361.00	0.33
7	002422	科伦药业	4,600	177,192.00	0.32
8	002345	潮宏基	19,000	174,230.00	0.32
9	300888	稳健医疗	6,200	173,538.00	0.31
10	000062	深圳华强	5,400	171,828.00	0.31
11	600011	华能国际	22,600	171,534.00	0.31
12	600641	先导基电	4,300	171,398.00	0.31
13	002832	比音勒芬	8,300	171,312.00	0.31
14	688131	皓元医药	1,800	170,280.00	0.31
15	000921	海信家电	6,200	169,384.00	0.31
16	601985	中国核电	18,500	167,055.00	0.30
17	002668	TCL 智家	15,000	166,200.00	0.30
18	000600	建投能源	18,700	163,625.00	0.30
19	601991	大唐发电	22,600	160,008.00	0.29
20	600516	方大炭素	25,600	157,952.00	0.29
21	603345	安井食品	1,000	80,190.00	0.15
22	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.14
23	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.14
24	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.11
25	688045	必易微	700	56,546.00	0.10

26	000408	藏格矿业	800	55,456.00	0.10
27	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.10
28	600233	圆通速递	3,400	53,550.00	0.10
29	688400	凌云光	800	52,960.00	0.10
30	002838	道恩股份	1,700	52,054.00	0.09
31	603317	天味食品	4,000	52,040.00	0.09
32	002810	山东赫达	2,100	51,870.00	0.09
33	603588	高能环境	2,700	51,840.00	0.09
34	002709	天赐材料	1,000	51,430.00	0.09
35	000933	神火股份	2,400	50,880.00	0.09
36	002216	三全食品	4,400	50,732.00	0.09
37	600150	中国船舶	1,500	50,685.00	0.09
38	603711	香飘飘	4,500	49,995.00	0.09
39	002956	西麦食品	2,400	49,824.00	0.09
40	600419	天润乳业	6,500	49,205.00	0.09
41	002154	报喜鸟	13,800	49,128.00	0.09
42	301031	中熔电气	400	47,780.00	0.09
43	002645	华宏科技	1,700	46,767.00	0.08
44	002772	众兴菌业	4,100	46,576.00	0.08
45	301358	湖南裕能	600	45,522.00	0.08

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	300308	中际旭创	2,139,453.00	14.20
2	002119	康强电子	2,137,360.00	14.18
3	301369	联动科技	2,098,820.00	13.93
4	300408	三环集团	1,724,857.00	11.45
5	688313	仕佳光子	1,713,292.09	11.37
6	688720	艾森股份	1,406,461.87	9.33
7	300502	新易盛	1,349,613.00	8.96
8	688072	拓荆科技	1,306,679.88	8.67
9	000988	华工科技	1,292,089.00	8.57
10	300628	亿联网络	1,277,426.00	8.48
11	603005	晶方科技	1,255,637.00	8.33
12	600522	中天科技	1,241,882.00	8.24
13	600900	长江电力	1,234,798.00	8.19
14	603160	汇顶科技	1,225,649.93	8.13
15	688256	寒武纪	1,223,344.00	8.12
16	688508	芯朋微	1,196,015.37	7.94
17	603061	金海通	1,170,938.00	7.77
18	002583	海能达	1,092,814.00	7.25
19	688146	中船特气	1,070,220.41	7.10

20	300476	胜宏科技	1,046,535.00	6.94
21	688372	伟测科技	1,025,306.54	6.80
22	000810	创维数字	1,020,610.00	6.77
23	688498	源杰科技	1,013,139.10	6.72
24	601001	晋控煤业	989,652.00	6.57
25	600909	华安证券	974,635.26	6.47
26	601699	潞安环能	967,035.00	6.42
27	600183	生益科技	964,197.00	6.40
28	601101	昊华能源	963,135.00	6.39
29	688361	中科飞测	935,972.00	6.21
30	300666	江丰电子	907,092.00	6.02
31	600765	中航重机	895,650.00	5.94
32	601872	招商轮船	871,538.31	5.78
33	000408	藏格矿业	855,255.00	5.68
34	300373	扬杰科技	843,957.00	5.60
35	688120	华海清科	838,897.94	5.57
36	688027	国盾量子	834,693.91	5.54
37	300474	景嘉微	817,868.00	5.43
38	600582	天地科技	809,283.00	5.37
39	300620	光库科技	789,496.00	5.24
40	600198	大唐电信	771,880.00	5.12
41	000027	深圳能源	771,601.00	5.12
42	002709	天赐材料	770,310.00	5.11
43	688519	南亚新材	765,556.22	5.08
44	301308	江波龙	762,724.15	5.06
45	600460	士兰微	757,156.00	5.02
46	603799	华友钴业	717,713.00	4.76
47	688582	芯动联科	715,522.00	4.75
48	688362	甬矽电子	713,384.89	4.73
49	688052	纳芯微	712,822.00	4.73
50	603259	药明康德	712,083.00	4.73
51	688018	乐鑫科技	711,217.38	4.72
52	688206	概伦电子	711,019.50	4.72
53	688591	泰凌微	707,856.64	4.70
54	688380	中微半导	706,555.97	4.69
55	688593	新相微	696,085.86	4.62
56	688059	华锐精密	696,023.84	4.62
57	603565	中谷物流	691,553.00	4.59
58	688318	财富趋势	690,131.39	4.58
59	300782	卓胜微	689,337.00	4.57
60	688692	达梦数据	683,298.49	4.53
61	300623	捷捷微电	679,861.00	4.51
62	688691	灿芯股份	678,948.00	4.51

63	002345	潮宏基	676,056.00	4.49
64	600863	华能蒙电	668,017.00	4.43
65	002050	三花智控	666,230.00	4.42
66	688583	思看科技	658,604.32	4.37
67	688347	华虹宏力	653,945.87	4.34
68	600105	永鼎股份	653,064.00	4.33
69	600487	亨通光电	652,009.00	4.33
70	688515	裕太微	649,918.56	4.31
71	688469	芯联集成	649,052.20	4.31
72	603078	江化微	649,006.00	4.31
73	688702	盛科通信	648,919.26	4.31
74	300604	长川科技	646,025.00	4.29
75	688536	思瑞浦	644,420.00	4.28
76	600171	上海贝岭	643,908.00	4.27
77	002409	雅克科技	643,275.00	4.27
78	600875	东方电气	643,235.00	4.27
79	002027	分众传媒	637,426.00	4.23
80	688003	天准科技	636,162.51	4.22
81	603588	高能环境	628,555.00	4.17
82	688123	聚辰股份	626,723.16	4.16
83	000032	深桑达 A	626,175.00	4.16
84	000723	美锦能源	626,014.00	4.15
85	002396	星网锐捷	622,762.00	4.13
86	688686	奥普特	621,703.00	4.13
87	600345	长江通信	617,654.00	4.10
88	600398	海澜之家	616,321.00	4.09
89	688300	联瑞新材	608,923.42	4.04
90	600546	山煤国际	606,873.00	4.03
91	601918	新集能源	606,470.00	4.02
92	001283	豪鹏科技	606,050.00	4.02
93	002491	通鼎互联	604,307.00	4.01
94	688012	中微公司	597,889.66	3.97
95	688099	晶晨股份	596,814.92	3.96
96	002444	巨星科技	596,532.00	3.96
97	002475	立讯精密	593,546.00	3.94
98	000100	TCL 科技	592,257.00	3.93
99	688205	德科立	588,014.57	3.90
100	688525	佰维存储	585,241.00	3.88
101	300972	万辰集团	584,624.00	3.88
102	300672	国科微	584,405.00	3.88
103	300223	北京君正	584,272.00	3.88
104	002378	章源钨业	580,364.50	3.85
105	300435	中泰股份	577,653.00	3.83

106	301345	涛涛车业	576,150.00	3.82
107	300183	东软载波	572,832.00	3.80
108	301095	广立微	571,730.00	3.79
109	301191	菲菱科思	568,426.00	3.77
110	688183	生益电子	566,102.26	3.76
111	300661	圣邦股份	564,659.00	3.75
112	600887	伊利股份	563,146.00	3.74
113	600028	中国石化	560,675.00	3.72
114	688153	唯捷创芯	558,071.42	3.70
115	601012	隆基绿能	550,094.00	3.65
116	600030	中信证券	549,199.00	3.64
117	300629	新劲刚	546,817.00	3.63
118	600177	雅戈尔	546,660.00	3.63
119	002085	万丰奥威	544,373.00	3.61
120	601607	上海医药	543,676.00	3.61
121	601717	中创智领	542,612.00	3.60
122	600295	鄂尔多斯	542,262.00	3.60
123	600000	浦发银行	538,751.00	3.57
124	301029	怡合达	537,863.00	3.57
125	300953	震裕科技	537,746.00	3.57
126	600066	宇通客车	535,907.00	3.56
127	002534	西子洁能	533,980.00	3.54
128	002518	科士达	532,710.00	3.53
129	688378	奥来德	531,815.73	3.53
130	688439	振华风光	530,234.65	3.52
131	301606	绿联科技	524,691.00	3.48
132	002028	思源电气	521,332.00	3.46
133	603993	洛阳钼业	520,631.00	3.45
134	601997	贵阳银行	518,083.00	3.44
135	002371	北方华创	517,905.00	3.44
136	600057	厦门象屿	513,538.00	3.41
137	600750	华润江中	509,926.00	3.38
138	600153	建发股份	509,465.00	3.38
139	002019	亿帆医药	505,344.00	3.35
140	601919	中远海控	504,991.00	3.35
141	601857	中国石油	494,205.00	3.28
142	601211	国泰海通	492,738.00	3.27
143	688295	中复神鹰	490,465.00	3.25
144	600938	中国海油	489,070.00	3.25
145	002415	海康威视	488,152.00	3.24
146	600380	健康元	487,990.00	3.24
147	688019	安集科技	475,376.00	3.15
148	002867	周大生	471,573.00	3.13

149	600681	百川能源	469,452.00	3.12
150	601899	紫金矿业	466,951.00	3.10
151	000983	山西焦煤	465,425.00	3.09
152	000792	盐湖股份	464,840.00	3.08
153	688726	拉普拉斯	459,595.66	3.05
154	688213	思特威	455,906.30	3.03
155	002372	伟星新材	454,606.00	3.02
156	002236	大华股份	453,891.00	3.01
157	688535	华海诚科	453,183.53	3.01
158	002179	中航光电	451,527.00	3.00
159	688531	日联科技	447,744.00	2.97
160	000895	双汇发展	442,528.00	2.94
161	002001	新和成	433,331.00	2.88
162	002406	远东传动	432,454.00	2.87
163	688486	龙迅股份	426,717.90	2.83
164	688556	高测股份	426,328.00	2.83
165	688777	中控技术	422,600.50	2.80
166	600039	四川路桥	418,255.00	2.78
167	600877	电科芯片	417,933.00	2.77
168	688408	中信博	416,266.22	2.76
169	600549	厦门钨业	412,488.00	2.74
170	000166	申万宏源	412,426.00	2.74
171	688090	瑞松科技	407,286.00	2.70
172	688017	绿的谐波	407,076.82	2.70
173	300353	东土科技	406,496.00	2.70
174	002527	新时达	406,290.00	2.70
175	600776	东方通信	406,268.00	2.70
176	002104	恒宝股份	406,040.00	2.69
177	601939	建设银行	404,646.00	2.69
178	300627	华测导航	404,607.00	2.68
179	601100	恒立液压	403,739.00	2.68
180	601598	中国外运	398,658.00	2.65
181	002032	苏泊尔	397,731.00	2.64
182	002821	凯莱英	397,310.00	2.64
183	002540	亚太科技	396,959.00	2.63
184	603915	国茂股份	394,634.00	2.62
185	601965	中国汽研	393,147.00	2.61
186	600196	复星医药	392,899.00	2.61
187	000513	丽珠集团	392,730.00	2.61
188	603658	安图生物	390,000.00	2.59
189	600216	浙江医药	389,192.00	2.58
190	300724	捷佳伟创	388,823.00	2.58
191	688082	盛美上海	386,833.44	2.57

192	002303	美盈森	386,582.00	2.57
193	000657	中钨高新	386,072.00	2.56
194	601019	山东出版	385,490.00	2.56
195	002563	森马服饰	382,912.00	2.54
196	605305	中际联合	380,855.00	2.53
197	600026	中远海能	380,169.00	2.52
198	688584	上海合晶	380,108.87	2.52
199	688478	晶升股份	380,064.08	2.52
200	603690	至纯科技	378,103.00	2.51
201	601677	明泰铝业	376,077.00	2.50
202	002051	中工国际	375,098.00	2.49
203	300058	蓝色光标	374,348.00	2.48
204	300316	晶盛机电	373,382.00	2.48
205	603156	养元饮品	372,859.00	2.47
206	300757	罗博特科	371,530.00	2.47
207	002270	华明装备	370,162.00	2.46
208	601567	三星电气	367,238.00	2.44
209	600999	招商证券	364,686.00	2.42
210	600269	赣粤高速	363,325.00	2.41
211	603871	嘉友国际	362,525.00	2.41
212	000915	华特达因	361,502.00	2.40
213	002062	宏润建设	360,282.00	2.39
214	301629	矽电股份	358,200.00	2.38
215	600764	中国海防	358,132.00	2.38
216	600717	天津港	357,798.00	2.37
217	000852	石化机械	357,763.00	2.37
218	000885	城发环境	357,455.00	2.37
219	600020	中原高速	357,422.00	2.37
220	000828	东莞控股	357,365.00	2.37
221	000425	徐工机械	357,000.00	2.37
222	002448	中原内配	356,606.00	2.37
223	601158	重庆水务	356,210.00	2.36
224	603197	保隆科技	356,121.00	2.36
225	600008	首创环保	355,916.00	2.36
226	601156	东航物流	355,823.00	2.36
227	000089	深圳机场	355,495.00	2.36
228	600428	中远海特	355,290.00	2.36
229	002154	报喜鸟	355,168.00	2.36
230	000690	宝新能源	354,998.00	2.36
231	603128	华贸物流	354,912.00	2.36
232	600650	锦江在线	354,588.00	2.35
233	600064	南京高科	354,416.00	2.35
234	300763	锦浪科技	354,122.00	2.35

235	000157	中联重科	353,691.00	2.35
236	002516	旷达科技	353,662.00	2.35
237	600873	梅花生物	352,369.00	2.34
238	300018	中元股份	352,347.00	2.34
239	002121	科陆电子	351,730.00	2.33
240	002400	省广集团	350,582.00	2.33
241	000581	威孚高科	350,508.00	2.33
242	600326	西藏天路	349,130.00	2.32
243	601963	重庆银行	349,060.00	2.32
244	600006	东风股份	348,476.00	2.31
245	002645	华宏科技	347,493.00	2.31
246	002488	金固股份	344,597.00	2.29
247	601318	中国平安	343,846.00	2.28
248	301327	华宝新能	343,138.00	2.28
249	000155	川能动力	342,550.00	2.27
250	600118	中国卫星	339,341.00	2.25
251	300888	稳健医疗	338,651.00	2.25
252	688789	宏华数科	335,666.56	2.23
253	688112	鼎阳科技	334,119.82	2.22
254	000672	上峰材料	333,565.00	2.21
255	688303	大全能源	327,824.16	2.18
256	002832	比音勒芬	327,237.00	2.17
257	301031	中熔电气	324,917.00	2.16
258	603348	文灿股份	323,215.00	2.14
259	600478	科力远	323,084.00	2.14
260	688668	鼎通科技	321,982.32	2.14
261	002668	TCL 智家	321,980.00	2.14
262	000823	超声电子	321,445.00	2.13
263	600985	淮北矿业	320,861.00	2.13
264	600879	航天电子	320,018.00	2.12
265	601577	长沙银行	319,800.00	2.12
266	002966	苏州银行	319,752.00	2.12
267	000062	深圳华强	319,482.00	2.12
268	002779	中坚科技	319,327.00	2.12
269	601225	陕西煤业	319,169.00	2.12
270	002839	张家港行	318,459.00	2.11
271	002807	江阴银行	316,052.00	2.10
272	600710	苏美达	314,219.00	2.09
273	688578	艾力斯	312,117.34	2.07
274	000957	中通客车	311,258.00	2.07
275	600282	南钢股份	311,145.00	2.06
276	600479	千金药业	310,853.00	2.06
277	301339	通行宝	309,817.00	2.06

278	300562	乐心医疗	308,706.00	2.05
279	300566	激智科技	304,533.00	2.02
280	605016	百龙创园	303,856.00	2.02
281	301205	联特科技	302,418.00	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	301369	联动科技	2,241,335.10	14.87
2	002119	康强电子	2,117,238.00	14.05
3	300308	中际旭创	2,061,344.00	13.68
4	688313	仕佳光子	1,799,728.46	11.94
5	300408	三环集团	1,781,124.14	11.82
6	688072	拓荆科技	1,440,230.15	9.56
7	300502	新易盛	1,395,764.00	9.26
8	688720	艾森股份	1,375,239.59	9.13
9	300628	亿联网络	1,300,128.00	8.63
10	000988	华工科技	1,270,361.00	8.43
11	603160	汇顶科技	1,239,605.00	8.23
12	600900	长江电力	1,238,075.00	8.22
13	600522	中天科技	1,235,120.00	8.20
14	603005	晶方科技	1,223,831.00	8.12
15	688256	寒武纪	1,220,828.53	8.10
16	688508	芯朋微	1,201,347.56	7.97
17	603061	金海通	1,183,193.15	7.85
18	688498	源杰科技	1,168,451.96	7.75
19	002583	海能达	1,100,191.00	7.30
20	600183	生益科技	1,081,125.00	7.17
21	688146	中船特气	1,074,958.40	7.13
22	688372	伟测科技	1,059,660.41	7.03
23	000810	创维数字	1,015,936.00	6.74
24	601872	招商轮船	1,001,776.00	6.65
25	600909	华安证券	980,998.47	6.51
26	688361	中科飞测	966,065.98	6.41
27	300666	江丰电子	951,989.00	6.32
28	300476	胜宏科技	951,721.00	6.32
29	601001	晋控煤业	951,485.00	6.31
30	601699	潞安环能	946,489.00	6.28
31	601101	昊华能源	930,476.00	6.17
32	600765	中航重机	906,720.00	6.02
33	688120	华海清科	839,874.00	5.57
34	300474	景嘉微	819,745.00	5.44
35	688347	华虹宏力	816,977.48	5.42

36	600582	天地科技	816,739.00	5.42
37	600460	士兰微	814,626.00	5.41
38	688027	国盾量子	796,872.64	5.29
39	300620	光库科技	795,440.00	5.28
40	301308	江波龙	792,038.00	5.26
41	002709	天赐材料	789,332.00	5.24
42	688519	南亚新材	786,765.79	5.22
43	688052	纳芯微	780,465.00	5.18
44	688702	盛科通信	780,239.97	5.18
45	000408	藏格矿业	778,759.00	5.17
46	300373	扬杰科技	772,805.00	5.13
47	300629	新劲刚	758,687.00	5.03
48	600198	大唐电信	745,507.00	4.95
49	603565	中谷物流	736,946.00	4.89
50	300782	卓胜微	731,355.00	4.85
51	688018	乐鑫科技	728,582.14	4.83
52	603259	药明康德	721,654.00	4.79
53	688593	新相微	719,233.30	4.77
54	600105	永鼎股份	715,223.00	4.75
55	688591	泰凌微	709,249.25	4.71
56	688380	中微半导	708,981.09	4.70
57	000027	深圳能源	708,957.29	4.70
58	688099	晶晨股份	707,581.45	4.70
59	688525	佰维存储	706,707.68	4.69
60	300672	国科微	704,194.00	4.67
61	688206	概伦电子	701,121.94	4.65
62	688362	甬矽电子	692,067.14	4.59
63	603799	华友钴业	687,850.00	4.56
64	688318	财富趋势	686,746.44	4.56
65	688582	芯动联科	686,581.72	4.56
66	688686	奥普特	680,407.00	4.51
67	002050	三花智控	676,155.00	4.49
68	002409	雅克科技	672,740.00	4.46
69	002378	章源钨业	666,972.00	4.43
70	688469	芯联集成	666,283.09	4.42
71	002475	立讯精密	665,462.00	4.42
72	600171	上海贝岭	658,348.00	4.37
73	688692	达梦数据	657,076.44	4.36
74	603588	高能环境	652,645.00	4.33
75	300604	长川科技	648,767.00	4.31
76	688536	思瑞浦	646,270.67	4.29
77	600875	东方电气	645,975.00	4.29
78	688691	灿芯股份	638,600.00	4.24

79	688059	华锐精密	638,189.82	4.23
80	600345	长江通信	636,258.00	4.22
81	603078	江化微	635,721.00	4.22
82	300623	捷捷微电	634,944.00	4.21
83	600487	亨通光电	631,331.00	4.19
84	688515	裕太微	626,681.58	4.16
85	301095	广立微	626,357.00	4.16
86	688205	德科立	625,250.00	4.15
87	002444	巨星科技	617,065.00	4.09
88	600863	华能蒙电	616,602.00	4.09
89	688003	天准科技	615,598.00	4.08
90	600398	海澜之家	614,206.00	4.08
91	000723	美锦能源	613,816.00	4.07
92	002491	通鼎互联	611,413.00	4.06
93	001283	豪鹏科技	610,087.00	4.05
94	002027	分众传媒	609,305.00	4.04
95	300953	震裕科技	608,157.00	4.04
96	000032	深桑达 A	607,209.00	4.03
97	300223	北京君正	604,635.00	4.01
98	301345	涛涛车业	602,013.00	3.99
99	601918	新集能源	593,040.00	3.94
100	688300	联瑞新材	592,547.31	3.93
101	000100	TCL 科技	591,725.00	3.93
102	300661	圣邦股份	589,852.00	3.91
103	600295	鄂尔多斯	587,221.00	3.90
104	002396	星网锐捷	587,019.00	3.90
105	300183	东软载波	582,556.00	3.87
106	600546	山煤国际	579,397.00	3.84
107	688012	中微公司	578,631.90	3.84
108	301606	绿联科技	575,452.00	3.82
109	688183	生益电子	572,701.00	3.80
110	688378	奥来德	568,533.94	3.77
111	688153	唯捷创芯	568,508.32	3.77
112	301191	菲菱科思	565,064.00	3.75
113	600887	伊利股份	560,320.00	3.72
114	601997	贵阳银行	555,748.00	3.69
115	600028	中国石化	554,910.00	3.68
116	688123	聚辰股份	554,238.00	3.68
117	688583	思看科技	553,257.48	3.67
118	600030	中信证券	552,382.00	3.67
119	002534	西子洁能	552,240.00	3.66
120	688531	日联科技	548,768.00	3.64
121	601717	中创智领	548,663.00	3.64

122	002028	思源电气	548,514.00	3.64
123	002518	科士达	545,357.00	3.62
124	601607	上海医药	545,123.00	3.62
125	301029	怡合达	542,566.00	3.60
126	600177	雅戈尔	541,029.00	3.59
127	002085	万丰奥威	538,295.00	3.57
128	601012	隆基绿能	537,428.00	3.57
129	300435	中泰股份	532,838.00	3.54
130	600066	宇通客车	532,480.00	3.53
131	600750	华润江中	520,707.00	3.46
132	688439	振华风光	516,993.15	3.43
133	600057	厦门象屿	516,567.00	3.43
134	688295	中复神鹰	516,077.33	3.42
135	002371	北方华创	512,343.00	3.40
136	600000	浦发银行	511,345.00	3.39
137	603993	洛阳钼业	509,507.00	3.38
138	002867	周大生	503,856.00	3.34
139	002019	亿帆医药	500,040.00	3.32
140	601919	中远海控	498,101.00	3.31
141	000792	盐湖股份	493,952.00	3.28
142	600153	建发股份	492,761.00	3.27
143	601857	中国石油	489,791.00	3.25
144	002415	海康威视	488,776.00	3.24
145	688019	安集科技	486,392.93	3.23
146	601211	国泰海通	483,927.00	3.21
147	600938	中国海油	482,398.00	3.20
148	000895	双汇发展	481,437.00	3.19
149	600380	健康元	479,841.00	3.18
150	002372	伟星新材	473,771.00	3.14
151	300342	天银机电	473,422.00	3.14
152	600549	厦门钨业	464,481.00	3.08
153	601899	紫金矿业	463,846.00	3.08
154	002345	潮宏基	462,058.00	3.07
155	600681	百川能源	461,223.00	3.06
156	000983	山西焦煤	456,895.00	3.03
157	002236	大华股份	455,402.00	3.02
158	688213	思特威	453,009.00	3.01
159	002179	中航光电	446,158.00	2.96
160	300102	乾照光电	442,064.00	2.93
161	688556	高测股份	439,181.80	2.91
162	002001	新和成	431,938.00	2.87
163	603156	养元饮品	431,033.00	2.86
164	002406	远东传动	429,976.00	2.85

165	002540	亚太科技	422,685.00	2.80
166	688726	拉普拉斯	421,450.45	2.80
167	688486	龙迅股份	419,275.91	2.78
168	000657	中钨高新	417,615.00	2.77
169	600363	联创光电	417,278.00	2.77
170	002563	森马服饰	417,217.00	2.77
171	688082	盛美上海	415,944.00	2.76
172	688535	华海诚科	415,008.00	2.75
173	601019	山东出版	414,118.00	2.75
174	600026	中远海能	409,868.00	2.72
175	601939	建设银行	409,266.00	2.72
176	601100	恒立液压	409,027.00	2.71
177	000166	申万宏源	408,335.00	2.71
178	601598	中国外运	407,888.00	2.71
179	688408	中信博	407,853.42	2.71
180	600039	四川路桥	405,487.00	2.69
181	002303	美盈森	405,187.00	2.69
182	603915	国茂股份	403,847.00	2.68
183	688090	瑞松科技	402,481.53	2.67
184	002104	恒宝股份	397,778.00	2.64
185	002821	凯莱英	397,615.00	2.64
186	688777	中控技术	396,525.00	2.63
187	600877	电科芯片	396,162.00	2.63
188	002051	中工国际	393,772.00	2.61
189	600873	梅花生物	392,802.00	2.61
190	300353	东土科技	392,669.00	2.61
191	000915	华特达因	392,447.00	2.60
192	000513	丽珠集团	392,407.00	2.60
193	300627	华测导航	390,806.00	2.59
194	002032	苏泊尔	390,374.00	2.59
195	601965	中国汽研	389,889.00	2.59
196	605305	中际联合	389,551.00	2.58
197	600196	复星医药	386,754.00	2.57
198	603658	安图生物	386,644.00	2.57
199	601677	明泰铝业	385,476.00	2.56
200	600216	浙江医药	384,395.00	2.55
201	600999	招商证券	383,579.00	2.55
202	600776	东方通信	382,727.00	2.54
203	002527	新时达	382,212.00	2.54
204	300316	晶盛机电	372,348.00	2.47
205	603690	至纯科技	368,408.00	2.44
206	600269	赣粤高速	368,400.00	2.44
207	300724	捷佳伟创	367,462.00	2.44

208	300757	罗博特科	366,893.00	2.43
209	600428	中远海特	366,600.00	2.43
210	688017	绿的谐波	366,365.23	2.43
211	688584	上海合晶	362,779.87	2.41
212	688478	晶升股份	361,520.71	2.40
213	002270	华明装备	359,717.00	2.39
214	000155	川能动力	353,818.00	2.35
215	600282	南钢股份	352,782.00	2.34
216	000828	东莞控股	352,597.00	2.34
217	000425	徐工机械	351,827.00	2.33
218	601158	重庆水务	351,441.00	2.33
219	000157	中联重科	351,371.00	2.33
220	601963	重庆银行	350,972.00	2.33
221	600008	首创环保	350,339.00	2.32
222	000089	深圳机场	349,502.00	2.32
223	600020	中原高速	348,756.00	2.31
224	002516	旷达科技	347,502.00	2.31
225	600717	天津港	346,805.00	2.30
226	603128	华贸物流	346,459.00	2.30
227	000885	城发环境	345,725.00	2.29
228	000690	宝新能源	345,066.00	2.29
229	300058	蓝色光标	344,667.00	2.29
230	000852	石化机械	344,560.00	2.29
231	600064	南京高科	344,143.00	2.28
232	603871	嘉友国际	342,441.00	2.27
233	600764	中国海防	341,860.00	2.27
234	301629	矽电股份	341,100.00	2.26
235	002448	中原内配	341,036.00	2.26
236	600650	锦江在线	340,438.00	2.26
237	000581	威孚高科	339,957.00	2.26
238	601318	中国平安	339,117.00	2.25
239	601156	东航物流	339,116.00	2.25
240	601567	三星电气	338,200.00	2.24
241	002062	宏润建设	337,637.00	2.24
242	600118	中国卫星	336,583.00	2.23
243	002488	金固股份	335,108.00	2.22
244	603197	保隆科技	335,076.00	2.22
245	600006	东风股份	334,298.00	2.22
246	300972	万辰集团	333,663.00	2.21
247	300018	中元股份	332,103.00	2.20
248	600879	航天电子	330,252.00	2.19
249	688112	鼎阳科技	328,787.00	2.18
250	688303	大全能源	325,925.79	2.16

251	301377	鼎泰高科	323,269.00	2.15
252	600710	苏美达	322,930.00	2.14
253	002645	华宏科技	322,286.60	2.14
254	688668	鼎通科技	322,048.33	2.14
255	600326	西藏天路	320,318.00	2.13
256	002400	省广集团	320,058.00	2.12
257	301327	华宝新能	319,676.00	2.12
258	002807	江阴银行	318,178.00	2.11
259	002839	张家港行	318,028.00	2.11
260	600478	科力远	317,727.00	2.11
261	603348	文灿股份	317,181.00	2.10
262	600985	淮北矿业	316,041.00	2.10
263	300763	锦浪科技	315,727.00	2.10
264	601577	长沙银行	314,871.00	2.09
265	601225	陕西煤业	314,517.00	2.09
266	688578	艾力斯	314,225.00	2.09
267	002121	科陆电子	311,756.00	2.07
268	002966	苏州银行	311,157.00	2.06
269	688789	宏华数科	310,006.00	2.06
270	000823	超声电子	308,639.00	2.05
271	600479	千金药业	308,555.00	2.05
272	000957	中通客车	304,531.00	2.02
273	002779	中坚科技	304,276.00	2.02

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	224,680,809.31
卖出股票收入（成交）总额	223,266,030.29

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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	47,002,422.85	85.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	-	-

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,002,422.85	85.22

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	019792	25 国债 19	291,000	29,405,326.77	53.32
2	019785	25 国债 13	151,000	15,290,644.74	27.72
3	019782	25 国债 12	23,000	2,306,451.34	4.18

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同约定备选股票库的情形。

7.11.3 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	44,211.20
2	应收清算款	3,243,157.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	3,238.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,290,607.87

7.11.4 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。

7.11.5 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。

7.11.6 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 (%)
长信利富 债券 A	1,434	26,488.44	31,146,400.15	82.00	6,838,017.12	18.00
长信利富 债券 C	824	4,889.65	2,000,000.00	49.64	2,029,073.98	50.36
合计	2,258	18,606.51	33,146,400.15	78.89	8,867,091.10	21.11

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	长信利富债券 A	155.55	0.00
	长信利富债券 C	0.00	0.00
	合计	155.55	0.00

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信利富债券 A	0
	长信利富债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利富债券 A	0
	长信利富债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利富债券 A	长信利富债券 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 6 日）基金份额总额	568,039,225.55	—
本报告期期初基金份额总额	11,603,928.07	142,102.44
本报告期基金总申购份额	31,559,995.87	38,696,409.18
减：本报告期基金总赎回份额	5,179,506.67	34,809,437.64
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	37,984,417.27	4,029,073.98

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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 基金管理人的重大人事变动

自 2026 年 3 月 19 日起，刘元瑞先生不再担任公司董事长，由肖剑先生担任公司董事长。

自 2026 年 4 月 3 日起，经工商行政管理部门核准，公司法定代表人变更为肖剑先生。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	长信基金管理有限责任公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 4 月 30 日
采取调查或处罚等措施的机构	上海证券交易所
受到调查或处罚等措施类型	其他（自律监管措施）
受到的具体措施类型	警示
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（新股网下询价）
受到处罚的依据	《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则（2025 年修订）》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已落实优化模型、完善机制等整改措施，完成整改工作。
其他	无

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，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

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 (%)	
西南证券	1	164,980,677.48	36.89	75,214.88	36.89	—
华源证券	1	139,745,826.65	31.25	63,710.01	31.25	—
天风证券	1	100,385,356.48	22.45	45,766.36	22.45	—
国信证券	2	42,114,347.73	9.42	19,199.93	9.42	—

东吴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
国联民生 证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

 本报告期内本基金退租长江证券交易单元 1 个。

2、专用交易单元的选择标准和程序

 根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

 （1）选择标准：

- 1) 财务状况良好；
- 2) 经营行为规范；
- 3) 合规风控能力较强；
- 4) 交易能力较强；
- 5) 研究能力较强。

 （2）选择程序：

 依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

 3、《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 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

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 (%)
西南证券	62,168,175.73	12.46	-	-	-	-

华源证券	94,746,394.09	18.99	378,741,000.00	45.60	-	-
天风证券	215,029,318.54	43.10	396,851,000.00	47.78	-	-
国信证券	126,996,315.27	25.45	55,007,000.00	6.62	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-13
2	长信利富债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
5	长信基金管理有限责任公司关于董事变更情况的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
6	长信利富债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
8	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-31
9	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-3
10	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利富债券型证券投资基金基金经理的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-10
11	长信利富债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-14
12	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利富债券型证券投资基金基金经理的	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-18

	公告		
13	长信利富债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2026 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
15	长信利富债券型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
16	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026-4-30
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27
18	长信利富债券型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金的基金合同提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27
20	长信利富债券型证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-30

§ 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	2026 年 2 月 2 日至 2026 年 2 月 2 日	0.00	7,580,926.39	7,580,926.39	0.00	0.00
	2	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 18 日	3,095,858.37	0.00	2,800,000.00	295,858.37	0.70
	3	2026 年 2 月 3 日至 2026 年 6 月 30 日	0.00	30,850,541.78	0.00	30,850,541.78	73.43
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。							

2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生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、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利富债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利富债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利富债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2026 年 8 月 31 日