

长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：财通证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	54

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长盛中证 A500 指数增强	
基金主代码	024075	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 11 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	财通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,526,948.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛中证 A500 指数增强 A	长盛中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	024075	024076
报告期末下属分级基金的 份额总额	13,156,671.18 份	35,370,276.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，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 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。 1、股票投资策略 本基金以中证 A500 指数为标的指数，除跟踪标的指数外，亦可通过成份股权重优化增强和非成份股优选等增强策略对投资组合进行优化，利用公司自主研发的量化多因子选股模型进行股票投资价值定量分析，并在此基础上构建股票投资组合。在力求有效跟踪标的指数基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。主要的股票投资策略包含（1）指数化被动投资策略（2）量化增强策略（3）存托凭证投资策略（4）本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下 A 股市场和港股市场的投资机会。 2、债券投资策略：本基金采用的债券主要投资策略包括：久期策略、期限结构策略、个券选择策略、可转换债券投资策略等。 3、其他投资策略包含：（1）同业存单投资策略（2）股指期货投资策略（3）国债期货投资策略（4）资产支持证券投资策略（5）股票期权投资策略（6）融资及转融通证券出借业务投资策略（7）现金管理策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票指数增强型基金，预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份

	股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股票。本基金若投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	财通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	马坚岗
	联系电话	010-86497608	0571-85080360
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	cttg@ctsec.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95336
传真		010-86497999	0571-87830199
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	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
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	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼
邮政编码		100029	310007
法定代表人		胡甲	章启诚

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长盛中证 A500 指数增强 A	长盛中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	633,459.09	1,511,024.95
本期利润	2,190,662.76	4,962,471.27
加权平均基金份额本期利润	0.0763	0.0776
本期加权平均净值利润率	7.47%	7.58%
本期基金份额净值增长率	9.20%	8.99%

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	523,987.78	1,311,789.84
期末可供分配基金份额利润	0.0398	0.0371
期末基金资产净值	14,471,417.93	38,804,120.74
期末基金份额净值	1.0999	1.0971
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	9.99%	9.71%

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、本基金基金合同生效日为 2025 年 11 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛中证 A500 指数增强 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	12.95%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.59%	-0.03%
过去六个月	9.20%	1.07%	11.34%	1.22%	-2.14%	-0.15%
自基金合同生效起至今	9.99%	0.94%	11.49%	1.15%	-1.50%	-0.21%

长盛中证 A500 指数增强 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	12.85%	1.31%	13.54%	1.34%	-0.69%	-0.03%
过去六个月	8.99%	1.08%	11.34%	1.22%	-2.35%	-0.14%
自基金合同生效起	9.71%	0.94%	11.49%	1.15%	-1.78%	-0.21%

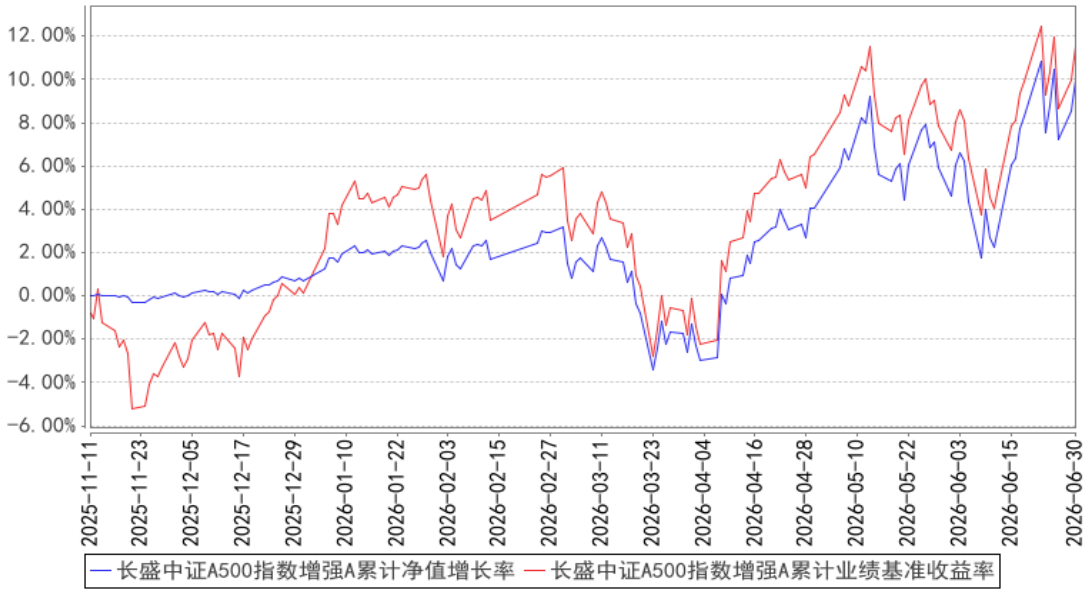
至今						
----	--	--	--	--	--	--

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

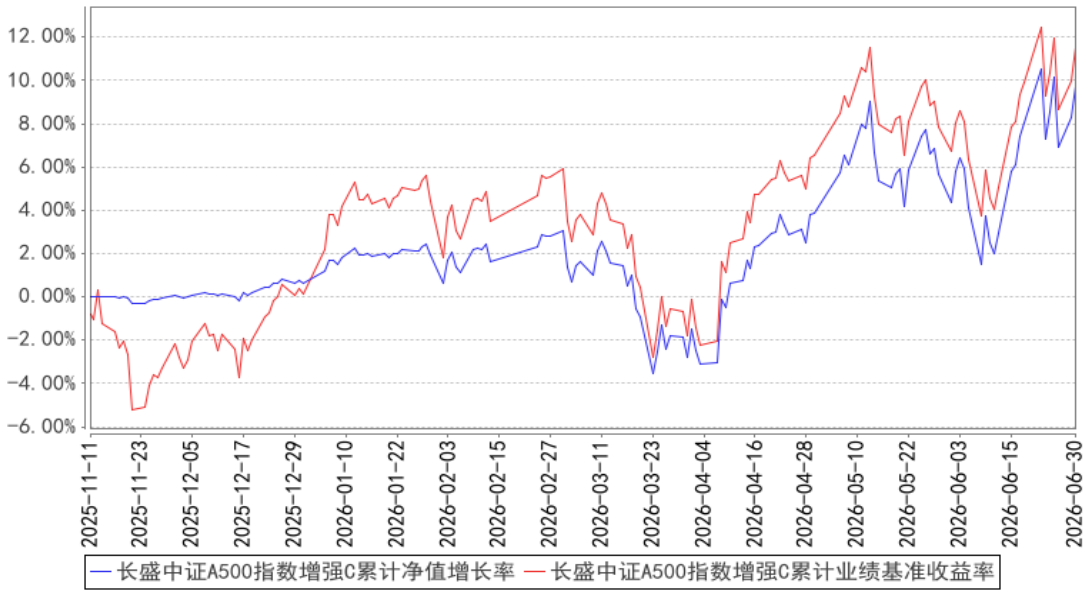
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中证 A500 指数、同期银行活期存款利率（税后）每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛中证A500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛中证A500指数增强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、本基金基金合同生效日为 2025 年 11 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。
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

投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本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	2025 年 11 月 11 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，曾任基金经理助理。

	理，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，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。				
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，长盛中证申 万一带一路主题 指数证券投资基 金（LOF）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。

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

截至本报告期末长盛中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0999 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.20%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%；截至本报告期末长盛中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0971 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.99%，同期业绩比较基准收益率为 11.34%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1903%，年度化跟踪误差为 4.9147%。

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，财通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）严格遵守法律法规、基金合同，认真履行了应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人严格遵守相关法律法规和基金合同的规定对基金管理人的投资运作进行监督。在基金资产净值的计算、利润分配等方面，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本托管人对本报告中的财务数据均核对无误。

§ 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 A500 指数增强型证券投资基金

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	2,977,766.34	156,891,545.65
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,833,142.65	51,767,094.71

其中：股票投资		50,833,142.65	51,767,094.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		65,401.60	129,242.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,876,310.59	208,787,882.51
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		460,875.87	10,542,959.94
应付管理人报酬		37,773.06	197,936.86
应付托管费		4,721.63	24,742.08
应付销售服务费		13,942.20	68,126.42
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	83,459.16	240.00
负债合计		600,771.92	10,834,005.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	48,526,948.02	196,617,289.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,748,590.65	1,336,587.78
净资产合计		53,275,538.67	197,953,877.21
负债和净资产总计		53,876,310.59	208,787,882.51

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0999 元，份额总额为 13,156,671.18 份；长盛中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0971 元，份额总额为 35,370,276.84 份。基金份额总额 48,526,948.02 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		7,798,219.28
1. 利息收入		24,800.32
其中：存款利息收入	6.4.7.13	24,800.32
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）		2,764,170.89
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,265,947.38
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	498,223.51
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	5,008,649.99
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	598.08
减：二、营业总支出		645,085.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	382,808.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,851.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	132,012.15
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	82,413.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,153,134.03

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,153,134.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		7,153,134.03

注：本基金合同于 2025 年 11 月 11 日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	196,617,289.43	1,336,587.78	197,953,877.21
二、本期期初净资产	196,617,289.43	1,336,587.78	197,953,877.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-148,090,341.41	3,412,002.87	-144,678,338.54
（一）、综合收益总额	-	7,153,134.03	7,153,134.03
（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）	-148,090,341.41	-3,741,131.16	-151,831,472.57
其中：1. 基金申购款	22,005,300.90	566,050.41	22,571,351.31
2. 基金赎回款	-170,095,642.31	-4,307,181.57	-174,402,823.88
（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	48,526,948.02	4,748,590.65	53,275,538.67

注：本基金合同于 2025 年 11 月 11 日生效，无上年度可比期间。

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：

<u>胡甲</u>	<u>张壬午</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]712 号《关于准予长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 351,890,989.88 元,业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2025]100Z0095 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 11 月 11 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 351,933,856.57 份基金份额,其中认购资金利息折合 42,866.69 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为财通证券股份有限公司。

根据《长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括中证 A500 指数的成份股及其备选成份股(均含存托凭证,下同),其他非标的指数成份股(包含主板、创业板及其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分)、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具(包括股指期货、国债期货、股票期权)、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)。基金的投资组合比例为:本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;其中,投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货

合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准：中证 A500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》《证券投资基金会计核算业务指引》《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本 and 努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制

等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融

资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通

受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。2027

年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	389,096.80
等于：本金	388,794.69
加：应计利息	302.11
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	2,588,669.54
等于：本金	2,588,619.37
加：应计利息	50.17
减：坏账准备	-
合计	2,977,766.34

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	44,046,346.99	-	50,833,142.65	6,786,795.66
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	44,046,346.99	-	50,833,142.65	6,786,795.66

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,343.16
其他	1,116.00
合计	83,459.16

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛中证 A500 指数增强 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	64,120,482.18	64,120,482.18
本期申购	8,055,514.21	8,055,514.21
本期赎回（以“-”号填列）	-59,019,325.21	-59,019,325.21
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	13,156,671.18	13,156,671.18

长盛中证 A500 指数增强 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	132,496,807.25	132,496,807.25
本期申购	13,949,786.69	13,949,786.69

本期赎回（以“-”号填列）	-111,076,317.10	-111,076,317.10
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	35,370,276.84	35,370,276.84

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,239.35	458,174.27	461,413.62
本期期初	3,239.35	458,174.27	461,413.62
本期利润	633,459.09	1,557,203.67	2,190,662.76
本期基金份额交易产生的变动数	-112,710.66	-1,224,618.97	-1,337,329.63
其中：基金申购款	3,854.59	189,835.25	193,689.84
基金赎回款	-116,565.25	-1,414,454.22	-1,531,019.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	523,987.78	790,758.97	1,314,746.75

长盛中证 A500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-71,138.88	946,313.04	875,174.16
本期期初	-71,138.88	946,313.04	875,174.16
本期利润	1,511,024.95	3,451,446.32	4,962,471.27
本期基金份额交易产生的变动数	-128,096.23	-2,275,705.30	-2,403,801.53
其中：基金申购款	30,504.63	341,855.94	372,360.57
基金赎回款	-158,600.86	-2,617,561.24	-2,776,162.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,311,789.84	2,122,054.06	3,433,843.90

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	12,272.34
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,527.09
结算备付金利息收入	-

其他	0.89
合计	24,800.32

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	2,265,947.38
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	2,265,947.38

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	61,589,312.57
减：卖出股票成本总额	59,262,977.81
减：交易费用	60,387.38
买卖股票差价收入	2,265,947.38

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	498,223.51
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	498,223.51

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	5,008,649.99
股票投资	5,008,649.99
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	5,008,649.99

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	598.08
合计	598.08

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	70.00
账户维护费	3,000.00
合计	82,413.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
财通证券	62,453,363.89	54.35
国元证券	52,456,324.44	45.65

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（%）
财通证券	11,936.17	53.73	-	-
国元证券	10,277.94	46.27	-	-

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。

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
当期发生的基金应支付的管理费	382,808.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	188,530.70
应支付基金管理人的净管理费	194,278.17

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 0.80%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
当期发生的基金应支付的托管费	47,851.07

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 0.10%的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛中证 A500 指数增强 A	长盛中证 A500 指数增强 C	合计

财通证券	-	78,387.05	78,387.05
国元证券	-	46,968.88	46,968.88
合计	-	125,355.93	125,355.93

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.40%。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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	
	期末余额	当期利息收入
财通证券	1,356,435.34	20,398.76
国元证券	1,621,331.00	4,400.67
合计	2,977,766.34	24,799.43

注：本基金的银行存款由基金托管人财通证券和证券经纪商国元证券、财通证券保管，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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	200	62,996.00	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核

部与风险管理部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,977,414.06	-	-	352.28	2,977,766.34
交易性金融资产	-	-	-	50,833,142.65	50,833,142.65
应收申购款	-	-	-	65,401.60	65,401.60
资产总计	2,977,414.06	-	-	50,898,896.53	53,876,310.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	460,875.87	460,875.87
应付管理人报酬	-	-	-	37,773.06	37,773.06
应付托管费	-	-	-	4,721.63	4,721.63
应付销售服务费	-	-	-	13,942.20	13,942.20
其他负债	-	-	-	83,459.16	83,459.16
负债总计	-	-	-	600,771.92	600,771.92
利率敏感度缺口	2,977,414.06	-	-	50,298,124.61	53,275,538.67
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	156,884,214.90	-	-	7,330.75	156,891,545.65
交易性金融资产	-	-	-	51,767,094.71	51,767,094.71
应收申购款	-	-	-	129,242.15	129,242.15
资产总计	156,884,214.90	-	-	51,903,667.61	208,787,882.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,542,959.94	10,542,959.94
应付管理人报酬	-	-	-	197,936.86	197,936.86
应付托管费	-	-	-	24,742.08	24,742.08
应付销售服务费	-	-	-	68,126.42	68,126.42
其他负债	-	-	-	240.00	240.00
负债总计	-	-	-	10,834,005.30	10,834,005.30
利率敏感度缺口	156,884,214.90	-	-	41,069,662.31	197,953,877.21

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外

汇头寸进行监控。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	50,833,142.65	95.42	51,767,094.71	26.15
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	50,833,142.65	95.42	51,767,094.71	26.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末成立均未满一年，尚无充足的经验数据。

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	50,666,742.65	51,421,920.91
第二层次	166,400.00	345,173.80
第三层次	-	-
合计	50,833,142.65	51,767,094.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的证券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。
--

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	50,833,142.65	94.35
	其中：股票	50,833,142.65	94.35
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	2,977,766.34	5.53
8	其他各项资产	65,401.60	0.12
9	合计	53,876,310.59	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	4,253.00	0.01
B	采矿业	1,339,291.00	2.51
C	制造业	37,606,355.43	70.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,528,322.00	2.87
E	建筑业	547,566.00	1.03
F	批发和零售业	710,493.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,055,622.00	1.98
H	住宿和餐饮业	267,953.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,696,249.82	3.18
J	金融业	3,202,573.00	6.01
K	房地产业	958,734.00	1.80
L	租赁和商务服务业	595,933.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	872,261.00	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	356,333.40	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,329.00	-
R	文化、体育和娱乐业	86,516.00	0.16
S	综合	3,358.00	0.01
	合计	50,833,142.65	95.42

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300308	中际旭创	1,800	2,286,000.00	4.29
2	300750	宁德时代	3,900	1,532,739.00	2.88
3	300502	新易盛	2,380	1,444,660.00	2.71
4	600519	贵州茅台	800	948,392.00	1.78
5	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	1.53
6	688008	澜起科技	2,450	759,255.00	1.43
7	601318	中国平安	15,700	749,518.00	1.41
8	603259	药明康德	5,100	635,001.00	1.19
9	002384	东山精密	2,300	603,405.00	1.13
10	600030	中信证券	19,900	571,727.00	1.07
11	688981	中芯国际	3,468	550,787.76	1.03
12	002475	立讯精密	7,600	535,040.00	1.00
13	002371	北方华创	600	530,736.00	1.00
14	688041	海光信息	1,426	528,047.80	0.99
15	601899	紫金矿业	20,600	517,884.00	0.97
16	000333	美的集团	6,700	506,051.00	0.95
17	688012	中微公司	1,058	495,673.00	0.93
18	000725	京东方 A	55,300	480,004.00	0.90
19	688256	寒武纪	298	475,473.90	0.89
20	002463	沪电股份	2,900	443,120.00	0.83
21	600900	长江电力	16,000	423,520.00	0.79
22	600487	亨通光电	3,700	404,558.00	0.76
23	300408	三环集团	2,400	400,560.00	0.75
24	600150	中国船舶	11,400	385,206.00	0.72
25	000338	潍柴动力	13,900	378,775.00	0.71
26	600176	中国巨石	5,000	364,400.00	0.68
27	000988	华工科技	1,900	350,759.00	0.66
28	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.65
29	600584	长电科技	3,300	341,715.00	0.64
30	601328	交通银行	50,800	326,644.00	0.61
31	300394	天孚通信	1,040	314,787.20	0.59
32	600183	生益科技	1,800	312,120.00	0.59
33	601166	兴业银行	18,400	304,704.00	0.57
34	300274	阳光电源	1,900	302,138.00	0.57
35	002353	杰瑞股份	1,900	289,750.00	0.54
36	600887	伊利股份	11,500	275,540.00	0.52
37	300604	长川科技	800	273,136.00	0.51
38	300857	协创数据	800	271,920.00	0.51
39	300475	香农芯创	900	270,000.00	0.51
40	002049	紫光国微	3,000	266,250.00	0.50
41	002156	通富微电	3,500	265,545.00	0.50
42	002436	兴森科技	5,200	264,940.00	0.50

43	601985	中国核电	28,800	260,064.00	0.49
44	300661	圣邦股份	1,800	258,264.00	0.48
45	600460	士兰微	4,700	256,902.00	0.48
46	300346	南大光电	2,600	240,890.00	0.45
47	300059	东方财富	11,700	238,446.00	0.45
48	002851	麦格米特	1,400	234,052.00	0.44
49	300054	鼎龙股份	2,200	233,134.00	0.44
50	002916	深南电路	500	228,950.00	0.43
51	000408	藏格矿业	3,300	228,756.00	0.43
52	002185	华天科技	10,100	225,331.00	0.42
53	603019	中科曙光	2,100	225,183.00	0.42
54	002273	水晶光电	6,300	223,524.00	0.42
55	002594	比亚迪	2,800	223,160.00	0.42
56	688002	睿创微纳	1,401	216,720.69	0.41
57	000938	紫光股份	7,500	216,450.00	0.41
58	600482	中国动力	6,500	213,200.00	0.40
59	000807	云铝股份	9,600	212,544.00	0.40
60	301308	江波龙	300	211,140.00	0.40
61	002027	分众传媒	43,600	211,024.00	0.40
62	002179	中航光电	4,500	207,900.00	0.39
63	000651	格力电器	5,500	206,250.00	0.39
64	688396	华润微	2,062	201,148.10	0.38
65	601398	工商银行	28,300	200,081.00	0.38
66	300223	北京君正	800	199,120.00	0.37
67	600497	驰宏锌锗	16,400	198,604.00	0.37
68	600276	恒瑞医药	3,800	197,752.00	0.37
69	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.37
70	600392	盛和资源	6,600	196,482.00	0.37
71	688521	芯原股份	521	193,363.94	0.36
72	600233	圆通速递	12,200	192,150.00	0.36
73	300567	精测电子	600	190,560.00	0.36
74	003816	中国广核	48,600	190,026.00	0.36
75	002460	赣锋锂业	2,900	189,660.00	0.36
76	600674	川投能源	13,300	188,461.00	0.35
77	600522	中天科技	3,100	188,108.00	0.35
78	002532	天山铝业	17,300	185,629.00	0.35
79	688099	晶晨股份	1,801	185,322.90	0.35
80	002466	天齐锂业	3,000	183,960.00	0.35
81	002025	航天电器	2,400	182,928.00	0.34
82	000977	浪潮信息	2,600	182,000.00	0.34
83	600875	东方电气	6,200	178,374.00	0.33
84	002138	顺络电子	2,400	175,440.00	0.33
85	000792	盐湖股份	5,800	175,102.00	0.33

86	000975	山金国际	10,300	175,100.00	0.33
87	002266	浙富控股	34,500	174,570.00	0.33
88	601677	明泰铝业	10,300	170,980.00	0.32
89	605499	东鹏饮料	1,380	170,333.40	0.32
90	300724	捷佳伟创	2,400	169,440.00	0.32
91	601000	唐山港	40,100	166,415.00	0.31
92	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.31
93	300458	全志科技	4,200	165,732.00	0.31
94	000683	博源化工	28,600	164,736.00	0.31
95	603816	顾家家居	7,300	163,228.00	0.31
96	002821	凯莱英	1,000	162,000.00	0.30
97	002001	新 和 成	5,700	161,994.00	0.30
98	601211	国泰海通	8,900	161,980.00	0.30
99	600549	厦门钨业	1,900	161,880.00	0.30
100	600153	建发股份	20,200	160,186.00	0.30
101	600418	江淮汽车	6,200	160,146.00	0.30
102	000032	深桑达 A	6,400	159,680.00	0.30
103	000039	中集集团	19,600	158,956.00	0.30
104	600585	海螺水泥	9,300	157,635.00	0.30
105	600039	四川路桥	20,100	157,182.00	0.30
106	600816	建元信托	64,000	156,160.00	0.29
107	000932	华菱钢铁	44,900	155,803.00	0.29
108	002544	普天科技	8,500	154,870.00	0.29
109	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.29
110	688390	固德威	1,400	151,914.00	0.29
111	601155	新城控股	14,700	150,822.00	0.28
112	603833	欧派家居	5,000	150,550.00	0.28
113	600048	保利发展	31,900	147,697.00	0.28
114	300001	特锐德	3,900	147,537.00	0.28
115	600258	首旅酒店	13,500	147,420.00	0.28
116	002812	恩捷股份	2,200	147,202.00	0.28
117	300012	华测检测	10,600	146,916.00	0.28
118	600499	科达制造	10,600	146,280.00	0.27
119	000069	华侨城 A	89,000	145,960.00	0.27
120	600325	华发股份	62,600	144,606.00	0.27
121	000157	中联重科	20,400	142,188.00	0.27
122	600066	宇通客车	5,300	142,093.00	0.27
123	002572	索菲亚	19,300	140,890.00	0.26
124	002271	东方雨虹	11,700	138,879.00	0.26
125	600166	福田汽车	47,500	138,225.00	0.26
126	600226	亨通股份	14,100	135,219.00	0.25
127	600893	航发动力	3,500	134,190.00	0.25
128	300395	菲利华	1,000	133,730.00	0.25

129	300782	卓胜微	1,200	131,496.00	0.25
130	002497	雅化集团	6,400	130,368.00	0.24
131	300803	指南针	1,400	128,338.00	0.24
132	600426	华鲁恒升	5,300	126,776.00	0.24
133	603766	隆鑫通用	10,400	124,072.00	0.23
134	601288	农业银行	20,000	121,400.00	0.23
135	000830	鲁西化工	10,100	121,200.00	0.23
136	002405	四维图新	18,700	120,989.00	0.23
137	603799	华友钴业	2,500	120,650.00	0.23
138	600754	锦江酒店	6,700	120,533.00	0.23
139	300118	东方日升	9,600	119,520.00	0.22
140	002422	科伦药业	3,100	119,412.00	0.22
141	002756	永兴材料	2,100	118,944.00	0.22
142	300049	福瑞医科	3,000	116,640.00	0.22
143	000933	神火股份	5,500	116,600.00	0.22
144	002444	巨星科技	3,700	115,070.00	0.22
145	000415	渤海租赁	28,000	113,960.00	0.21
146	000733	振华科技	2,000	113,280.00	0.21
147	688469	芯联集成	10,655	113,049.55	0.21
148	000002	万 科 A	37,900	112,184.00	0.21
149	600008	首创环保	40,900	111,248.00	0.21
150	600711	盛屯矿业	10,100	110,797.00	0.21
151	300432	富临精工	5,500	110,495.00	0.21
152	000568	泸州老窖	1,400	108,528.00	0.20
153	002837	英维克	1,360	108,201.60	0.20
154	000786	北新建材	5,900	106,731.00	0.20
155	002128	电投能源	4,600	106,352.00	0.20
156	001979	招商蛇口	16,500	106,095.00	0.20
157	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.20
158	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.20
159	002223	鱼跃医疗	4,100	105,206.00	0.20
160	300896	爱美客	1,200	104,640.00	0.20
161	688617	惠泰医疗	575	104,397.00	0.20
162	002891	中宠股份	3,900	104,208.00	0.20
163	002028	思源电气	600	103,800.00	0.19
164	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.19
165	002078	太阳纸业	8,200	102,418.00	0.19
166	300919	中伟新材	2,300	100,625.00	0.19
167	301550	斯菱智驱	1,100	100,573.00	0.19
168	600879	航天电子	4,700	100,063.00	0.19
169	603993	洛阳钼业	5,700	100,035.00	0.19
170	300568	星源材质	5,300	99,216.00	0.19
171	000425	徐工机械	12,200	98,698.00	0.19

172	002064	华峰化学	10,400	98,696.00	0.19
173	600141	兴发集团	2,100	98,637.00	0.19
174	002155	湖南黄金	4,100	97,867.00	0.18
175	600398	海澜之家	18,600	97,278.00	0.18
176	000858	五 粮 液	1,300	96,200.00	0.18
177	002600	领益智造	5,500	95,370.00	0.18
178	605117	德业股份	880	93,438.40	0.18
179	688120	华海清科	290	93,432.20	0.18
180	002065	东华软件	12,900	92,106.00	0.17
181	600515	海南机场	33,300	91,242.00	0.17
182	000035	中国天楹	18,800	90,804.00	0.17
183	000630	铜陵有色	14,100	89,676.00	0.17
183	002120	韵达股份	14,100	89,676.00	0.17
184	002738	中矿资源	1,500	88,485.00	0.17
185	600323	瀚蓝环境	3,200	87,872.00	0.16
186	300144	宋城演艺	14,700	85,407.00	0.16
187	601018	宁波港	25,700	80,955.00	0.15
188	601567	三星电气	5,400	80,676.00	0.15
189	600859	王府井	8,600	78,948.00	0.15
190	002410	广联达	9,600	78,336.00	0.15
191	601816	京沪高铁	16,700	75,651.00	0.14
192	688063	派能科技	1,402	74,684.54	0.14
193	600741	华域汽车	4,800	74,496.00	0.14
194	600886	国投电力	5,400	71,874.00	0.13
195	600312	平高电气	4,000	70,640.00	0.13
196	688676	金盘科技	832	70,420.48	0.13
197	601872	招商轮船	4,000	70,280.00	0.13
198	300058	蓝色光标	5,100	70,176.00	0.13
199	300972	万辰集团	400	69,364.00	0.13
200	002558	巨人网络	2,500	68,900.00	0.13
201	300347	泰格医药	1,400	67,200.00	0.13
202	601225	陕西煤业	3,300	67,155.00	0.13
203	300124	汇川技术	1,000	66,330.00	0.12
204	001965	招商公路	7,200	65,952.00	0.12
205	600486	扬农化工	1,300	65,910.00	0.12
206	301078	孩子王	9,600	64,896.00	0.12
207	600803	新奥股份	4,100	64,780.00	0.12
208	688116	天奈科技	1,694	64,710.80	0.12
209	603885	吉祥航空	6,200	63,798.00	0.12
210	601799	星宇股份	700	63,434.00	0.12
211	601390	中国中铁	15,200	63,384.00	0.12
212	601880	辽港股份	45,900	63,342.00	0.12
213	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.12

214	601127	赛力斯	1,000	61,250.00	0.11
215	002648	卫星化学	2,600	61,074.00	0.11
216	601238	广汽集团	11,800	59,944.00	0.11
217	601601	中国太保	2,100	59,892.00	0.11
218	603899	晨光股份	2,900	59,827.00	0.11
219	000960	锡业股份	1,400	59,766.00	0.11
220	601168	西部矿业	2,200	59,708.00	0.11
221	688271	联影医疗	579	58,612.17	0.11
222	600352	浙江龙盛	4,800	58,128.00	0.11
223	300438	鹏辉能源	700	57,995.00	0.11
224	002091	江苏国泰	7,900	57,117.00	0.11
225	600019	宝钢股份	10,500	57,015.00	0.11
226	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.11
227	601689	拓普集团	1,000	56,420.00	0.11
228	002493	荣盛石化	5,200	55,900.00	0.10
229	603939	益丰药房	3,100	55,738.00	0.10
230	000831	中国稀土	1,000	55,490.00	0.10
231	600309	万华化学	800	54,728.00	0.10
232	000034	神州数码	1,940	53,835.00	0.10
233	600036	招商银行	1,500	53,250.00	0.10
234	600795	国电电力	11,200	52,304.00	0.10
235	600026	中远海能	2,900	52,026.00	0.10
236	688777	中控技术	442	51,935.00	0.10
237	002625	光启技术	1,700	51,544.00	0.10
238	000623	吉林敖东	2,900	51,417.00	0.10
239	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.10
240	601117	中国化学	6,800	49,980.00	0.09
241	000423	东阿阿胶	1,100	49,896.00	0.09
242	600699	均胜电子	2,300	49,703.00	0.09
243	603650	彤程新材	500	48,990.00	0.09
244	002595	豪迈科技	1,050	48,930.00	0.09
245	300073	当升科技	1,000	48,040.00	0.09
246	688266	泽璟制药	400	46,664.00	0.09
247	600177	雅戈尔	5,900	44,427.00	0.08
248	000001	平安银行	4,300	43,215.00	0.08
249	300433	蓝思科技	800	42,928.00	0.08
250	600820	隧道股份	8,100	42,201.00	0.08
251	601058	赛轮轮胎	3,600	41,508.00	0.08
252	002601	龙佰集团	2,500	41,200.00	0.08
253	000100	TCL 科技	7,000	40,740.00	0.08
254	600346	恒力石化	2,300	40,733.00	0.08
255	600660	福耀玻璃	800	40,352.00	0.08
256	300083	创世纪	2,900	39,498.00	0.07

257	600988	赤峰黄金	1,500	39,480.00	0.07
258	603260	合盛硅业	800	38,608.00	0.07
259	300033	同花顺	160	38,560.00	0.07
260	600885	宏发股份	1,100	37,939.00	0.07
261	300763	锦浪科技	400	36,140.00	0.07
262	600004	白云机场	4,800	34,848.00	0.07
263	002131	利欧股份	7,200	34,200.00	0.06
264	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.06
265	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.06
266	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.06
267	601615	明阳智能	2,800	32,396.00	0.06
268	688036	传音控股	545	32,127.75	0.06
269	002008	大族激光	200	30,022.00	0.06
270	688126	沪硅产业	748	29,837.72	0.06
271	600011	华能国际	3,900	29,601.00	0.06
272	688166	博瑞医药	820	28,708.20	0.05
273	601618	中国中冶	11,700	28,548.00	0.05
274	002831	裕同科技	800	28,448.00	0.05
275	300390	天华新能	300	28,053.00	0.05
276	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.05
277	600018	上港集团	5,700	26,904.00	0.05
278	600998	九州通	5,600	26,264.00	0.05
279	688213	思特威	244	26,125.08	0.05
280	600941	中国移动	300	25,839.00	0.05
281	688303	大全能源	1,468	25,587.24	0.05
282	601988	中国银行	4,400	25,168.00	0.05
283	600316	洪都航空	900	25,146.00	0.05
284	600663	陆家嘴	4,000	25,120.00	0.05
285	002126	银轮股份	500	24,900.00	0.05
286	002555	三七互娱	1,300	24,531.00	0.05
287	603596	伯特利	980	24,343.20	0.05
288	300418	昆仑万维	600	24,216.00	0.05
289	600170	上海建工	10,800	23,976.00	0.05
290	300136	信维通信	200	23,850.00	0.04
291	688005	容百科技	772	23,623.20	0.04
292	600570	恒生电子	1,100	23,309.00	0.04
293	300759	康龙化成	800	23,144.00	0.04
294	002252	上海莱士	5,200	22,568.00	0.04
295	002195	岩山科技	3,400	22,236.00	0.04
296	300017	网宿科技	1,700	22,117.00	0.04
297	688578	艾力斯	202	22,058.40	0.04
298	688122	西部超导	348	21,857.88	0.04
299	603806	福斯特	1,300	21,827.00	0.04

300	000301	东方盛虹	1,900	21,755.00	0.04
301	002465	海格通信	1,700	21,709.00	0.04
302	601233	桐昆股份	1,000	21,650.00	0.04
303	300866	安克创新	200	20,900.00	0.04
304	600588	用友网络	2,200	20,196.00	0.04
305	000967	盈峰环境	1,900	20,007.00	0.04
306	002389	航天彩虹	1,100	19,547.00	0.04
307	601088	中国神华	500	19,520.00	0.04
308	600438	通威股份	1,600	19,376.00	0.04
309	300454	深信服	200	19,240.00	0.04
310	600111	北方稀土	400	19,220.00	0.04
311	002318	久立特材	800	19,120.00	0.04
312	605589	圣泉集团	300	19,071.00	0.04
313	000878	云南铜业	1,200	19,056.00	0.04
314	600938	中国海油	700	19,005.00	0.04
315	300457	赢合科技	900	18,972.00	0.04
316	603501	豪威集团	200	18,970.00	0.04
317	300037	新宙邦	200	18,570.00	0.03
318	600009	上海机场	800	18,480.00	0.03
319	600219	南山铝业	4,600	18,354.00	0.03
320	601216	君正集团	4,100	18,286.00	0.03
321	600115	中国东航	4,700	17,907.00	0.03
322	601668	中国建筑	4,100	17,794.00	0.03
323	600064	南京高科	2,400	17,112.00	0.03
324	000519	中兵红箭	800	16,856.00	0.03
325	600118	中国卫星	200	16,410.00	0.03
326	601766	中国中车	3,100	16,120.00	0.03
327	688180	君实生物	454	15,354.28	0.03
328	601006	大秦铁路	3,300	15,213.00	0.03
329	600864	哈投股份	2,900	15,051.00	0.03
330	002517	恺英网络	900	14,625.00	0.03
331	600989	宝丰能源	700	14,231.00	0.03
332	000538	云南白药	300	14,211.00	0.03
333	600196	复星医药	600	13,482.00	0.03
334	002352	顺丰控股	400	12,504.00	0.02
335	600535	天士力	900	11,907.00	0.02
336	600085	同仁堂	500	11,555.00	0.02
337	600436	片仔癀	100	10,928.00	0.02
338	603392	万泰生物	400	10,788.00	0.02
339	601607	上海医药	700	10,780.00	0.02
340	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.02
341	600160	巨化股份	200	10,602.00	0.02
342	300122	智飞生物	900	10,521.00	0.02

343	600511	国药股份	400	10,416.00	0.02
344	600038	中直股份	400	10,116.00	0.02
345	002407	多氟多	200	10,046.00	0.02
346	600332	白云山	500	10,020.00	0.02
347	600704	物产中大	2,100	9,912.00	0.02
348	000426	兴业银锡	300	9,888.00	0.02
349	002244	滨江集团	1,300	9,880.00	0.02
350	002007	华兰生物	800	9,752.00	0.02
351	688169	石头科技	100	9,497.00	0.02
352	000999	华润三九	400	8,996.00	0.02
353	002920	德赛西威	100	8,150.00	0.02
354	600895	张江高科	200	7,450.00	0.01
355	601866	中远海发	3,200	7,072.00	0.01
356	603606	东方电缆	160	6,641.60	0.01
357	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.01
358	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.01
359	600489	中金黄金	300	5,415.00	0.01
360	601888	中国中免	100	5,371.00	0.01
361	688065	凯赛生物	109	5,215.65	0.01
362	601857	中国石油	600	5,208.00	0.01
363	002709	天赐材料	100	5,143.00	0.01
364	601877	正泰电器	200	5,014.00	0.01
365	300003	乐普医疗	400	4,740.00	0.01
366	300342	天银机电	100	4,700.00	0.01
367	002050	三花智控	100	4,383.00	0.01
368	600362	江西铜业	100	4,330.00	0.01
369	301236	软通动力	100	4,245.00	0.01
370	300832	新产业	100	4,200.00	0.01
371	002472	双环传动	100	4,151.00	0.01
372	600760	中航沈飞	100	4,110.00	0.01
373	002230	科大讯飞	100	4,084.00	0.01
374	600690	海尔智家	200	4,082.00	0.01
375	300450	先导智能	100	4,072.00	0.01
376	300024	机器人	200	3,866.00	0.01
377	300339	润和软件	100	3,851.00	0.01
378	300573	兴齐眼药	90	3,668.40	0.01
379	000063	中兴通讯	100	3,619.00	0.01
380	000887	中鼎股份	200	3,578.00	0.01
381	600028	中国石化	800	3,568.00	0.01
382	601628	中国人寿	100	3,535.00	0.01
383	002714	牧原股份	100	3,499.00	0.01
384	600031	三一重工	200	3,456.00	0.01
385	002415	海康威视	100	3,420.00	0.01

386	600673	东阳光	100	3,358.00	0.01
387	603288	海天味业	100	3,316.00	0.01
388	600580	卧龙电驱	100	3,310.00	0.01
389	002236	大华股份	200	3,298.00	0.01
390	002294	信立泰	100	3,189.00	0.01
391	600143	金发科技	200	3,090.00	0.01
392	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.01
393	600096	云天化	100	3,040.00	0.01
394	601633	长城汽车	200	3,018.00	0.01
395	600667	太极实业	100	2,918.00	0.01
396	603659	璞泰来	100	2,893.00	0.01
397	688472	阿特斯	267	2,888.94	0.01
398	300699	光威复材	100	2,865.00	0.01
399	000963	华东医药	100	2,812.00	0.01
400	603568	伟明环保	180	2,768.40	0.01
401	002074	国轩高科	100	2,751.00	0.01
402	600000	浦发银行	300	2,583.00	0.00
403	600050	中国联通	600	2,400.00	0.00
404	002202	金风科技	100	2,390.00	0.00
405	600161	天坛生物	200	2,316.00	0.00
406	600547	山东黄金	100	2,309.00	0.00
407	600406	国电南瑞	100	2,285.00	0.00
408	002241	歌尔股份	100	2,253.00	0.00
409	600089	特变电工	100	2,250.00	0.00
410	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
411	000768	中航西飞	100	2,048.00	0.00
412	688599	天合光能	144	2,033.28	0.00
413	002176	江特电机	200	2,002.00	0.00
414	002340	格林美	300	1,983.00	0.00
415	000547	航天发展	100	1,915.00	0.00
416	000066	中国长城	100	1,905.00	0.00
417	300207	欣旺达	100	1,899.00	0.00
418	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
419	600529	山东药玻	100	1,845.00	0.00
420	000738	航发控制	100	1,829.00	0.00
421	600862	中航高科	100	1,803.00	0.00
422	688009	中国通号	378	1,799.28	0.00
423	601728	中国电信	300	1,557.00	0.00
424	002603	以岭药业	100	1,500.00	0.00
425	601179	中国西电	100	1,492.00	0.00
426	600521	华海药业	100	1,440.00	0.00
427	002414	高德红外	100	1,326.00	0.00
427	601919	中远海控	100	1,326.00	0.00

428	601012	隆基绿能	100	1,312.00	0.00
429	300142	沃森生物	100	1,299.00	0.00
430	600765	中航重机	100	1,292.00	0.00
431	002129	TCL 中环	100	1,202.00	0.00
432	300601	康泰生物	100	1,134.00	0.00
433	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.00
433	300251	光线传媒	100	1,109.00	0.00
434	688223	晶科能源	232	1,102.00	0.00
435	600372	中航机载	100	1,085.00	0.00
436	600415	小商品城	100	1,016.00	0.00
437	601658	邮储银行	200	986.00	0.00
438	600104	上汽集团	100	976.00	0.00
439	002456	欧菲光	100	946.00	0.00
440	601360	三六零	100	869.00	0.00
441	688017	绿的谐波	2	835.72	0.00
442	300015	爱尔眼科	100	826.00	0.00
443	601600	中国铝业	100	822.00	0.00
444	002459	晶澳科技	100	810.00	0.00
445	000998	隆平高科	100	754.00	0.00
446	600905	三峡能源	200	742.00	0.00
447	000625	长安汽车	100	717.00	0.00
448	601727	上海电气	100	700.00	0.00
449	600839	四川长虹	100	698.00	0.00
450	601319	中国人保	100	676.00	0.00
451	600010	宝钢股份	300	669.00	0.00
452	000617	中油资本	100	659.00	0.00
453	002292	奥飞娱乐	100	656.00	0.00
454	600516	方大炭素	100	617.00	0.00
455	601111	中国国航	100	605.00	0.00
456	601186	中国铁建	100	595.00	0.00
457	601800	中国交建	100	571.00	0.00
458	600208	衢州发展	200	566.00	0.00
459	600029	南方航空	100	518.00	0.00
460	002044	美年健康	100	503.00	0.00
461	600157	永泰能源	300	483.00	0.00
462	601669	中国电建	100	470.00	0.00
463	600655	豫园股份	100	411.00	0.00
464	300070	碧水源	100	319.00	0.00
465	601868	中国能建	100	267.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600519	贵州茅台	850,194.00	0.43
2	300750	宁德时代	838,418.00	0.42
3	300308	中际旭创	757,492.00	0.38
4	601318	中国平安	740,659.00	0.37
5	601899	紫金矿业	558,652.00	0.28
6	300502	新易盛	525,702.00	0.27
7	000333	美的集团	441,548.00	0.22
8	600030	中信证券	440,433.00	0.22
9	600036	招商银行	439,224.00	0.22
10	600900	长江电力	402,647.00	0.20
11	002475	立讯精密	385,030.00	0.19
12	601166	兴业银行	383,808.00	0.19
13	603259	药明康德	360,451.00	0.18
14	601328	交通银行	338,885.00	0.17
15	600150	中国船舶	333,293.25	0.17
16	000338	潍柴动力	326,399.00	0.16
17	000725	京东方 A	300,707.00	0.15
18	000651	格力电器	296,166.00	0.15
19	600887	伊利股份	294,870.00	0.15
20	300059	东方财富	267,666.00	0.14

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	300308	中际旭创	1,425,654.00	0.72
2	300750	宁德时代	1,364,758.00	0.69
3	600036	招商银行	1,215,620.00	0.61
4	600519	贵州茅台	1,189,317.40	0.60
5	601318	中国平安	879,717.00	0.44
6	300502	新易盛	860,856.60	0.43
7	601899	紫金矿业	775,822.00	0.39
8	000333	美的集团	620,674.00	0.31
9	601166	兴业银行	584,540.00	0.30
10	600900	长江电力	564,460.00	0.29
11	002475	立讯精密	560,428.00	0.28
12	300059	东方财富	466,199.00	0.24
13	601398	工商银行	432,999.00	0.22
14	002594	比亚迪	432,220.00	0.22
15	600276	恒瑞医药	431,876.00	0.22
16	000651	格力电器	397,948.00	0.20

17	601816	京沪高铁	392,633.00	0.20
18	603986	兆易创新	392,385.00	0.20
19	002371	北方华创	388,945.00	0.20
20	601288	农业银行	378,237.00	0.19

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	53,320,375.76
卖出股票收入（成交）总额	61,589,312.57

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	65,401.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,401.60

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
长盛中证 A500 指数 增强 A	333	39,509.52	895,713.73	6.81	12,260,957.45	93.19
长盛中证	826	42,821.16	-	-	35,370,276.84	100.00

A500 指数增强 C						
合计	1,159	41,869.67	895,713.73	1.85	47,631,234.29	98.15

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛中证 A500 指数增强 A	3,985.95	0.0303
	长盛中证 A500 指数增强 C	0.00	0.0000
	合计	3,985.95	0.0082

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

8.3 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	长盛中证 A500 指数增强 A	0
	长盛中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛中证 A500 指数增强 A	0
	长盛中证 A500 指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛中证 A500 指数增强 A	长盛中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 11 月 11 日）基金份额总额	105,671,495.09	246,262,361.48
本报告期期初基金份额总额	64,120,482.18	132,496,807.25
本报告期基金总申购份额	8,055,514.21	13,949,786.69
减：本报告期基金总赎回份额	59,019,325.21	111,076,317.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,156,671.18	35,370,276.84

§ 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 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未受到调查或处罚。

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，托管人的相关从业人员未受到调查或处罚。

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 (%)	
财通证券	3	62,453,363.89	54.35	11,936.17	53.73	-
国元证券	3	52,456,324.44	45.65	10,277.94	46.27	-

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 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式。本基金管理人负责选择证券公司，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券公司的选择标准如下：

- (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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要。
- (4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

2、证券公司的选择程序

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券公司。
- (2) 基金管理人和被选中的证券公司签订协议。

3、本报告期内选择证券公司的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日

2	长盛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
3	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
4	长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
5	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
6	长盛基金管理有限公司关于调整长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 10 日
7	长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日
8	长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金（长盛中证 A500 指数增强 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日
9	长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金（长盛中证 A500 指数增强 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 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 A500 指数增强型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日