

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61

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	61
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.11 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	66
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城智盈添益债券型发起式证券投资基金	
基金简称	长城智盈添益债券发起式	
基金主代码	020181	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 26 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	171,167,005.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
下属分级基金的交 易代码	020181	020182
报告期末下属分级 基金的份额总额	114,857,291.20 份	56,309,714.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持流动性和控制风险的前提下，通过积极主动的组合管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。 2、债券投资策略 本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。 3、股票投资策略 （1）A 股投资策略 本基金在考虑大类资产配置的基础上，通过定量和定性相结合的方式，进行个股精选。 （2）港股通标的投资策略 本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会。 （3）存托凭证投资策略 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 4、国债期货投资策略 本基金投资于国债期货，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

业绩比较基准	中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：本基金业绩比较基准自 2024 年 5 月 29 日起变更为“中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%”。

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		长城基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李建军	周直毅
	联系电话	0755-29279005	021-68475608
	电子邮箱	lijj@ccfund.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		400-8868-666	95594
传真		0755-29279000	021-68476901
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	上海市黄浦区中山南路 688 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、38 层、39 层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 168 号 37 层
邮政编码		518046	200120
法定代表人		王军	顾建忠

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.ccfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、38 层、39 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)
---------------	---------------------------------------

	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
本期已实现收益	4,721,782.79	3,513,759.49
本期利润	2,810,332.40	3,851,386.68
加权平均基金份额本期利润	0.0189	0.0330
本期加权平均净值利润率	1.74%	3.06%
本期基金份额净值增长率	1.33%	1.18%
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	10,050,525.93	4,538,655.65
期末可供分配基金份额利润	0.0875	0.0806
期末基金资产净值	124,907,817.13	60,848,369.67
期末基金份额净值	1.0875	1.0806
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	10.78%	10.09%

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上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。

③“期末可供分配利润”的计算方法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。

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

长城智盈添益债券发起式 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	1.45%	0.30%	1.30%	0.13%	0.15%	0.17%
过去六个月	1.33%	0.29%	1.13%	0.13%	0.20%	0.16%
过去一年	2.07%	0.24%	1.45%	0.11%	0.62%	0.13%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—

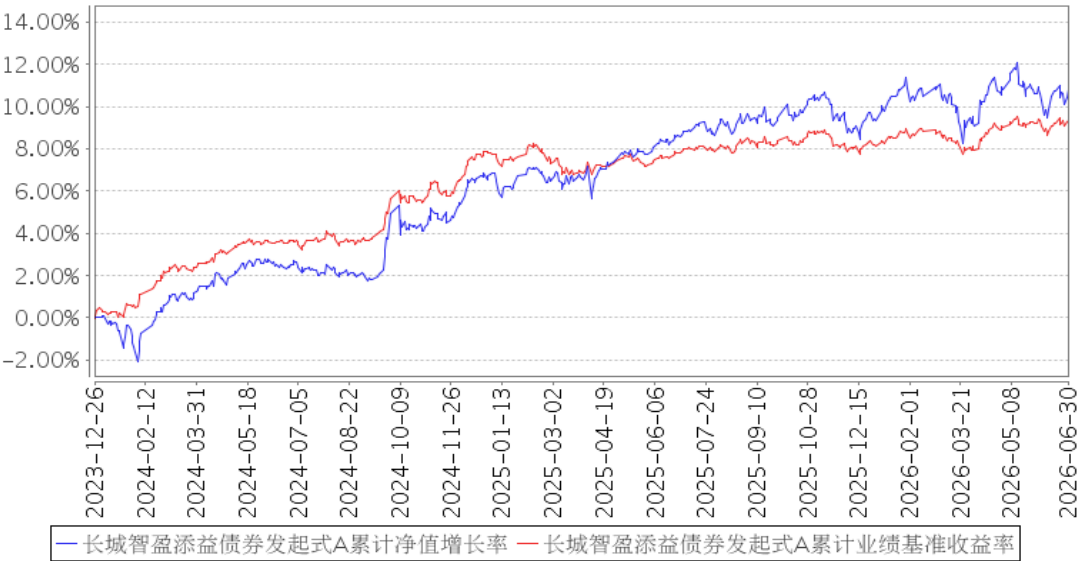
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	10.78%	0.22%	9.36%	0.12%	1.42%	0.10%

长城智盈添益债券发起式 C

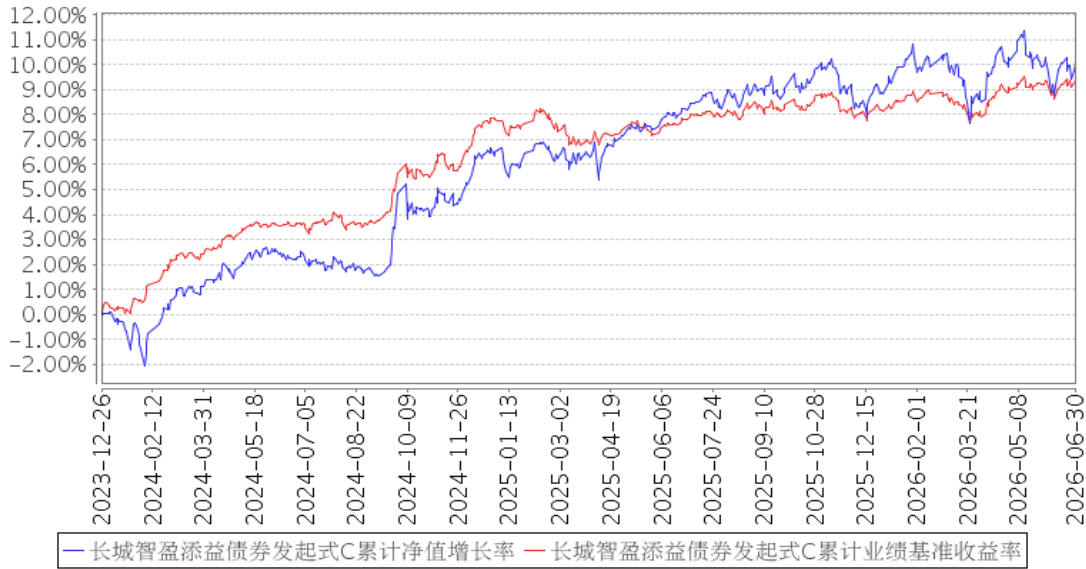
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.37%	0.30%	1.30%	0.13%	0.07%	0.17%
过去六个月	1.18%	0.28%	1.13%	0.13%	0.05%	0.15%
过去一年	1.76%	0.24%	1.45%	0.11%	0.31%	0.13%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	10.09%	0.22%	9.36%	0.12%	0.73%	0.10%

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

长城智盈添益债券发起式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



长城智盈添益债券发起式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本基金合同规定本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资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。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

长城基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 128 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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		
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理	2023 年 12 月 26 日	—	18 年	男，中国籍，硕士。2008 年 7 月-2017 年 11 月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理兼基金经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 6 月至 2023 年 9 月任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至 2023 年 7 月兼任专户投资经理，自 2024 年 11 月至 2025 年 6 月任“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 1 月至 2026 年 2 月任“长城中证 A500 指数型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至 2026 年 6 月任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至 2026 年 6 月任“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至 2026 年 6 月任“长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”（自 2025 年 6 月 17 日由“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”变更而来）基金经理。自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2019 年 1 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 12 月至今任“长城智盈添益债券型发起式证券投资基金”基金经理，自 2025 年 4 月至今任“长城上证科

					创业板 100 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至今任“长城恒生科技指数型证券投资基金（QDII）”基金经理，自 2026 年 5 月至今任“长城智悦均衡混合型证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

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

注：无。

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，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价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% 的现象。

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

上半年市场分化巨大，结构性行情带动大盘指数上行，全 A 等权小幅下跌。资金在局部抱团明显，以电子、通信为主的 AI 产业链相关板块资金大量流入，显著跑赢了其他绝大多数行业。另一个角度，市场风格维度下价值、红利、低波类长期有效因子表现很差，与半导体代表的成长动量呈显著的 K 型走势分化，在资金的强势推动下，热门个股的交易集中度也创下了历史新高。但全市场的体感并不好，多数个股先涨后跌，A 股的宽度效应非常差，这严重影响了量化宽度的选股

因子表现。

报告期内，产品权益部分平均仓位接近配置上限。组合总体延续了资产配置、策略配置、因子配置的三层绝对收益配置策略；总体尽量在不同资产子策略上寻求低相关或是负相关的投资组合，力求在控制绝对波动下追求绝对回报；区间内组合加大了对 A 股成长性股票配置，波动性略有放大，但总体组合配置价值将更加受益于 A 股长期表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城智盈添益债券发起式 A 基金份额净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%；长城智盈添益债券发起式 C 基金份额净值增长率为 1.18%，同期业绩比较基准收益率为 1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，A 股总体估值处于较为合理区间内，下行空间有限。短期看，新兴科技行业与传统行业间局部结构性的分化较大，存在局部再平衡的需求；长期来看，中国科技资产的上升周期刚刚起步，成长性行业将持续引领产业变革与经济发展，资本市场的投资价值有望在未来进一步凸显。

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，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人设立受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关研究部门负责人、基金会计等岗位资深人员组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。投资总监和相关研究部门负责人作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理可以列席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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	1,664,708.32	4,139,389.18
结算备付金		451,571.17	1,157,313.75
存出保证金		672,340.08	1,636,695.12
交易性金融资产	6.4.7.2	183,773,850.10	451,739,055.31
其中：股票投资		34,184,759.91	86,873,377.34
基金投资		-	-
债券投资		149,589,090.19	364,865,677.97
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		5,440.00	90,406.08
应收申购款		479.78	87,656.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		186,568,389.45	458,850,515.44
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		209,054.98	1,998,830.00
应付赎回款		354,363.03	1,497,532.74
应付管理人报酬		92,069.29	228,462.61
应付托管费		15,344.87	38,077.12
应付销售服务费		15,329.22	76,254.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,254.09	2,062.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	124,787.17	66,628.62
负债合计		812,202.65	3,907,848.43
净资产：			

实收基金	6. 4. 7. 10	171, 167, 005. 22	425, 314, 362. 75
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	14, 589, 181. 58	29, 628, 304. 26
净资产合计		185, 756, 186. 80	454, 942, 667. 01
负债和净资产总计		186, 568, 389. 45	458, 850, 515. 44

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 171,167,005.22 份，其中长城智盈添益债券发起式 A 基金份额总额 114,857,291.20 份，基金份额净值 1.0875 元；长城智盈添益债券发起式 C 基金份额总额 56,309,714.02 份，基金份额净值 1.0806 元。

6.2 利润表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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		7, 955, 965. 45	988, 483. 79
1. 利息收入		12, 977. 30	3, 880. 49
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	12, 977. 30	3, 604. 33
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		-	276. 16
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9, 516, 662. 13	495, 493. 39
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	6, 904, 457. 12	3, 682. 64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	2, 960, 256. 44	246, 354. 84
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	-697, 108. 91	58, 840. 29
股利收益	6. 4. 7. 19	349, 057. 48	186, 615. 62
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	-1, 573, 823. 20	489, 030. 10

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	149. 22	79. 81
减：二、营业总支出		1, 294, 246. 37	185, 210. 32
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	856, 782. 37	119, 445. 66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	142, 797. 09	19, 907. 74
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	189, 310. 94	39, 981. 13
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2, 833. 55	541. 16
其中：卖出回购金融资产支出		2, 833. 55	541. 16
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		1, 554. 16	195. 75
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	100, 968. 26	5, 138. 88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6, 661, 719. 08	803, 273. 47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6, 661, 719. 08	803, 273. 47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6, 661, 719. 08	803, 273. 47

6.3 净资产变动表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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	425, 314, 362. 75	-	29, 628, 304. 26	454, 942, 667. 01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	425, 314, 362. 75	-	29, 628, 304. 26	454, 942, 667. 01
三、本期增减变	-254, 147, 357. 53	-	-15, 039, 122. 68	-269, 186, 480. 21

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	6,661,719.08	6,661,719.08
（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）	-254,147,357.53	-	-21,700,841.76	-275,848,199.29
其中：1. 基金申购款	99,986,006.03	-	8,072,632.31	108,058,638.34
2. 基金赎回款	-354,133,363.56	-	-29,773,474.07	-383,906,837.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	171,167,005.22	-	14,589,181.58	185,756,186.80
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	10,527,647.68	-	706,407.47	11,234,055.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,527,647.68	-	706,407.47	11,234,055.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	103,294,889.20	-	8,679,311.34	111,974,200.54
（一）、综合收益总额	-	-	803,273.47	803,273.47

(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)	103,294,889.20	-	7,876,037.87	111,170,927.07
其中: 1. 基金申购款	117,457,157.25	-	8,804,018.33	126,261,175.58
2. 基金赎回款	-14,162,268.05	-	-927,980.46	-15,090,248.51
(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	113,822,536.88	-	9,385,718.81	123,208,255.69

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:

祝函

刘沛

李志朋

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

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系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【2023】2560号文《关于准予长城智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由长城基金管理有限公司作为管理人自2023年12月11日至2023年12月22日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2023)验字第70015735_H04号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2023年12月26日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的有效认购资金(本金)为人民币10,110,569.52元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币1,898.91元,以上收到的实收基金(本息)共计人民币10,112,468.43元,折合

10,112,468.43 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、股票（包括创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资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。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资组合比例可相应进行调整。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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

本基金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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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）不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，

同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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金额。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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

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）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）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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

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

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

(3) 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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[2016]127 号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	1,664,708.32
等于：本金	1,664,531.63
加：应计利息	176.69
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	1,664,708.32

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		37,897,256.59	-	34,184,759.91	-3,712,496.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,600,942.26	378,461.11	47,286,950.47	307,547.10
	银行间市场	100,197,055.79	765,139.72	102,302,139.72	1,339,944.21
	合计	146,797,998.05	1,143,600.83	149,589,090.19	1,647,491.31
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		184,695,254.64	1,143,600.83	183,773,850.10	-2,065,005.37

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	16,788,600.00	-	-	-

其中：国债期货投资	16,788,600.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,788,600.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货/国债期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
T2609	10 年期国债 2609	5.00	5,460,750.00	13,750.00
TL2609	30 年期国债 2609	5.00	5,687,500.00	17,000.00
TL2612	30 年期国债 2612	5.00	5,693,000.00	21,900.00
合计				52,650.00
减：可抵销期货暂收款				52,650.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货/国债期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

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

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：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	35,684.61
其中：交易所市场	34,259.61
银行间市场	1,425.00
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
预提上清所债券账户维护费	4,800.00
合计	124,787.17

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城智盈添益债券发起式 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	137,865,501.43	137,865,501.43
本期申购	74,837,124.98	74,837,124.98
本期赎回（以“-”号填列）	-97,845,335.21	-97,845,335.21
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	114,857,291.20	114,857,291.20

长城智盈添益债券发起式 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	287,448,861.32	287,448,861.32
本期申购	25,148,881.05	25,148,881.05
本期赎回（以“-”号填列）	-256,288,028.35	-256,288,028.35
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	56,309,714.02	56,309,714.02

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

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城智盈添益债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,847,132.51	-5,756,985.11	10,090,147.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	15,847,132.51	-5,756,985.11	10,090,147.40
本期利润	4,721,782.79	-1,911,450.39	2,810,332.40
本期基金份额交易产生的变动数	-3,625,407.64	775,453.77	-2,849,953.87
其中：基金申购款	9,846,188.06	-3,736,869.38	6,109,318.68

基金赎回款	-13,471,595.70	4,512,323.15	-8,959,272.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,943,507.66	-6,892,981.73	10,050,525.93

长城智盈添益债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,994,409.91	-11,456,253.05	19,538,156.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,994,409.91	-11,456,253.05	19,538,156.86
本期利润	3,513,759.49	337,627.19	3,851,386.68
本期基金份额交易产生的变动数	-26,703,733.11	7,852,845.22	-18,850,887.89
其中：基金申购款	3,057,816.09	-1,094,502.46	1,963,313.63
基金赎回款	-29,761,549.20	8,947,347.68	-20,814,201.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,804,436.29	-3,265,780.64	4,538,655.65

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	11,406.40
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	843.24
其他	727.66
合计	12,977.30

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	6,904,457.12
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	6,904,457.12

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	183,747,009.01
减：卖出股票成本总额	176,634,690.53
减：交易费用	207,861.36
买卖股票差价收入	6,904,457.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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	2,215,703.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	744,553.42
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	2,960,256.44

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	315,479,839.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	312,310,282.92
减：应计利息总额	2,420,752.75
减：交易费用	4,250.00
买卖债券差价收入	744,553.42

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-697,108.91

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	349,057.48
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	349,057.48

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	-2,862,558.91
股票投资	-5,228,257.11

债券投资	2,365,698.20
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,288,735.71
权证投资	-
期货投资	1,288,735.71
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	-1,573,823.20

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	149.22
合计	149.22

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,576.89
深港通_证券组合费	688.81
上清所债券账户服务费	14,100.00
上清所查询费	300.00
合计	100,968.26

6.4.7.24 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作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

本基金本报告期无与对本基金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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	312,921,339.22	100.00	23,055,233.27	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
长城证券	146,463,843.36	100.00	69,316,848.60	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
长城证券	32,600,000.00	100.00	11,800,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：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 (%)
长城证券	75,820.07	100.00	34,259.61	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	5,682.72	100.00	3,314.67	100.00

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）本报告期，本基金的交易佣金费率不超过中国基金业协会对外通报的市场平均股票交易佣金费率的两倍，佣金包含佣金收取方为基金提供证券研究服务而收取的费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	856,782.37	119,445.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	232,099.81	43,571.23
应支付基金管理人的净管理费	624,682.56	75,874.43

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	142,797.09	19,907.74

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{托管费费率} \div \text{当年天数}$$

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		
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C	合计
长城基金管理有限公司	-	895.69	895.69
合计	-	895.69	895.69
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		

	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C	合计
长城基金管理有限公司	-	12.94	12.94
合计	-	12.94	12.94

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 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。销售服务费按该类基金份额前一日资产净值的销售服务费年费率计提。计算公式如下：

$$H=E\times \text{该类基金份额销售服务费年费率}\div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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

注：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

注：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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 12 月 26 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期间申购/ 买入总份额	-	-
报告期间因拆分 变动份额	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.8434%	—
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日（2023 年 12 月 26 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,001,889.08	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.7873%	—

注：基金管理人持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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

份额单位：份

长城智盈添益债券发起式 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
长城证券股份有限公司	—	—	3,764,630.72	0.8851

注：关联方持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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
上海银行	1,664,708.32	11,406.40	14,845,575.34	3,394.45

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况, 请参阅本财务报表

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

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

注：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
300214	日科化学	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	10.25	2026 年 7 月 13 日	12.30	2,400	18,077.55	24,600.00	-

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本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为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产

的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,664,708.32	-	-	-	-	-	1,664,708.32
结算备付金	451,571.17	-	-	-	-	-	451,571.17
存出保证金	672,340.08	-	-	-	-	-	672,340.08
交易性金融资产	101,262.55	4,876,674.12	11,865,737.07	124,769,234.01	7,976,182.44	34,184,759.91	183,773,850.10
应收股利	-	-	-	-	-	5,440.00	5,440.00
应收申购款	-	-	-	-	-	479.78	479.78
资产总计	2,889,882.12	4,876,674.12	11,865,737.07	124,769,234.01	7,976,182.44	34,190,679.69	186,568,389.45
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	-	-354,363.03	354,363.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-92,069.29	92,069.29
应付托管费	-	-	-	-	-	-15,344.87	15,344.87
应付清算款	-	-	-	-	-	-209,054.98	209,054.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-15,329.22	15,329.22
应交税费	-	-	-	-	-	-1,254.09	1,254.09
其他负债	-	-	-	-	-	-124,787.17	124,787.17
负债总计	-	-	-	-	-	-812,202.65	812,202.65
利率敏感度缺口	2,889,882.12	4,876,674.12	11,865,737.07	124,769,234.01	7,976,182.44		
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,139,389.18	-	-	-	-	-4,139,389.18	
结算备付金	1,157,313.75	-	-	-	-	-1,157,313.75	
存出保证金	1,636,695.12	-	-	-	-	-1,636,695.12	
交易性金融资产	-	508,760.00	42,288,187.09	276,945,794.68	45,122,936.20	86,873,377.34	451,739,055.31
应收股利	-	-	-	-	-	-90,406.08	90,406.08
应收申购款	-	-	-	-	-	-87,656.00	87,656.00
资产总计	6,933,398.05	508,760.00	42,288,187.09	276,945,794.68	45,122,936.20	87,051,439.42	458,850,515.44
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-1,497,532.74	1,497,532.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-228,462.61	228,462.61
应付托管费	-	-	-	-	-	-38,077.12	38,077.12
应付清算款	-	-	-	-	-	-1,998,830.00	1,998,830.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-76,254.81	76,254.81
应交税费	-	-	-	-	-	-2,062.53	2,062.53
其他负债	-	-	-	-	-	-66,628.62	66,628.62
负债总计	-	-	-	-	-	-3,907,848.43	3,907,848.43
利率敏感度缺口	6,933,398.05	508,760.00	42,288,187.09	276,945,794.68	45,122,936.20		

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）
	市场利率下降 25 个基点	1, 234, 029. 50	4, 383, 697. 73
	市场利率上升 25 个基点	-1, 218, 483. 64	-4, 265, 808. 03

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。

本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7, 167, 934. 71	-	7, 167, 934. 71
资产合计	-	7, 167, 934. 71	-	7, 167, 934. 71
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	7, 167, 934. 71	-	7, 167, 934. 71
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33, 319, 659. 33	-	33, 319, 659. 33

资产合计	-	33,319,659.33	-	33,319,659.33
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	33,319,659.33	-	33,319,659.33

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有外币均相对人民币升值 5%	358,396.74	1,665,982.97
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-358,396.74	-1,665,982.97

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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金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。

本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	34,184,759.91	18.40	86,873,377.34	19.10
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	149,589,090.19	80.53	364,865,677.97	80.20

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	183,773,850.10	98.93	451,739,055.31	99.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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）
	沪深 300 指数上升 5%	2,281,661.80	4,655,544.29
	沪深 300 指数下降 5%	-2,281,661.80	-4,655,544.29

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

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	34,165,435.07	86,873,377.34
第二层次	149,608,415.03	364,865,677.97

第三层次	-	-
合计	183,773,850.10	451,739,055.31

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。
对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、新发未上市和非公开发行业等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	34,184,759.91	18.32
	其中：股票	34,184,759.91	18.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	149,589,090.19	80.18
	其中：债券	149,589,090.19	80.18
	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	2,116,279.49	1.13
8	其他各项资产	678,259.86	0.36
9	合计	186,568,389.45	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,167,934.71 元，占基金资产净值的比例为 3.86%。

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	63,842.80	0.03
B	采矿业	780,009.00	0.42
C	制造业	19,115,214.22	10.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	372,744.00	0.20
E	建筑业	185,190.00	0.10
F	批发和零售业	685,191.20	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	239,061.00	0.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,065,933.82	1.11
J	金融业	2,056,434.06	1.11
K	房地产业	136,114.00	0.07
L	租赁和商务服务业	424,454.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	402,851.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	215,866.10	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	6,200.00	0.00
P	教育	41,220.00	0.02
Q	卫生和社会工作	105,934.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	120,566.00	0.06
S	综合	—	—
	合计	27,016,825.20	14.54

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,690,537.04	0.91
消费者非必需品	—	—
消费者常用品	—	—
能源	—	—
金融	1,406,877.29	0.76
医疗保健	—	—
工业	—	—
信息科技	—	—
电信服务	4,070,520.38	2.19

公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	7,167,934.71	3.86

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

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	00700	腾讯控股	9,300	3,471,715.95	1.87
2	01818	招金矿业	68,000	968,016.35	0.52
3	02888	渣打集团	4,300	790,276.27	0.43
4	688120	华海清科	2,026	652,736.68	0.35
5	00005	汇丰控股	4,800	616,601.02	0.33
6	09899	网易云音乐	6,700	598,804.43	0.32
7	300857	协创数据	1,760	598,224.00	0.32
8	688037	芯源微	1,263	554,520.15	0.30
9	02259	紫金黄金国际	6,300	484,260.05	0.26
10	688702	盛科通信	1,215	473,837.85	0.26
11	000783	长江证券	47,600	464,100.00	0.25
12	688313	仕佳光子	2,300	424,695.00	0.23
13	688220	翱捷科技	3,402	422,936.64	0.23
14	002008	大族激光	2,800	420,308.00	0.23
15	600885	宏发股份	11,400	393,186.00	0.21
16	688099	晶晨股份	3,711	381,861.90	0.21
17	688375	国博电子	3,624	377,983.20	0.20
18	688578	艾力斯	3,300	360,360.00	0.19
19	688002	睿创微纳	2,300	355,787.00	0.19
20	688336	三生国健	6,596	350,247.60	0.19
21	600988	赤峰黄金	13,200	347,424.00	0.19
22	600177	雅戈尔	45,600	343,368.00	0.18
23	600601	方正科技	24,700	341,848.00	0.18
24	002335	科华数据	7,860	333,657.00	0.18
25	300724	捷佳伟创	4,700	331,820.00	0.18
26	000893	亚钾国际	7,500	306,675.00	0.17
27	688387	信科移动	15,063	298,849.92	0.16
28	000878	云南铜业	18,600	295,368.00	0.16
29	300919	中伟新材	6,700	293,125.00	0.16
30	300699	光威复材	10,200	292,230.00	0.16
31	603806	福斯特	17,400	292,146.00	0.16
32	600363	联创光电	8,000	286,240.00	0.15
33	000987	越秀资本	35,900	280,738.00	0.15
34	300017	网宿科技	20,800	270,608.00	0.15

35	688568	中科星图	6,241	258,814.27	0.14
36	600118	中国卫星	3,100	254,355.00	0.14
37	000683	博源化工	42,900	247,104.00	0.13
38	601212	白银有色	48,100	244,348.00	0.13
39	300450	先导智能	5,900	240,248.00	0.13
40	601577	长沙银行	27,400	238,654.00	0.13
41	03858	佳鑫国际资源	4,800	238,260.64	0.13
42	300627	华测导航	8,300	235,720.00	0.13
43	600295	鄂尔多斯	20,700	221,904.00	0.12
44	002851	麦格米特	1,300	217,334.00	0.12
45	001389	广合科技	900	213,525.00	0.11
46	301308	江波龙	300	211,140.00	0.11
47	300475	香农芯创	700	210,000.00	0.11
48	002402	和而泰	8,000	206,640.00	0.11
49	300058	蓝色光标	14,800	203,648.00	0.11
50	603786	科博达	4,800	196,368.00	0.11
51	300972	万辰集团	1,100	190,751.00	0.10
52	002266	浙富控股	33,600	170,016.00	0.09
53	000960	锡业股份	3,900	166,491.00	0.09
54	601106	中国一重	49,400	163,020.00	0.09
55	600816	建元信托	66,500	162,260.00	0.09
56	603259	药明康德	1,300	161,863.00	0.09
57	002195	岩山科技	23,700	154,998.00	0.08
58	603516	淳中科技	1,100	148,071.00	0.08
59	688385	复旦微电	2,061	146,928.69	0.08
60	600487	亨通光电	1,300	142,142.00	0.08
61	603658	安图生物	4,800	139,296.00	0.07
62	603345	安井食品	1,700	136,323.00	0.07
63	300759	康龙化成	4,600	133,078.00	0.07
64	601881	中国银河	10,200	128,214.00	0.07
65	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.07
66	601998	中信银行	18,300	126,819.00	0.07
67	002324	普利特	10,500	126,735.00	0.07
68	000629	钒钛股份	36,600	122,244.00	0.07
69	000977	浪潮信息	1,700	119,000.00	0.06
70	002460	赣锋锂业	1,800	117,720.00	0.06
71	000034	神州数码	4,200	116,550.00	0.06
72	688676	金盘科技	1,363	115,364.32	0.06
73	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.06
74	300779	惠城环保	2,280	114,456.00	0.06
75	300765	石药创新	4,200	114,366.00	0.06
76	002151	北斗星通	3,600	114,300.00	0.06
77	002320	海峡股份	18,200	114,114.00	0.06

78	003816	中国广核	28,800	112,608.00	0.06
79	601399	国机重装	31,900	111,650.00	0.06
80	601155	新城控股	10,200	104,652.00	0.06
81	300418	昆仑万维	2,500	100,900.00	0.05
82	000603	盛达资源	4,300	99,330.00	0.05
83	688301	奕瑞科技	800	99,200.00	0.05
84	000967	盈峰环境	9,300	97,929.00	0.05
85	002131	利欧股份	19,800	94,050.00	0.05
85	300129	泰胜风能	11,000	94,050.00	0.05
86	601061	中信金属	8,600	92,622.00	0.05
87	002062	宏润建设	12,700	90,932.00	0.05
88	000807	云铝股份	4,100	90,774.00	0.05
89	002815	崇达技术	5,400	89,586.00	0.05
90	000848	承德露露	11,600	85,840.00	0.05
91	600483	福能股份	8,300	84,577.00	0.05
92	301358	湖南裕能	1,100	83,457.00	0.04
93	300548	长芯博创	300	83,400.00	0.04
94	603699	纽威股份	1,600	80,480.00	0.04
95	300395	菲利华	600	80,238.00	0.04
96	600489	中金黄金	4,400	79,420.00	0.04
97	002392	北京利尔	9,800	79,086.00	0.04
98	300255	常山药业	3,300	77,286.00	0.04
99	002532	天山铝业	7,200	77,256.00	0.04
100	300244	迪安诊断	4,100	76,834.00	0.04
101	300170	汉得信息	4,900	74,676.00	0.04
102	601069	西部黄金	3,300	72,600.00	0.04
103	002080	中材科技	800	72,000.00	0.04
104	000703	恒逸石化	5,200	70,564.00	0.04
105	600989	宝丰能源	3,400	69,122.00	0.04
106	300604	长川科技	200	68,284.00	0.04
107	002558	巨人网络	2,400	66,144.00	0.04
108	300390	天华新能	700	65,457.00	0.04
109	000338	潍柴动力	2,400	65,400.00	0.04
110	300628	亿联网络	1,900	64,258.00	0.03
111	601985	中国核电	7,000	63,210.00	0.03
112	601997	贵阳银行	12,200	62,586.00	0.03
113	301500	飞南资源	2,400	62,520.00	0.03
114	301087	可孚医疗	1,300	61,945.00	0.03
115	300252	金信诺	3,500	60,375.00	0.03
116	002079	苏州固锝	4,000	60,120.00	0.03
117	600206	有研新材	900	59,940.00	0.03
118	301510	固高科技	1,800	57,474.00	0.03
119	002850	科达利	300	56,790.00	0.03

120	300986	志特新材	3,300	56,595.00	0.03
121	000553	安道麦 A	10,500	56,175.00	0.03
122	601988	中国银行	9,800	56,056.00	0.03
123	002716	湖南白银	6,900	55,821.00	0.03
124	002414	高德红外	4,200	55,692.00	0.03
125	301285	鸿日达	500	55,165.00	0.03
126	301580	爱迪特	840	54,037.20	0.03
127	000776	广发证券	2,300	53,820.00	0.03
128	601009	南京银行	5,400	53,406.00	0.03
129	601166	兴业银行	3,200	52,992.00	0.03
130	603369	今世缘	2,200	52,162.00	0.03
131	002709	天赐材料	1,000	51,430.00	0.03
132	301086	鸿富瀚	240	50,227.20	0.03
133	002518	科士达	900	48,231.00	0.03
134	601939	建设银行	5,000	48,150.00	0.03
135	600299	安迪苏	6,100	47,885.00	0.03
136	603906	龙蟠科技	1,800	47,754.00	0.03
137	002157	正邦科技	16,800	47,208.00	0.03
138	002738	中矿资源	800	47,192.00	0.03
139	300102	乾照光电	1,800	46,872.00	0.03
140	601916	浙商银行	17,600	46,288.00	0.02
141	600030	中信证券	1,600	45,968.00	0.02
142	002304	洋河股份	1,200	45,780.00	0.02
143	601601	中国太保	1,600	45,632.00	0.02
144	002001	新 和 成	1,600	45,472.00	0.02
145	002635	安洁科技	2,200	44,990.00	0.02
146	002192	融捷股份	500	44,700.00	0.02
147	300133	华策影视	6,300	44,604.00	0.02
148	600346	恒力石化	2,500	44,275.00	0.02
149	603297	永新光学	300	44,085.00	0.02
150	300409	道氏技术	2,200	43,846.00	0.02
151	688390	固德威	400	43,404.00	0.02
152	600026	中远海能	2,400	43,056.00	0.02
153	688400	凌云光	648	42,897.60	0.02
154	603638	艾迪精密	1,800	42,210.00	0.02
155	300492	华图山鼎	1,200	41,220.00	0.02
156	300516	久之洋	1,240	40,622.40	0.02
157	688652	京仪装备	200	40,034.00	0.02
158	000596	古井贡酒	500	39,900.00	0.02
159	688110	东芯股份	192	39,110.40	0.02
160	002422	科伦药业	1,000	38,520.00	0.02
161	688195	腾景科技	200	38,516.00	0.02
162	688166	博瑞医药	1,100	38,511.00	0.02

163	605598	上海港湾	1,000	38,430.00	0.02
164	600089	特变电工	1,700	38,250.00	0.02
165	000933	神火股份	1,800	38,160.00	0.02
166	600821	金开新能	6,100	38,125.00	0.02
167	000521	长虹美菱	7,000	38,010.00	0.02
168	601319	中国人保	5,600	37,856.00	0.02
169	601127	赛力斯	600	36,750.00	0.02
170	300059	东方财富	1,800	36,684.00	0.02
171	000426	兴业银锡	1,100	36,256.00	0.02
172	002539	云图控股	3,200	36,224.00	0.02
173	603026	石大胜华	400	35,748.00	0.02
174	002245	蔚蓝锂芯	1,900	35,549.00	0.02
175	002379	宏桥控股	2,400	35,448.00	0.02
176	301061	匠心家居	1,000	35,070.00	0.02
177	300296	利亚德	6,200	34,720.00	0.02
178	002028	思源电气	200	34,600.00	0.02
179	000039	中集集团	4,200	34,062.00	0.02
180	688678	福立旺	1,400	33,838.00	0.02
181	600150	中国船舶	1,000	33,790.00	0.02
182	688709	成都华微	885	33,709.65	0.02
183	300806	斯迪克	300	33,600.00	0.02
184	301248	杰创智能	400	33,572.00	0.02
185	601800	中国交建	5,700	32,547.00	0.02
186	000975	山金国际	1,900	32,300.00	0.02
187	688122	西部超导	503	31,593.43	0.02
188	300681	英搏尔	1,100	31,482.00	0.02
189	002154	报喜鸟	8,800	31,328.00	0.02
190	000690	宝新能源	6,600	31,020.00	0.02
191	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.02
192	601921	浙版传媒	4,600	30,774.00	0.02
193	002466	天齐锂业	500	30,660.00	0.02
194	603127	昭衍新药	800	30,576.00	0.02
195	601336	新华保险	500	29,830.00	0.02
196	600703	三安光电	1,400	29,708.00	0.02
197	688127	蓝特光学	300	29,280.00	0.02
198	688119	中钢洛耐	6,052	28,747.00	0.02
199	002202	金风科技	1,200	28,680.00	0.02
200	301219	腾远钴业	520	28,496.00	0.02
201	002475	立讯精密	400	28,160.00	0.02
202	301257	普蕊斯	600	27,228.00	0.01
203	000001	平安银行	2,700	27,135.00	0.01
204	301093	华兰股份	200	27,126.00	0.01
205	688800	瑞可达	280	26,871.60	0.01

206	688531	日联科技	151	26,853.84	0.01
207	002929	润建股份	400	26,752.00	0.01
208	300769	德方纳米	400	26,600.00	0.01
209	688183	生益电子	200	26,480.00	0.01
210	601872	招商轮船	1,500	26,355.00	0.01
211	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.01
212	688275	万润新能	200	25,510.00	0.01
213	002544	普天科技	1,400	25,508.00	0.01
214	002506	协鑫集成	8,000	25,440.00	0.01
215	600016	民生银行	7,900	25,438.00	0.01
216	300905	宝丽迪	500	25,300.00	0.01
217	300201	海伦哲	1,200	25,284.00	0.01
218	002788	鹭燕医药	2,500	25,075.00	0.01
219	000066	中国长城	1,300	24,765.00	0.01
220	300214	日科化学	2,400	24,600.00	0.01
221	002478	常宝股份	3,900	24,102.00	0.01
222	300613	富瀚微	300	24,024.00	0.01
223	301292	海科新源	300	23,919.00	0.01
224	300136	信维通信	200	23,850.00	0.01
225	600841	动力新科	3,900	23,790.00	0.01
226	300291	百纳千成	4,900	23,667.00	0.01
227	300711	广哈通信	1,400	22,960.00	0.01
228	688516	奥特维	400	22,956.00	0.01
229	601668	中国建筑	5,200	22,568.00	0.01
230	601963	重庆银行	2,200	22,176.00	0.01
231	000029	深深房 A	1,000	22,050.00	0.01
232	600809	山西汾酒	200	21,874.00	0.01
233	603568	伟明环保	1,420	21,839.60	0.01
234	603985	恒润股份	900	21,618.00	0.01
235	300749	顶固集创	800	21,480.00	0.01
236	300773	拉卡拉	1,400	21,420.00	0.01
237	000901	航天科技	1,200	21,348.00	0.01
238	600509	天富能源	2,500	21,125.00	0.01
239	300781	因赛集团	800	21,088.00	0.01
240	300696	爱乐达	800	20,824.00	0.01
241	688633	星球石墨	700	20,811.00	0.01
242	605168	三人行	400	20,256.00	0.01
243	301056	森赫股份	1,800	20,160.00	0.01
244	000533	顺钠股份	2,100	19,971.00	0.01
245	300890	翔丰华	600	19,902.00	0.01
246	603162	海通发展	2,200	19,734.00	0.01
247	688360	德马科技	1,100	19,690.00	0.01
248	002759	ST 天际	800	19,512.00	0.01

249	002582	好想你	2,300	19,435.00	0.01
250	301293	三博脑科	400	19,272.00	0.01
251	000534	万泽股份	700	19,152.00	0.01
252	300111	向日葵	6,600	19,008.00	0.01
253	300887	谱尼测试	2,700	18,792.00	0.01
254	605222	起帆电缆	800	18,656.00	0.01
255	000906	浙商中拓	3,700	18,648.00	0.01
256	300071	福石控股	5,300	18,550.00	0.01
257	688472	阿特斯	1,700	18,394.00	0.01
258	300139	晓程科技	500	18,275.00	0.01
259	601857	中国石油	2,100	18,228.00	0.01
260	002255	海陆重工	1,800	17,676.00	0.01
261	002342	巨力索具	1,600	16,816.00	0.01
262	300970	华绿生物	910	16,634.80	0.01
263	002340	格林美	2,500	16,525.00	0.01
264	300279	和晶科技	2,700	16,335.00	0.01
265	301025	读客文化	2,100	16,296.00	0.01
266	001359	平安电工	130	16,282.50	0.01
267	000818	航锦科技	1,100	15,972.00	0.01
268	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.01
269	688653	康希通信	900	15,642.00	0.01
270	000568	泸州老窖	200	15,504.00	0.01
271	300687	赛意信息	500	15,500.00	0.01
272	000430	张家界	2,100	15,330.00	0.01
273	600338	西藏珠峰	1,000	15,240.00	0.01
274	002134	天津普林	500	15,210.00	0.01
274	002347	泰尔股份	2,600	15,210.00	0.01
275	002461	珠江啤酒	2,000	15,140.00	0.01
276	002455	百川股份	2,100	15,120.00	0.01
277	300785	值得买	400	14,668.00	0.01
278	301136	招标股份	1,300	14,274.00	0.01
279	603122	合富中国	1,300	14,248.00	0.01
280	600410	华胜天成	900	14,247.00	0.01
281	300086	康芝药业	2,400	14,160.00	0.01
282	688307	中润光学	175	13,991.25	0.01
283	000408	藏格矿业	200	13,864.00	0.01
284	300505	川金诺	600	13,770.00	0.01
285	603066	音飞储存	1,400	13,664.00	0.01
286	301077	星华新材	600	13,548.00	0.01
287	300149	睿智医药	1,400	13,356.00	0.01
288	002702	海欣食品	3,000	13,350.00	0.01
289	300124	汇川技术	200	13,266.00	0.01
290	301396	宏景科技	40	13,264.00	0.01

291	300775	三角防务	600	13,224.00	0.01
292	300969	恒帅股份	140	13,126.40	0.01
293	300063	天龙集团	1,500	13,020.00	0.01
294	300792	壹网壹创	500	12,970.00	0.01
295	301397	溯联股份	400	12,944.00	0.01
296	600027	华电国际	2,900	12,905.00	0.01
297	600685	中船防务	500	12,720.00	0.01
298	002632	道明光学	1,400	12,614.00	0.01
299	600012	皖通高速	800	12,608.00	0.01
300	000301	东方盛虹	1,100	12,595.00	0.01
301	300157	新锦动力	3,400	12,546.00	0.01
302	002429	兆驰股份	1,200	12,468.00	0.01
303	600916	中国黄金	1,800	12,312.00	0.01
304	600790	轻纺城	3,700	12,099.00	0.01
305	300432	富临精工	600	12,054.00	0.01
306	600875	东方电气	400	11,508.00	0.01
307	000547	航天发展	600	11,490.00	0.01
308	002338	奥普光电	200	11,440.00	0.01
309	002264	新华都	2,000	11,280.00	0.01
310	300987	川网传媒	900	11,070.00	0.01
311	000415	渤海租赁	2,700	10,989.00	0.01
312	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.01
313	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.01
314	300227	光韵达	900	10,710.00	0.01
315	688580	伟思医疗	200	10,654.00	0.01
316	300270	中威电子	800	10,408.00	0.01
317	301256	华融化学	800	10,368.00	0.01
318	002173	创新医疗	600	9,828.00	0.01
319	000890	法尔胜	1,200	9,672.00	0.01
320	600801	华新建材	600	9,360.00	0.01
321	688221	前沿生物	400	8,960.00	0.00
322	688626	翔宇医疗	200	8,852.00	0.00
323	300745	欣锐科技	200	8,444.00	0.00
324	603130	云中马	200	8,350.00	0.00
325	603216	梦天家居	400	8,228.00	0.00
326	603283	赛腾股份	100	8,098.00	0.00
327	300427	红相股份	1,200	8,052.00	0.00
328	688173	希荻微	400	7,656.00	0.00
329	002025	航天电器	100	7,622.00	0.00
330	000333	美的集团	100	7,553.00	0.00
331	001255	博菲电气	300	7,527.00	0.00
332	002493	荣盛石化	700	7,525.00	0.00
333	300204	舒泰神	300	7,134.00	0.00

334	301169	零点有数	100	7,066.00	0.00
335	002602	世纪华通	500	7,050.00	0.00
336	300916	朗特智能	300	7,011.00	0.00
337	301213	观想科技	140	6,879.60	0.00
338	300658	延江股份	600	6,858.00	0.00
339	603726	朗迪集团	200	6,850.00	0.00
339	605599	莱百股份	500	6,850.00	0.00
340	002244	滨江集团	900	6,840.00	0.00
341	300780	德恩精工	200	6,812.00	0.00
342	605258	协和电子	200	6,776.00	0.00
343	301260	格力博	500	6,755.00	0.00
344	600103	青山纸业	2,200	6,754.00	0.00
345	300434	金石亚药	600	6,738.00	0.00
346	300518	新迅达	200	6,610.00	0.00
347	300351	永贵电器	400	6,600.00	0.00
348	300911	亿田智能	300	6,375.00	0.00
349	300424	航新科技	400	6,296.00	0.00
350	300736	百邦科技	200	6,200.00	0.00
351	301085	亚康股份	100	6,061.00	0.00
352	300422	博世科	1,400	5,894.00	0.00
353	300013	新宁物流	1,500	5,850.00	0.00
354	301159	三维天地	200	5,820.00	0.00
355	601600	中国铝业	700	5,754.00	0.00
356	002284	亚太股份	600	5,694.00	0.00
357	002837	英维克	70	5,569.20	0.00
358	300740	水羊股份	300	5,523.00	0.00
359	605580	恒盛能源	200	5,522.00	0.00
360	300300	海峡创新	700	5,467.00	0.00
361	301029	怡合达	200	5,402.00	0.00
362	301246	宏源药业	200	5,380.00	0.00
363	002793	罗欣药业	1,400	5,376.00	0.00
364	300490	华自科技	400	5,292.00	0.00
365	600400	红豆股份	1,600	5,264.00	0.00
366	300182	捷成股份	1,100	5,225.00	0.00
367	002465	海格通信	400	5,108.00	0.00
368	000708	中信特钢	400	5,048.00	0.00
369	000061	农产品	900	5,040.00	0.00
370	002397	梦洁股份	1,300	4,966.00	0.00
371	301517	陕西华达	100	4,963.00	0.00
372	603156	养元饮品	100	4,907.00	0.00
373	601727	上海电气	700	4,900.00	0.00
374	300073	当升科技	100	4,804.00	0.00
375	300837	浙矿股份	200	4,752.00	0.00

376	000506	招金黄金	400	4,688.00	0.00
377	600547	山东黄金	200	4,618.00	0.00
378	001316	润贝航科	140	4,617.20	0.00
379	300552	万集科技	200	4,570.00	0.00
380	688577	浙海德曼	95	4,353.85	0.00
381	300846	首都在线	200	4,242.00	0.00
382	301636	泽润新能	100	4,211.00	0.00
383	301035	润丰股份	90	4,176.00	0.00
384	600865	百大集团	500	4,095.00	0.00
385	601225	陕西煤业	200	4,070.00	0.00
386	002176	江特电机	400	4,004.00	0.00
387	002797	第一创业	600	3,942.00	0.00
388	300499	高澜股份	100	3,870.00	0.00
389	688768	容知日新	75	3,865.50	0.00
390	301133	金钟股份	100	3,820.00	0.00
391	601825	沪农商行	500	3,745.00	0.00
392	301230	泓博医药	100	3,684.00	0.00
393	688566	吉贝尔	142	3,633.78	0.00
394	300991	创益通	100	3,521.00	0.00
395	600058	五矿发展	300	3,465.00	0.00
396	601665	齐鲁银行	600	3,462.00	0.00
397	301079	邵阳液压	100	3,364.00	0.00
398	600961	株冶集团	100	3,239.00	0.00
399	002332	仙琚制药	400	3,224.00	0.00
400	300165	天瑞仪器	600	3,162.00	0.00
401	001289	龙源电力	200	3,126.00	0.00
402	301171	易点天下	90	3,056.40	0.00
403	603000	人民网	200	2,958.00	0.00
404	601666	平煤股份	400	2,860.00	0.00
405	300756	金马游乐	80	2,644.00	0.00
406	002803	吉宏股份	100	2,584.00	0.00
407	001979	招商蛇口	400	2,572.00	0.00
408	000823	超声电子	100	2,565.00	0.00
409	002439	启明星辰	200	2,530.00	0.00
410	603195	公牛集团	63	2,466.45	0.00
411	301259	艾布鲁	90	2,362.50	0.00
412	603296	华勤技术	31	2,302.37	0.00
413	603696	安记食品	200	2,300.00	0.00
414	601233	桐昆股份	100	2,165.00	0.00
415	601880	辽港股份	1,500	2,070.00	0.00
416	300840	酷特智能	100	2,063.00	0.00
417	600739	辽宁成大	200	2,022.00	0.00
418	002998	优彩资源	300	1,953.00	0.00

419	600877	电科芯片	100	1,713.00	0.00
420	600722	金牛化工	200	1,624.00	0.00
421	601298	青岛港	200	1,610.00	0.00
422	002361	神剑股份	100	1,505.00	0.00
423	300402	宝色股份	100	1,481.00	0.00
424	300590	移为通信	100	1,435.00	0.00
425	301535	浙江华远	100	1,342.00	0.00
426	600352	浙江龙盛	100	1,211.00	0.00
427	300876	蒙泰高新	80	1,146.40	0.00
428	601222	林洋能源	200	1,064.00	0.00
429	301162	国能日新	20	875.00	0.00
430	600970	中材国际	100	713.00	0.00
431	000800	一汽解放	100	595.00	0.00
432	300128	锦富技术	100	592.00	0.00
433	600023	浙能电力	100	526.00	0.00
434	300639	凯普生物	100	497.00	0.00
435	601128	常熟银行	83	483.06	0.00
436	300569	天能重工	100	482.00	0.00
437	300664	鹏鹞环保	100	424.00	0.00
438	301179	泽宇智能	20	409.20	0.00
439	301339	通行宝	20	204.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	2,306,423.08	0.51
2	03858	佳鑫国际资源	1,319,762.33	0.29
3	300136	信维通信	1,086,589.00	0.24
4	600660	福耀玻璃	1,048,294.00	0.23
5	000831	中国稀土	874,795.00	0.19
6	600988	赤峰黄金	821,049.00	0.18
7	688702	盛科通信	815,302.30	0.18
8	688385	复旦微电	804,992.51	0.18
9	300919	中伟新材	790,562.00	0.17
10	000933	神火股份	774,726.00	0.17
11	688120	华海清科	763,948.48	0.17
12	300274	阳光电源	758,277.00	0.17
13	300017	网宿科技	755,931.00	0.17
14	300604	长川科技	753,534.00	0.17
15	600118	中国卫星	718,815.00	0.16
16	600601	方正科技	712,020.00	0.16

17	002008	大族激光	696,761.00	0.15
18	300223	北京君正	695,801.00	0.15
19	688099	晶晨股份	689,938.04	0.15
20	601615	明阳智能	667,313.00	0.15

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	00700	腾讯控股	5,997,780.05	1.32
2	01818	招金矿业	5,533,918.34	1.22
3	00388	香港交易所	3,796,550.90	0.83
4	01398	工商银行	1,732,525.06	0.38
4	601398	工商银行	1,484,718.00	0.33
5	601988	中国银行	1,502,398.00	0.33
5	03988	中国银行	879,825.41	0.19
6	00939	建设银行	1,019,584.65	0.22
6	601939	XD 建设银	775,851.00	0.17
7	600900	长江电力	1,511,204.00	0.33
8	09988	阿里巴巴-W	1,505,297.50	0.33
9	600660	福耀玻璃	1,435,955.40	0.32
10	300750	宁德时代	1,419,283.00	0.31
11	300604	长川科技	1,319,269.00	0.29
12	601318	中国平安	1,161,365.00	0.26
13	601899	紫金矿业	1,060,600.00	0.23
14	300136	信维通信	1,058,502.00	0.23
15	00941	中国移动	1,012,508.75	0.22
16	601328	交通银行	935,629.00	0.21
17	603259	药明康德	914,789.00	0.20
18	000831	中国稀土	908,866.00	0.20
19	01288	农业银行	740,977.96	0.16
19	601288	农业银行	157,667.00	0.03
20	601958	金钼股份	851,495.00	0.19

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	129,174,330.21
卖出股票收入（成交）总额	183,747,009.01

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	47,281,675.31	25.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	102,302,139.72	55.07
	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）	5,275.16	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,589,090.19	80.53

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

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	019761	24 国债 24	117,000	11,764,936.60	6.33
2	242400020	24 交行永续 债 01BC	100,000	10,376,761.64	5.59
3	232580035	25 农行二级 资本债 03A(BC)	100,000	10,315,175.34	5.55
4	242580054	25 平安银行 永续债 02BC	100,000	10,297,885.48	5.54
5	232480010	24 浙商银行 二级资本债 01	100,000	10,285,640.00	5.54

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

本基金投资于国债期货，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的

久期、流动性和风险水平。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金国债期货投资情况符合既定的投资政策和投资目的。

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

本报告期本基金投资的前十名证券除交通银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、招商银行股份有限公司发行主体外，其他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。

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	672,340.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	5,440.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	479.78
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	678,259.86

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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 (%)
长城智盈 添益债券 发起式 A	82	1,400,698.67	112,199,677.14	97.69	2,657,614.06	2.31
长城智盈 添益债券 发起式 C	614	91,709.63	-	-	56,309,714.02	100.00
合计	696	245,929.61	112,199,677.14	65.55	58,967,328.08	34.45

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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	长城智盈添益债券发起式 A	49,898.71	0.0434
	长城智盈添益债券发起式 C	-	-
	合计	49,898.71	0.0292

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 C	0
	合计	0~10

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,889.08	5.84	10,001,889.08	5.84	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,001,889.08	5.84	10,001,889.08	5.84	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日（2023 年 12 月 26 日）基金份额总额	10,064,129.80	48,338.63

本报告期期初基金份额总额	137,865,501.43	287,448,861.32
本报告期基金总申购份额	74,837,124.98	25,148,881.05
减：本报告期基金总赎回份额	97,845,335.21	256,288,028.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	114,857,291.20	56,309,714.02

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动：

（1）自 2026 年 3 月 25 日起，邱春杨不再担任公司总经理，聘任祝函为公司总经理，同时解聘其公司督察长职务。在公司新任督察长正式任职之前，由祝函代为履行公司督察长职务。

（2）自 2026 年 6 月 23 日起，李建军正式任职公司督察长，祝函不再代为履行督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

注：本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无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

注：本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无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 (%)	
长城证券	2	312,921,339.22	100.00	75,820.07	100.00	未变更

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
- (4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服

(5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

- (1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券库；
- (2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；
- (3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

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(%)
长城证券	146,463,843.36	100.00	32,600,000.00	100.00	-	-

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	长城基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 27 日
2	长城基金管理有限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）	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 30 日
3	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 6 月 24 日
4	长城基金管理有限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	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		20%的时间区 间					
机构	1	20260310- 20260311, 20 260320- 20260513	-	64, 718, 010. 36	64, 718, 010. 36	-	-
	2	20260101- 20260630	91, 381, 705. 20	-	-	91, 381 , 705. 2 0	53. 387 5
产品特有风险							
如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险： 1、流动性风险 本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险； 2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险 若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 3、基金净值波动风险 大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动； 4、投资受限风险 大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； 5、基金合同终止或转型风险 大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予长城智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的文件
- （二）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金基金合同》
- （三）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金托管协议》
- （四）《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- （五） 法律意见书
- （六） 基金管理人业务资格批件、营业执照

(七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(八) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日