

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	37

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	50
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	50
7.11 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金
基金简称	长信标普 100 等权重指数（QDII）
场内简称	长信标普 100
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 30 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	665,997,320.79 份
基金合同存续期	不定期

注：1、本基金另设美元份额，基金代码 011706，与人民币份额并表披露；

2、截止本报告期末，本基金人民币份额净值 2.574 元，人民币总份额 645,641,373.38 份；

本基金美元份额净值 0.378 美元，美元总份额 20,355,947.41 份。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔 100 等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普 100 等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50%以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94%以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于 80%的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔 100 等权重指数总收益率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	许俊
	联系电话	021-61009999	010-66596688
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	4007005566	95566
传真	021-61009800	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	肖剑	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	—	Bank Of China (Hong Kong) Limited
	中文	—	中国银行（香港）有限公司
注册地址		—	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		—	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		—	—

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	34,234,449.81
本期利润	100,226,551.36
加权平均基金份额本期利润	0.2675
本期加权平均净值利润率	11.06%
本期基金份额净值增长率	10.05%
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	479,768,647.38
期末可供分配基金份额利润	0.7204
期末基金资产净值	1,714,015,019.87

期末基金份额净值	2.574
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	314.23%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

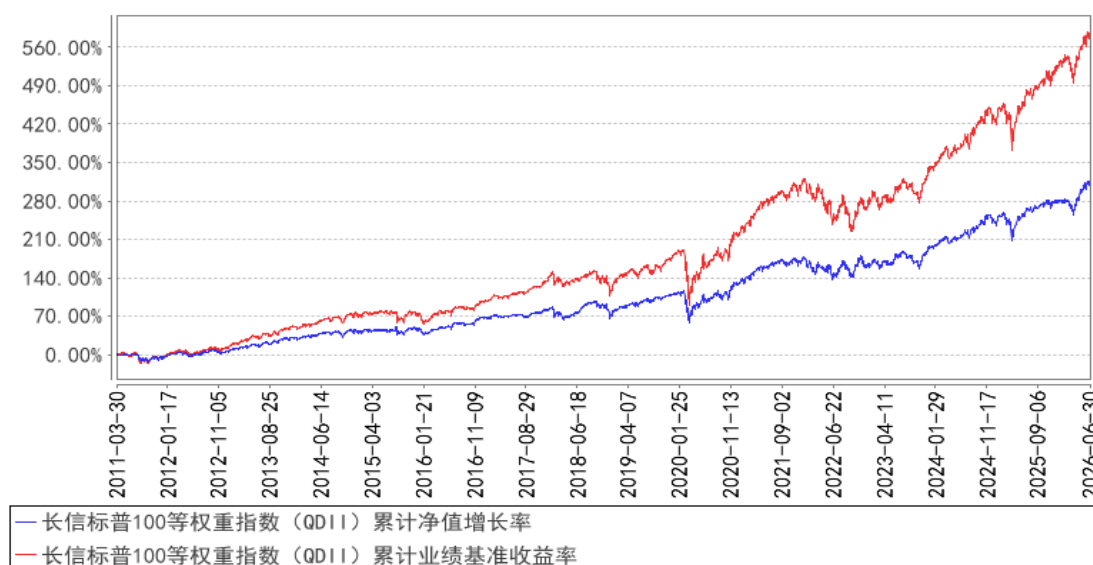
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	14.30%	0.88%	12.55%	0.74%	1.75%	0.14%
过去六个月	10.05%	0.80%	10.33%	0.76%	-0.28%	0.04%
过去一年	14.81%	0.66%	19.73%	0.68%	-4.92%	-0.02%
过去三年	47.59%	0.77%	69.01%	0.84%	-21.42%	-0.07%
过去五年	57.05%	0.89%	79.02%	0.96%	-21.97%	-0.07%
过去七年	110.29%	1.04%	167.59%	1.22%	-57.30%	-0.18%
过去十年	172.58%	0.95%	282.32%	1.10%	-109.74%	-0.15%
自基金合同生效起至今	314.23%	0.92%	584.88%	1.08%	-270.65%	-0.16%

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

长信标普100等权重指数（QDII）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、图示日期为 2011 年 3 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
傅瑶纯	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理、国际业务部总监	2020 年 1 月 2 日	-	11 年	华威大学金融与经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于中国农业银行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

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

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年的海外市场如果不考虑战争的影响因素，整体市场的风险偏好仍然是较好的。美国经济持续表现出韧性，一方面 AI 的进展继续在超市场预期，新的叙事给了市场新的想象空间；一方面大美丽法案的落地也给予了消费一定支撑，叠加去年以来连续的降息，整体宏观环境在进入六月之前仍然相对友好。

虽然战争的发生打破了市场前期较好的情绪，但随着战事逐步进入到后期，市场因战争的影响开始减小，即使战事有所反复，市场也显得逐渐脱敏，重新开始回归相关基本面数据。而进入到 6 月份，AI 的叙事开始出现裂痕，一些杠杆问题开始滋生，而新任联储主席的行事风格也使得市场对于未来预期的方差开始扩大，对于未来的不确定性开始显著提升。种种因素叠加下导致权益市场开始出现高位盘整。

但相较前期涨幅而言，单月的调整仍显得比较有限。最终上半年具体指数方面，标普 500 指数、纳斯达克指数以及道琼斯指数分别上涨 9.55%，12.79% 和 8.85%，由于 AI 仍是市场关注的焦点，纳指的表现继续优于其他股指。

组合层面，考虑到市场风险犹存，整体仓位仍然维持中性。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，长信标普 100 等权重指数（QDII）人民币份额净值为 2.574 元，份额累计净值为 3.091 元，长信标普 100 等权重指数（QDII）美元份额净值为 0.378 美元，份额累计净值为 0.378 美元。本报告期内长信标普 100 等权重指数（QDII）净值增长率为 10.05%，同期业绩比较基准收益率为 10.33%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，地缘的扰动或将继续逐步淡化，AI 的叙事逻辑长期看仍具有较大潜力，但短期结合当前宏观背景或有调整风险。考虑到整体软着陆的背景以及下半年面临的中期选举等因素，市场出现巨幅调整的可能性仍然较小，因此回调或将会带来配置机会，我们将及时调整组合比例以应对市场变化。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完

全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重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	57,973,824.73	26,952,651.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,699,359,335.14	427,189,445.34
其中：股票投资		1,473,275,856.70	395,819,466.70
基金投资		-	1,204,033.44
债券投资		226,083,478.44	30,165,945.20
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		985,469.96	303,627.37
应收申购款		23,545,512.83	16,364,212.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,781,864,142.66	470,809,937.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		29,770,165.06	-
应付赎回款		36,215,024.63	4,820,110.22
应付管理人报酬		1,299,676.55	334,792.40
应付托管费		236,304.84	60,871.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,498.18	739.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	325,453.53	361,788.16
负债合计		67,849,122.79	5,578,302.01
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	665,997,320.79	198,880,916.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,048,017,699.08	266,350,718.77
净资产合计		1,714,015,019.87	465,231,635.09
负债和净资产总计		1,781,864,142.66	470,809,937.10

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，长信标普 100（QDII）人民币份额净值 2.574 元，长信标普 100（QDII）美元份额净值 0.378 美元，基金份额总额为 665,997,320.79 份，其中长信标普 100（QDII）人民币份额 645,641,373.38 份，长信标普 100（QDII）美元份额 20,355,947.41 份。

6.2 利润表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、营业总收入		106,157,597.17	13,669,425.19
1. 利息收入		46,747.33	21,551.21
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,747.33	21,551.21
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）		37,294,550.61	4,169,847.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	33,007,678.45	2,250,391.77
基金投资收益	6.4.7.15	-1,622,479.20	399,941.74
债券投资收益	6.4.7.16	-297,689.16	200,841.52
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	6,207,040.52	1,318,672.51
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）	6.4.7.21	65,992,101.55	10,620,703.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		2,415,682.53	-1,260,238.69
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	408,515.15	117,561.51
减：二、营业总支出		5,931,045.81	1,281,971.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,882,282.66	918,564.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	887,687.69	182,094.32
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产			
支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		967.24	1,443.15
8. 其他费用	6.4.7.24	160,108.22	179,870.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		100,226,551.36	12,387,453.63

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		100,226,551.36	12,387,453.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		100,226,551.36	12,387,453.63

6.3 净资产变动表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	198,880,916.32	-	266,350,718.77	465,231,635.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	198,880,916.32	-	266,350,718.77	465,231,635.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	467,116,404.47	-	781,666,980.31	1,248,783,384.78
（一）、综合收益总额	-	-	100,226,551.36	100,226,551.36
（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）	467,116,404.47	-	681,440,428.95	1,148,556,833.42
其中：1. 基金申购款	589,810,842.85	-	855,890,557.62	1,445,701,400.47
2. 基金赎回款	-122,694,438.38	-	-174,450,128.67	-297,144,567.05
（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	665,997,320.79	-	1,048,017,699.08	1,714,015,019.87
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	54,612,651.57	-	60,982,082.85	115,594,734.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,612,651.57	-	60,982,082.85	115,594,734.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	44,958,275.87	-	62,707,258.27	107,665,534.14
(一)、综合收益总额	-	-	12,387,453.63	12,387,453.63
(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)	44,958,275.87	-	50,319,804.64	95,278,080.51
其中：1. 基金申购款	88,462,119.78	-	99,109,224.05	187,571,343.83
2. 基金赎回款	-43,503,843.91	-	-48,789,419.41	-92,293,263.32
(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	99,570,927.44	-	123,689,341.12	223,260,268.56
-----------	---------------	---	----------------	----------------

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>肖剑</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</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

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（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〔2010〕1586 号文《关于核准长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 3 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 508,424,713.40 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

根据基金管理人于 2021 年 6 月 29 日发布的《关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金增设美元类基金份额相关事项的公告》，自 2021 年 7 月 1 日起对本基金进行份额分类，原有基金份额归为人民币类基金份额，同时增设美元类基金份额。

本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，且以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，且以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元份额。

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；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。

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值

的 80%-95%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《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发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间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[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《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；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

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。

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加；

基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按

照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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	57,973,824.73
等于：本金	57,969,472.04
加：应计利息	4,352.69
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	57,973,824.73

注：截止至 2026 年 6 月 30 日，活期存款中人民币活期存款本金为人民币 27,056,234.38 元，应计利息为人民币 4,336.28 元；外币活期存款本金折合人民币 30,913,237.66 元，应计利息折合人民币 16.41 元。

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		1,380,584,237.64	-	1,473,275,856.70	92,691,619.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	65,543,068.49	-	65,496,141.45	-46,927.04
	银行间市场	159,936,415.00	577,336.99	160,587,336.99	73,585.00
	合计	225,479,483.49	577,336.99	226,083,478.44	26,657.96
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	1,606,063,721.13	577,336.99	1,699,359,335.14	92,718,277.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	130,493.38
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,200.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,200.00
应付利息	-
预提账户维护费	4,500.00
预提审计费	29,752.78

预提信息披露费	159,507.37
合计	325,453.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	198,880,916.32	198,880,916.32
本期申购	589,810,842.85	589,810,842.85
本期赎回（以“-”号填列）	-122,694,438.38	-122,694,438.38
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	665,997,320.79	665,997,320.79

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	131,645,739.20	134,704,979.57	266,350,718.77
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	131,645,739.20	134,704,979.57	266,350,718.77
本期利润	34,234,449.81	65,992,101.55	100,226,551.36
本期基金份额交易产生的变动数	313,888,458.37	367,551,970.58	681,440,428.95
其中：基金申购款	396,107,831.87	459,782,725.75	855,890,557.62
基金赎回款	-82,219,373.50	-92,230,755.17	-174,450,128.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	479,768,647.38	568,249,051.70	1,048,017,699.08

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	31,440.27
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	-
其他	15,307.06
合计	46,747.33

注：其他为申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	187,127,940.51
减：卖出股票成本总额	153,953,717.11
减：交易费用	166,544.95
买卖股票差价收入	33,007,678.45

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,519,534.15
减：卖出/赎回基金成本总额	3,138,908.03
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	3,105.32
基金投资收益	-1,622,479.20

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 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	306,969.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-604,658.98
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	-297,689.16

6.4.7.16.2 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	380,646,714.29

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	381,062,286.28
减：应计利息总额	187,136.99
减：交易费用	1,950.00
买卖债券差价收入	-604,658.98

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.20 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	6,207,040.52
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	6,207,040.52

6.4.7.21 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	65,992,101.55
股票投资	64,046,109.00
债券投资	11,117.96
资产支持证券投资	-
基金投资	1,934,874.59

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	65,992,101.55

6.4.7.22 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	408,515.15
合计	408,515.15

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对其他投资者收取的赎回费用的 25%应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

6.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.24 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	61,848.07
合计	160,108.22

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,882,282.66	918,564.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,755,165.77	382,124.44
应支付基金管理人的净管理费	3,127,116.89	536,439.61

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。

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	887, 687. 69	182, 094. 32

注：1、根据《长信基金管理有限责任公司关于调整长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管费率并修改基金合同等事宜的公告》，自 2025 年 2 月 14 日起，本基金的基金托管费由 0.30%年费率调整为 0.20%年费率。

2、计算方法如下：

$$H=E\times \text{基金托管费年费率}/\text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提, 逐日累计至每月月末, 按月支付。

6. 4. 10. 3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6. 4. 10. 4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6. 4. 10. 4. 1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6. 4. 10. 4. 2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6. 4. 10. 5 各关联方投资本基金的情况

6. 4. 10. 5. 1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6. 4. 10. 5. 2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	27,986,405.24	31,440.27	10,697,278.56	21,548.87
中银香港	29,987,419.49	-	10,021,895.61	-

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司以及基金境外次托管人中国银行（香港）有限公司，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	65,496,141.45	-
A-1 以下	-	-
未评级	160,587,336.99	30,165,945.20
合计	226,083,478.44	30,165,945.20

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券以及标准普尔、惠誉和穆迪评级均为未评级的海外债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动,所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易,并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
货币资金	57,973,824.73	-	-	-	-	57,973,824.73
交易性金融 资产	85,707,988.03	140,375,490.41	-	-	1,473,275,856.70	1,699,359,335.14
应收股利	-	-	-	-	985,469.96	985,469.96
应收申购款	-	-	-	-	23,545,512.83	23,545,512.83
资产总计	143,681,812.76	140,375,490.41	-	-	1,497,806,839.49	1,781,864,142.66
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	36,215,024.63	36,215,024.63
应付管理人 报酬	-	-	-	-	1,299,676.55	1,299,676.55
应付托管费	-	-	-	-	236,304.84	236,304.84
应付清算款	-	-	-	-	29,770,165.06	29,770,165.06
应交税费	-	-	-	-	2,498.18	2,498.18
其他负债	-	-	-	-	325,453.53	325,453.53
负债总计	-	-	-	-	67,849,122.79	67,849,122.79
利率敏感度 缺口	143,681,812.76	140,375,490.41	-	-	1,429,957,716.70	1,714,015,019.87
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产						
货币资金	26,952,651.74	-	-	-	-	26,952,651.74
交易性金融 资产	10,100,964.38	20,064,980.82	-	-	397,023,500.14	427,189,445.34
应收股利	-	-	-	-	303,627.37	303,627.37
应收申购款	-	-	-	-	16,364,212.65	16,364,212.65
资产总计	37,053,616.12	20,064,980.82	-	-	413,691,340.16	470,809,937.10
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,820,110.22	4,820,110.22
应付管理人 报酬	-	-	-	-	334,792.40	334,792.40
应付托管费	-	-	-	-	60,871.36	60,871.36

应交税费	-	-	-	-	739.87	739.87
其他负债	-	-	-	-	361,788.16	361,788.16
负债总计	-	-	-	-	5,578,302.01	5,578,302.01
利率敏感度缺口	37,053,616.12	20,064,980.82	-	-	408,113,038.15	465,231,635.09

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 27 个基点	-389,900.87	-50,592.30
	市场利率下降 27 个基点	389,900.87	50,592.30

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

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 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	30,913,254.07	-	-	30,913,254.07
交易性金融资产	1,538,771,998.15	-	-	1,538,771,998.15
应收股利	985,469.96	-	-	985,469.96
应收申购款	854,463.50	-	-	854,463.50
资产合计	1,571,525,185.68	-	-	1,571,525,185.68
以外币计价的负债				
应付清算款	29,770,165.06	-	-	29,770,165.06

应付赎回款	635,139.72	-	-	635,139.72
其他负债	2,393.62	-	-	2,393.62
负债合计	30,407,698.40	-	-	30,407,698.40
资产负债表外汇风险敞口净额	1,541,117,487.28	-	-	1,541,117,487.28
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
货币资金	11,218,423.29	-	-	11,218,423.29
交易性金融资产	397,023,500.14	-	-	397,023,500.14
应收股利	303,627.37	-	-	303,627.37
应收申购款	30,220.82	-	-	30,220.82
资产合计	408,575,771.62	-	-	408,575,771.62
以外币计价的负债				
应付赎回款	125,931.92	-	-	125,931.92
其他负债	59,565.91	-	-	59,565.91
负债合计	185,497.83	-	-	185,497.83
资产负债表外汇风险敞口净额	408,390,273.79	-	-	408,390,273.79

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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）
	美元相对人民币升值 5%	77,055,874.36	20,419,513.69
	美元相对人民币贬值 5%	-77,055,874.36	-20,419,513.69

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (ValueatRisk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,473,275,856.70	85.95	395,819,466.70	85.08
交易性金融资产—基金投资	—	—	1,204,033.44	0.26
交易性金融资产—债券投资	226,083,478.44	13.19	30,165,945.20	6.48
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	1,699,359,335.14	99.14	427,189,445.34	91.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.24% (2025 年 12 月 31 日 VaR 值为 2.82%)	-55,557,100.26	-13,131,024.71

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,473,275,856.70	397,023,500.14
第二层次	226,083,478.44	30,165,945.20
第三层次	—	—
合计	1,699,359,335.14	427,189,445.34

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 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	1,473,275,856.70	82.68
	其中：普通股	1,466,126,836.38	82.28
	存托凭证	7,149,020.32	0.40
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	226,083,478.44	12.69
	其中：债券	226,083,478.44	12.69
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	57,973,824.73	3.25
8	其他各项资产	24,530,982.79	1.38
9	合计	1,781,864,142.66	100.00

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

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,473,275,856.70	85.95
合计	1,473,275,856.70	85.95

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
原材料	13,420,300.75	0.78
非日常生活消费品	121,583,019.30	7.09

日常消费品	114,249,742.15	6.67
能源	34,860,630.22	2.03
金融	205,674,461.22	12.00
医疗保健	204,297,922.84	11.92
工业	173,802,600.30	10.14
信息技术	273,698,083.72	15.97
通信服务	99,488,715.03	5.80
公用事业	40,304,067.89	2.35
房地产	25,023,130.06	1.46
合计	1,306,402,673.48	76.22

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
原材料	1,215,296.13	0.07
非日常生活消费品	16,233,099.06	0.95
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	10,678,346.97	0.62
信息技术	132,346,034.00	7.72
通信服务	6,400,407.06	0.37
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	166,873,183.22	9.74

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	APPLIED MATERIAL	应用材料公司	AMAT US	美国证券交易所	美国	3,890	19,155,451.92	1.12
2	GE VERNOVA INC	通用电气 Vernova 股份有限公司	GEV US	美国证券交易所	美国	2,230	17,844,134.36	1.04
3	LAM RESEARCH	泛林集团	LRCX US	美国证券交易所	美国	6,007	17,728,863.35	1.03
4	INTEL	英特尔公	INTC US	美国证券	美国	18,058	17,173,265.75	1.00

	CORP	司		交易所				
5	MICRON TECH	美光科技 股份有限 公司	MU US	美国证 券交易 所	美国	2,168	17,044,282.15	0.99
6	ADVANCE D MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	美国证 券交易 所	美国	4,273	16,906,209.61	0.99
7	CATERPI LLAR INC	卡特彼勒 公司	CAT US	美国证 券交易 所	美国	2,258	16,377,110.09	0.96
8	GENERAL ELECTRI C	通用电气 公司	GE US	美国证 券交易 所	美国	6,065	15,438,079.39	0.90
9	DEERE & CO	迪尔	DE US	美国证 券交易 所	美国	3,452	14,913,876.50	0.87
10	CAPITAL ONE FINA	第一资本 金融	COF US	美国证 券交易 所	美国	10,882	14,869,194.81	0.87
11	ABBVIE INC	艾伯维股 份有限公 司	ABBV US	美国证 券交易 所	美国	8,593	14,727,498.67	0.86
12	BOOKING HOLDING S	缤客控股 公司	BKNG US	美国证 券交易 所	美国	12,033	14,607,758.96	0.85
13	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	美国证 券交易 所	美国	6,061	14,558,935.43	0.85
14	TESLA INC	特斯拉公 司	TSLA US	美国证 券交易 所	美国	5,066	14,512,390.56	0.85
15	HONEYWE LL AEROSPA CE INC	霍尼韦尔 航空航天 股份有限 公司	HONA US	美国证 券交易 所	美国	9,551	14,381,454.28	0.84
16	AMERICA N EXPRESS	美国运通	AXP US	美国证 券交易 所	美国	6,169	14,212,061.54	0.83
17	MERCK & CO	默克	MRK US	美国证 券交易 所	美国	16,231	14,205,381.75	0.83
18	QUALCOM M INC	高通公司	QCOM US	美国证 券交易 所	美国	11,274	14,189,300.94	0.83
19	AMGEN INC	安进公司	AMGN US	美国证 券交易 所	美国	5,724	14,117,462.43	0.82
20	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	美国证 券交易 所	美国	8,105	14,019,739.43	0.82
21	US	美国合众	USB US	美国证 券交易 所	美国	34,025	13,997,148.70	0.82

	BANCORP	银行		交易所				
22	VISA INC-CLASS A	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	5,985	13,985,458.81	0.82
23	JPMORGAN CHASE	摩根大通	JPM US	美国证券交易所	美国	6,253	13,940,512.59	0.81
24	TEXAS INSTRUMENT	德州仪器公司	TXN US	美国证券交易所	美国	6,855	13,916,506.62	0.81
25	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	美国证券交易所	美国	1,701	13,895,805.44	0.81
26	CVS HEALTH CORP	CVS 健康公司	CVS US	美国证券交易所	美国	19,720	13,894,467.57	0.81
27	UBER TECHNOLOGIE	优步技术股份有限公司	UBER US	美国证券交易所	美国	28,173	13,846,312.33	0.81
28	SIMON PROPERTY	西蒙房地产集团公司	SPG US	美国证券交易所	美国	9,083	13,835,750.46	0.81
29	MASTERCARD INC-A	万事达股份有限公司	MA US	美国证券交易所	美国	3,953	13,827,903.28	0.81
30	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	美国证券交易所	美国	14,492	13,814,550.65	0.81
31	BANK OF AMERICA	美国银行公司	BAC US	美国证券交易所	美国	35,441	13,754,123.39	0.80
32	EMERSON ELECT CO	艾默生电气	EMR US	美国证券交易所	美国	14,098	13,745,272.76	0.80
33	UNITED PARCEL-SERVICE B	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	美国证券交易所	美国	18,719	13,705,522.99	0.80
34	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	美国证券交易所	美国	4,010	13,692,998.42	0.80
35	GILEAD SCIENCES	吉利德科学公司	GILD US	美国证券交易所	美国	15,912	13,692,102.65	0.80
36	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	美国证券交易所	美国	10,527	13,657,100.62	0.80
37	BRISTOL-MYERS	百时美施贵宝公司	BMJ US	美国证券交易所	美国	34,765	13,643,317.68	0.80

	SQB							
38	BOEING CO/THE	波音	BA US	美国证券 交易所	美国	9,249	13,636,314.23	0.80
39	BANK NY MELLON	纽约梅隆 银行	BNY US	美国证券 交易所	美国	13,832	13,623,472.21	0.79
40	STARBUCKS CORP	星巴克公 司	SBUX US	美国证券 交易所	美国	19,572	13,622,226.91	0.79
41	BERKSHIRE HATHAWAY CORP	伯克希尔 哈撒韦公 司	BRK/B US	美国证券 交易所	美国	3,997	13,622,200.69	0.79
42	SCHWAB (CHARLES) CORP	嘉信理财	SCHW US	美国证券 交易所	美国	21,653	13,607,649.06	0.79
43	IBM	国际商业 机器公司	IBM US	美国证券 交易所	美国	7,097	13,592,835.76	0.79
44	3M CO	3M 公司	MMM US	美国证券 交易所	美国	12,324	13,590,325.74	0.79
45	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能 源公司	NEE US	美国证券 交易所	美国	22,708	13,574,676.47	0.79
46	COMCAST CORP-A	康卡斯特 公司	CMCSA US	美国证券 交易所	美国	80,639	13,483,453.25	0.79
47	UNITEDHEALTH GRP	联合健康 集团	UNH US	美国证券 交易所	美国	4,744	13,429,383.36	0.78
48	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	美国证券 交易所	美国	8,941	13,427,015.68	0.78
49	LINDE PLC	林德公司	LIN US	美国证券 交易所	美国	3,797	13,420,300.75	0.78
50	COLGATE- PALMOLIVE	高露洁棕 榄	CL US	美国证券 交易所	美国	21,489	13,418,232.55	0.78
51	UNION PAC CORP	联合太平 洋	UNP US	美国证券 交易所	美国	7,239	13,410,716.59	0.78
52	SOUTHERN CO	南方公司	SO US	美国证券 交易所	美国	20,559	13,401,820.80	0.78
53	ABBOTT LABS	雅培制药 公司	ABT US	美国证券 交易所	美国	21,677	13,396,842.65	0.78
54	BROADCOM INC	博通股份 有限公司	AVGO US	美国证券 交易所	美国	5,195	13,365,786.78	0.78
55	DUKE ENERGY CORP	杜克能源 公司	DUK US	美国证券 交易所	美国	15,459	13,327,570.62	0.78
56	MORGAN	摩根士丹	MS US	美国证券	美国	9,354	13,317,762.51	0.78

	STANLEY	利		交易所				
57	GOLDMAN SACHS GP	高盛	GS US	美国证券交易所	美国	1,931	13,301,384.41	0.78
58	WELLS FARGO & CO	富国集团公司	WFC US	美国证券交易所	美国	23,581	13,272,631.31	0.77
59	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	8,122	13,184,523.06	0.77
60	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	美国证券交易所	美国	9,645	13,144,138.30	0.77
61	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	6,630	13,066,417.42	0.76
62	PHILIP MORRIS IN	菲利普莫里斯国际股份有限公司	PM US	美国证券交易所	美国	10,566	13,019,001.70	0.76
63	CISCO SYSTEMS	思科公司	CSCO US	美国证券交易所	美国	16,271	13,016,935.28	0.76
64	META PLATFORM INC-CLASS A	Meta 平台股份有限公司	META US	美国证券交易所	美国	3,386	12,990,429.16	0.76
65	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	美国证券交易所	美国	26,432	12,952,849.75	0.76
66	PROCTER & GAMBLE	宝洁	PG US	美国证券交易所	美国	12,969	12,952,793.63	0.76
67	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	美国证券交易所	美国	6,055	12,913,481.04	0.75
68	WALT DISNEY CO	华特迪士尼公司	DIS US	美国证券交易所	美国	19,602	12,850,073.95	0.75
69	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	美国证券交易所	美国	24,087	12,833,956.02	0.75
70	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	美国证券交易所	美国	23,124	12,799,639.10	0.75
71	GENERAL MOTORS C	通用汽车公司	GM US	美国证券交易所	美国	24,344	12,780,214.68	0.75
72	INTUITIVE SURGICAL	直觉外科手术公司	ISRG US	美国证券交易所	美国	4,692	12,708,557.48	0.74
73	MCDONALD	麦当劳	MCD US	美国证券交易所	美国	6,842	12,596,494.06	0.73

	DS CORP			交易所				
74	BLACKROCK INC	贝莱德股份有限公司	BLK US	美国证券交易所	美国	1,913	12,528,407.26	0.73
75	COSTCO WHOLESALE	开市客公司	COST US	美国证券交易所	美国	1,966	12,526,157.90	0.73
76	PFIZER INC	辉瑞制药有限公司	PFE US	美国证券交易所	美国	75,505	12,383,308.67	0.72
77	WALMART INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	美国证券交易所	美国	16,029	12,364,811.22	0.72
78	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	美国证券交易所	美国	4,865	12,360,028.33	0.72
79	PEPSICO INC	百事公司	PEP US	美国证券交易所	美国	13,394	12,351,891.35	0.72
80	SERVICE NOW INC	ServiceNow 公司	NOW US	美国证券交易所	美国	18,225	12,323,492.62	0.72
81	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	美国证券交易所	美国	43,970	12,293,459.96	0.72
82	INTUIT INC	财捷集团	INTU US	美国证券交易所	美国	6,801	12,089,762.96	0.71
83	SALESFORCE INC	Salesforce 股份有限公司	CRM US	美国证券交易所	美国	11,309	12,066,653.17	0.70
84	EXXONMOBIL HOLDING S CORP	埃克森美孚石油公司	XOM US	美国证券交易所	美国	12,833	11,949,913.12	0.70
85	T-MOBILE US INC	T-Mobile US 股份有限公司	TMUS US	美国证券交易所	美国	10,418	11,901,442.53	0.69
86	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	美国证券交易所	美国	41,170	11,872,337.24	0.69
87	MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	亿滋国际公司	MDLZ US	美国证券交易所	美国	30,117	11,864,364.95	0.69
88	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	Palantir 技术股份有限公司	PLTR US	美国证券交易所	美国	14,845	11,796,248.25	0.69
89	AT&T INC	美国电话	T US	美国证券交易所	美国	83,279	11,741,142.28	0.69

		电报公司		交易所				
90	ADOBE INC	奥多比公司	ADBE US	美国证券交易所	美国	8,283	11,566,138.66	0.67
91	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	美国证券交易所	美国	10,184	11,497,479.20	0.67
92	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	美国证券交易所	美国	23,573	11,463,508.88	0.67
93	CONOCOP HILLIPS	康菲石油	COP US	美国证券交易所	美国	16,119	11,413,237.90	0.67
94	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT US	美国证券交易所	美国	10,042	11,187,379.60	0.65
95	ACCENTURE PLC-A	埃森哲公司	ACN US	美国证券交易所	美国	11,337	9,608,656.17	0.56
96	ORACLE CORP	甲骨文股份有限公司	ORCL US	美国证券交易所	美国	9,605	9,587,109.68	0.56
97	ALPHABET INC-CLASS A	Alphabet 股份有限公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	3,015	7,338,544.17	0.43
98	ALPHABET INC-CLASS C	Alphabet 股份有限公司	GOOG US	美国证券交易所	美国	2,430	5,847,783.57	0.34

7.4.2 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	MARVELL TECHNOLOGY INC	美满电子科技公司	MRVL US	美国证券交易所	美国	11,000	22,317,889.01	1.30
2	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	10,000	16,233,099.06	0.95
3	MICRON TECH	美光科技股份有限公司	MU US	美国证券交易所	美国	2,000	15,723,507.52	0.92
4	SANDISK CORP	闪迪公司/特拉华州	SNDK US	美国证券交易所	美国	750	11,614,610.74	0.68
5	LUMENTUM HOLDINGS INC	Lumentum 控股股份有限公司	LITE US	美国证券交易所	美国	1,600	9,350,657.37	0.55
6	APPLIED	应用材料	AMAT US	美国证券交易所	美国	1,550	7,632,635.09	0.45

	MATERIA L	公司		交易所				
7	MKS INC	MKS 股份 有限公司	MKSI US	美国证 券 交易所	美国	2,500	7,573,720.80	0.44
8	SPACE EXPLORA TION TECHN-C L A	太空探索 技术公司	SPCX US	美国证 券 交易所	美国	5,500	6,400,407.06	0.37
9	NEBIUS GROUP NV	Nebius 集团股份 有限公司	NBIS US	美国证 券 交易所	美国	3,400	6,395,285.26	0.37
10	ADVANCE D MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	美国证 券 交易所	美国	1,600	6,330,431.87	0.37
11	SEAGATE TECHNOL OGY HOLDING S	Seagate Technolo gy 控股 公共有	STX US	美国证 券 交易所	美国	900	5,915,266.65	0.35
12	GE VERNOVA INC	通用电气 Vernova 股份有限 公司	GEV US	美国证 券 交易所	美国	700	5,601,297.78	0.33
13	PALANTI R TECHNOL OGIES INC-A	Palantir 技术股份 有限公司	PLTR US	美国证 券 交易所	美国	7,000	5,562,393.92	0.32
14	CREDO TECHNOL OGY GROUP HOLDI	Credo 科 技集团控 股有限公 司	CRDO US	美国证 券 交易所	美国	2,800	5,186,227.91	0.30
15	CATERPI LLAR INC	卡特彼勒 公司	CAT US	美国证 券 交易所	美国	700	5,077,049.19	0.30
16	INTEL CORP	英特尔公 司	INTC US	美国证 券 交易所	美国	5,000	4,755,029.84	0.28
17	CIRCLE INTERNE T GROUP INC	Circle 互联网集 团股份有 限公司	CRCL US	美国证 券 交易所	美国	10,000	4,265,666.67	0.25
18	NOKIA CORP-SP	诺基亚	NOK US	美国证 券 交易所	美国	47,000	4,251,091.34	0.25

	ON ADR							
19	CADENCE DESIGN SYS INC	铿腾电子科技有限 公司	CDNS US	美国 证券 交易所	美国	1,350	3,450,960.43	0.20
20	QUALCOM M INC	高通公司	QCOM US	美国 证券 交易所	美国	2,500	3,146,465.53	0.18
21	CEREBRA S SYSTEMS INC - A	Cerebras Systems Inc	CBRS US	美国 证券 交易所	美国	2,000	3,010,417.80	0.18
22	TERADYN E INC	泰瑞达	TER US	美国 证券 交易所	美国	900	2,965,847.27	0.17
23	ARM HOLDING S PLC-ADR	ARM 控股 公共有限 公司	ARM US	美国 证券 交易所	美国	1,200	2,897,928.98	0.17
24	MATERIO N CORP	Materion 公司	MTRN US	美国 证券 交易所	美国	600	1,215,296.13	0.07

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净 值比例 (%)
1	AMAZON.COM INC	AMZN US	25,996,474.23	5.59
2	GE VERNOVA INC	GEV US	19,333,239.65	4.16
3	MICRON TECH	MU US	19,275,758.74	4.14
4	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	PLTR US	17,815,121.48	3.83
5	APPLIED MATERIAL	AMAT US	17,439,999.72	3.75
6	INTEL CORP	INTC US	15,774,573.16	3.39
7	ORACLE CORP	ORCL US	15,195,352.71	3.27
8	MARVELL TECHNOLOGY INC	MRVL US	13,606,147.26	2.92
9	QUALCOMM INC	QCOM US	13,435,281.41	2.89
10	INTUIT INC	INTU US	13,102,384.37	2.82
11	LAM RESEARCH	LRCX US	12,929,854.26	2.78
12	LUMENTUM HOLDINGS INC	LITE US	12,906,811.92	2.77
13	CATERPILLAR INC	CAT US	12,078,910.64	2.60
14	NIKE INC -CL B	NKE US	11,592,260.59	2.49
15	CAPITAL ONE FINA	COF US	11,501,741.25	2.47
16	CIRCLE INTERNET GROUP INC	CRCL US	11,460,136.77	2.46

17	COMCAST CORP-A	CMCSA US	11,332,131.75	2.44
18	GILEAD SCIENCES	GILD US	11,261,058.62	2.42
19	FEDEX CORP	FDX US	11,260,000.05	2.42
20	BOOKING HOLDINGS	BKNG US	11,194,774.22	2.41
21	ABBOTT LABS	ABT US	11,101,642.12	2.39
22	BROADCOM INC	AVGO US	11,040,237.48	2.37
23	INTUITIVE SURGIC	ISRG US	10,968,224.43	2.36
24	UBER TECHNOLOGIE	UBER US	10,871,997.80	2.34
25	GENERAL ELECTRIC	GE US	10,796,803.21	2.32
26	TESLA INC	TSLA US	10,793,172.88	2.32
27	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	10,739,323.63	2.31
28	DEERE & CO	DE US	10,689,347.79	2.30
29	MEDTRONIC PLC	MDT US	10,682,022.74	2.30
30	ACCENTURE PLC-A	ACN US	10,674,119.46	2.29
31	SERVICENOW INC	NOW US	10,624,456.33	2.28
32	AMGEN INC	AMGN US	10,558,942.95	2.27
33	DANAHER CORP	DHR US	10,544,549.09	2.27
34	LOWE'S COS INC	LOW US	10,532,400.39	2.26
35	SALESFORCE INC	CRM US	10,525,711.45	2.26
36	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	10,510,695.43	2.26
37	ADOBE INC	ADBE US	10,480,535.60	2.25
38	AMERICAN EXPRESS	AXP US	10,472,294.10	2.25
39	AT&T INC	T US	10,461,798.54	2.25
40	META PLATFORM INC-CLASS A	META US	10,450,682.39	2.25
41	HOME DEPOT INC	HD US	10,426,997.27	2.24
42	BOEING CO/THE	BA US	10,318,014.85	2.22
43	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	10,264,994.30	2.21
44	BRISTOL-MYER SQB	BMJ US	10,231,739.06	2.20
45	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	10,190,486.95	2.19
46	T-MOBILE US INC	TMUS US	10,189,854.05	2.19
47	WALT DISNEY CO	DIS US	10,163,413.72	2.18
48	MICROSOFT CORP	MSFT US	10,130,985.53	2.18
49	VERIZON COMMUNIC	VZ US	10,116,726.54	2.17
50	MASTERCARD INC-A	MA US	10,071,944.55	2.16
51	MCDONALDS CORP	MCD US	10,062,777.96	2.16
52	PEPSICO INC	PEP US	10,033,540.43	2.16
53	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW US	10,027,442.41	2.16
54	EMERSON ELEC CO	EMR US	10,000,761.98	2.15
55	STARBUCKS CORP	SBUX US	9,966,114.07	2.14
56	BLACKROCK INC	BLK US	9,885,062.06	2.12

57	WELLS FARGO & CO	WFC US	9,828,078.28	2.11
58	UNITED PARCEL-B	UPS US	9,756,664.61	2.10
59	DUKE ENERGY CORP	DUK US	9,754,409.01	2.10
60	COLGATE-PALMOLIV	CL US	9,724,280.10	2.09
61	3M CO	MMM US	9,719,068.76	2.09
62	IBM	IBM US	9,711,051.15	2.09
63	NETFLIX INC	NFLX US	9,709,857.33	2.09
64	PFIZER INC	PFE US	9,703,317.32	2.09
65	JOHNSON & JOHNSON	JNJ US	9,663,778.25	2.08
66	PROCTER & GAMBLE	PG US	9,659,593.47	2.08
67	SOUTHERN CO	SO US	9,647,755.06	2.07
68	MERCK & CO	MRK US	9,594,789.25	2.06
69	GENERAL MOTORS C	GM US	9,568,951.48	2.06
70	EXXONMOBIL HOLDINGS CORP	XOM US	9,566,810.16	2.06
71	BERKSHIRE HATH-B	BRK/B US	9,561,379.47	2.06
72	WALMART INC	WMT US	9,550,715.06	2.05
73	COSTCO WHOLESALE	COST US	9,519,198.49	2.05
74	VISA INC-CLASS A	V US	9,517,590.83	2.05
75	ABBVIE INC	ABBV US	9,488,718.87	2.04
76	CHEVRON CORP	CVX US	9,469,784.20	2.04
77	JPMORGAN CHASE	JPM US	9,464,490.11	2.03
78	LINDE PLC	LIN US	9,453,506.38	2.03

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

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	INTEL CORP	INTC US	13,814,720.16	2.97
2	MICRON TECH	MU US	12,543,777.59	2.70
3	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	11,499,170.58	2.47
4	SANDISK CORP	SNDK US	8,400,623.08	1.81
5	TARGET CORP	TGT US	8,300,243.51	1.78
6	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	HON US	8,113,306.18	1.74
7	APPLIED OPTOELE	AAOI US	7,017,126.98	1.51
8	ALPHABET INC-CL A	GOOGL US	6,976,278.68	1.50
9	AMERICAN INTERNA	AIG US	6,316,330.01	1.36
10	METLIFE INC	MET US	5,935,080.09	1.28
11	ORACLE CORP	ORCL US	5,359,197.89	1.15
12	CIRCLE INTERNET GROUP INC	CRCL US	5,327,940.82	1.15

13	PAYPAL HOLDINGS	PYPL US	5,054,110.78	1.09
14	LUMENTUM HOLDINGS INC	LITE US	5,028,989.96	1.08
15	RUBRIK INC-A	RBRK US	4,443,357.63	0.96
16	ANALOG DEVICES	ADI US	3,540,197.89	0.76
17	COHERENT CORP	COHR US	3,334,718.46	0.72
18	MARVELL TECHNOLOGY INC	MRVL US	3,007,322.79	0.65
19	LAM RESEARCH	LRCX US	2,800,452.22	0.60
20	CISCO SYSTEMS	CSCO US	2,706,502.24	0.58

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,167,363,998.11
卖出收入（成交）总额	187,127,940.51

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例（%）
未评级	160,587,336.99	9.37
AAA+至 AAA-	65,496,141.45	3.82

注：本债券投资组合境外债券主要采用标准普尔、惠誉、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，境内债券主要采用联合信用评级有限公司等机构提供的债券信息评级信息。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	260009	26 付息国债 09	1,100,000	110,181,032.88	6.43
2	US912797TC16	B 0 12/24/26	98,000	65,496,141.45	3.82
3	260001	26 付息国债 01	300,000	30,194,457.53	1.76
4	250019	25 付息国债 19	200,000	20,211,846.58	1.18

注：境外债券代码为 ISIN 码。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同约定备选股票库的情形。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	985,469.96
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,545,512.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,530,982.79

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 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。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
123,922	5,374.33	216,225,621.21	32.47	449,771,699.58	67.53

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	651.05	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 30 日）基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	198,880,916.32
本报告期基金总申购份额	589,810,842.85
减：本报告期基金总赎回份额	122,694,438.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	665,997,320.79

注：上述份额变动包含人民币份额及美元份额的情况。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

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

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

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
MS	1	-	-	-	-	-
GS	1	-	-	-	-	-
CITI	1	-	-	-	-	-
CLSA	1	1,354,491,938.62	100.00	164,130.78	100.00	-
BNPP	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

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

(2) 选择程序：

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

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

		比例 (%)		(%)		比例 (%)		
MS	242,675,292.31	35.93	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA	-	-	-	-	-	-	1,519,534.14	100.00
BNPP	432,790,999.76	64.07	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-13
2	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-15
3	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
5	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-2-3
6	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
7	长信基金管理有限责任公司关于董事变更情况的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
8	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
9	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
10	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-31
11	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-1
12	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子	2026-4-3

		披露网站、公司网站	
13	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
14	长信基金管理有限公司旗下全部基金 2026 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
15	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026-4-30
16	长信基金管理有限公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-5-21
17	长信基金管理有限公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-23
18	长信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	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27
19	长信基金管理有限公司关于旗下部分基金的基金合同提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026 年 3 月 3 日至 2026 年 4 月 21 日	0.00	96,348,166.53	0.00	96,348,166.53	14.47
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。							
2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者							

小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所、托管人住所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2026 年 8 月 31 日