长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 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 10

4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 17

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
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 17

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 18

6.1 资产负债表 18
6.2 利润表 19
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 22

§7 投资组合报告 41

7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 58
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 58

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 58
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 58
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 59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 59
7.12 投资组合报告附注 59

§8 基金份额持有人信息 60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
8.2 盈利投资者数量占比 60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
8.4 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 60

§9 开放式基金份额变动 61

§10 重大事件揭示 61

10.1 基金份额持有人大会决议 61
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 61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 61
10.4 基金投资策略的改变 61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 62
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 62
10.8 其他重大事件 63

§11 影响投资者决策的其他重要信息 64

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 64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 65

§12 备查文件目录 65

12.1 备查文件目录 65
12.2 存放地点 65
12.3 查阅方式 65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛世混合	
基金主代码	002156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	32,619,908.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
下属分级基金的交易代码	002156	002157
报告期末下属分级基金的份额总额	4,712,603.00 份	27,907,305.08 份

注：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 12 月 11 日成立，后经《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1282 号）变更注册，并经份额持有人大会表决于 2021 年 6 月 21 日通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 6 月 21 日生效。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	（一）大类资产配置 本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。 （二）股票投资策略 在新股投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。 在行业配置策略上，本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。 在个股配置策略上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。 同时，本基金将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。

	此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	王小飞
	联系电话	010-86497608	021-60637103
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	021-60637228
传真		010-86497999	021-60635778
注册地址		深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100029	100033
法定代表人		胡甲	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
本期已实现收益	68,864.44	236,963.89
本期利润	236,814.26	1,287,103.77
加权平均基金份额本期利润	0.0469	0.0477
本期加权平均净值利润率	3.00%	3.09%
本期基金份额净值增长率	3.17%	3.07%

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	2,706,818.67	15,415,296.09
期末可供分配基金份额利润	0.5744	0.5524
期末基金资产净值	7,567,045.61	44,167,292.19
期末基金份额净值	1.6057	1.5826
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	107.87%	93.82%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

4、修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日为 2021 年 6 月 21 日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛世混合 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	5.46%	0.62%	6.54%	0.63%	-1.08%	-0.01%
过去六个月	3.17%	0.51%	4.94%	0.57%	-1.77%	-0.06%
过去一年	25.04%	0.88%	13.76%	0.51%	11.28%	0.37%
过去三年	42.53%	0.80%	22.49%	0.55%	20.04%	0.25%
过去五年	37.67%	0.69%	10.69%	0.55%	26.98%	0.14%
过去七年	85.56%	0.65%	35.79%	0.58%	49.77%	0.07%
过去十年	106.22%	0.68%	59.51%	0.57%	46.71%	0.11%
自基金合同生效起	107.87%	0.66%	51.53%	0.59%	56.34%	0.07%

至今						

长盛盛世混合 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	5.41%	0.62%	6.54%	0.63%	-1.13%	-0.01%
过去六个月	3.07%	0.51%	4.94%	0.57%	-1.87%	-0.06%
过去一年	24.70%	0.88%	13.76%	0.51%	10.94%	0.37%
过去三年	41.57%	0.80%	22.49%	0.55%	19.08%	0.25%
过去五年	36.21%	0.69%	10.69%	0.55%	25.52%	0.14%
过去七年	82.85%	0.65%	35.79%	0.58%	47.06%	0.07%
过去十年	92.67%	0.67%	59.51%	0.57%	33.16%	0.10%
自基金合同生效起至今	93.82%	0.65%	51.53%	0.59%	42.29%	0.06%

注：1、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

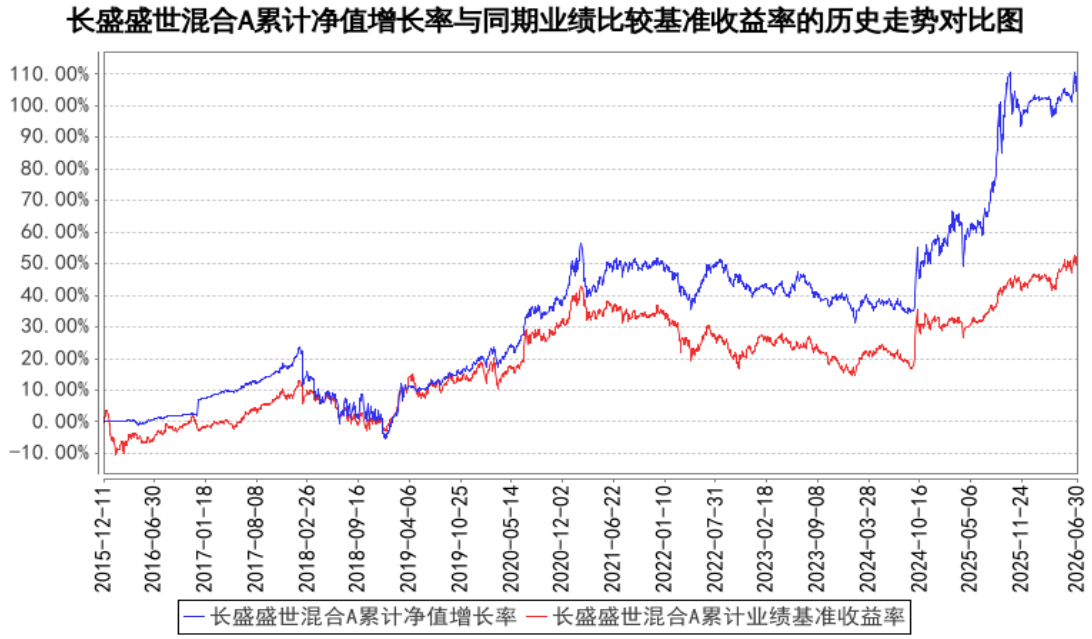
（1）公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

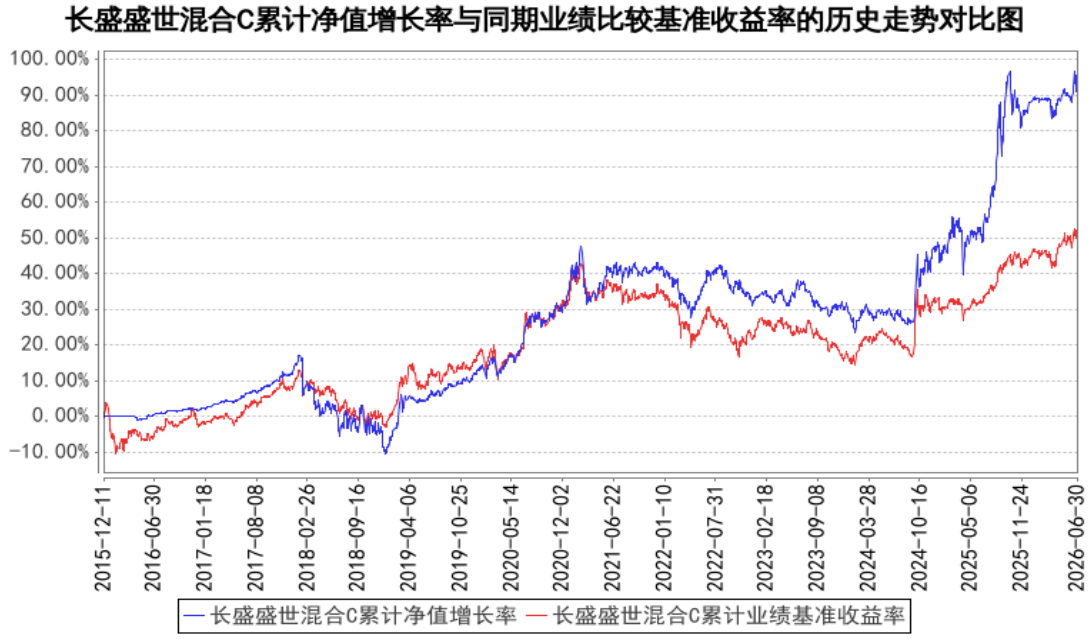
（2）可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

（3）再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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





注：1、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2025 年 11 月 21 日	-	19 年	杨衡先生，博士、博士后。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理等职务。
石晓冉	本基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理，长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证	2026 年 6 月 8 日	-	9 年	石晓冉先生，硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员，中国人保资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理，万柏私募基金管理有限公司投资经理。2025 年 3 月加

	券投资基金（LOF）基金经理。				入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输

送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2026 年上半年，中国经济的核心特征不是总量失速，而是“非对称复苏”进一步深化：生产强于需求、外需强于内需、价格修复强于终端传导、新经济显著强于旧经济。2026 年上半年，宏观经济总体运行在合理区间，但修复动能明显依赖出口、先进制造和政策支持领域，而消费、地产、传统投资链条偏弱，导致资产价格表现高度分化。对应到资本市场，2026 年上半年，最鲜明的定价主线是“宏观弱弹性+产业强趋势”：A 股呈现极致结构分化，科创板、创业板涨幅显著超越主板，电子、通信、半导体、AI 算力链领跑；债券市场则在宽松流动性、弱信用扩张和资产荒驱动下维持强势；IPO 市场则体现出审核提速、结构偏硬科技、融资集中度提升、上市首日收益高但追高风险加大的特征。

2026 年上半年，数据显示，二季度宏观经济较一季度边际放缓，显示年初政策和外需支撑有所减弱后，呈现内生需求不足。但 GDP 绝对增量数据说明中国经济并非陷入失速，而是在更高基数和更复杂外部环境下维持了中速稳定增长。从生产端看，工业部门仍是最主要支撑，上半年规模以上工业增加值累计同比增长数据显示，二季度末工业生产有所修复。这背后主要有两层原因：一是出口链需求超预期偏强，对电子信息、装备制造、汽车、电力设备等行业形成支撑；二是高技术制造、装备制造、新质生产力相关产业仍保持扩张，产业升级对冲了地产链和传统行业的拖累。需求端则明显偏弱，内部继续分化。消费方面，社零月度同比有所回落，说明商品消费总体仍弱，政策刺激后的边际拉动开始减弱。上半年 CPI、核心 CPI 温和回升但并不强，表明居民部门真实购买力和消费意愿修复有限。这意味着消费并非没有改善，而是更多集中在服务消费和必选消费，耐用品和可选消费仍受收入预期与资产负债表约束。价格修复更多来自国际能源和上游资源品冲击，以及 AI 升级相关领域的价格支撑，而中下游价格传导有限，因此名义增长改善强于终端盈利普遍改善。综合来看，2026 年上半年，宏观经济总量平稳但斜率放缓，二季度是全年阶段性低点概率较高；出口和先进制造仍是经济主支柱，内需和地产仍是主要拖累；价格和名义增长改善已经出现，但尚未形成广泛的盈利扩散。宏观经济表现定义了上半年资产价格的主线：科

技成长受益于景气和政策共振，利率债受益于弱内需和宽流动性，传统顺周期和消费链整体承压。

货币政策方面，基调是“适度宽松，但偏结构性发力而非总量强刺激”。2026 年上半年，总量宽松整体偏克制，政策重心主要在流动性管理、汇率稳定和结构性工具投放。货币政策不是“放大水”，而是维持流动性宽裕、压低短端资金波动、定向支持科技和重点领域。这一政策组合效果清晰：一方面并未明显推升广谱信用扩张，另一方面显著改善了科技制造链融资条件，强化了市场对 AI、半导体、高端制造等方向的风险偏好。财政政策方面，取向依然积极，但执行节奏偏谨慎。新增政府债务总规模与上年相比增量有限，广义财政赤字率并未显著扩张。上半年财政支出节奏,未充分前倾。一方面减轻了利率债供给冲击，另一方面也使基建和顺周期板块缺乏持续基本面催化。

产业政策是上半年最具资本市场影响力的政策变量。2026 年《政府工作报告》明确提出培育壮大新兴产业和未来产业，打造集成电路、航空航天、生物医药、低空经济等新兴支柱产业，深化拓展“人工智能+”行动，推动重点行业人工智能商业化规模化应用，实施超大规模智算集群、算电协同等新基建工程。这一政策信号意味着，宏观政策的重心不是传统地产和重基建全面刺激，而是通过产业政策塑造新增长极。资本市场制度改革也服务于这一方向。科创板“1+6”改革持续推进，其核心是设置科创成长层、重启并扩围第五套未盈利企业上市标准，同时配套资深专业机构投资者制度、IPO 预先审阅机制、扩大第五套适用范围至人工智能、商业航天、低空经济等领域、支持在审企业增资扩股、优化再融资和并购机制、完善 ETF 及衍生品体系。2026 年 6 月陆家嘴论坛又明确提出扩大科创板第五套标准适用范围至人工智能领域，进一步提高了 AI 大模型和硬科技企业的资本市场可得性。创业板改革同样是上半年重要增量，4 月 10 日证监会发布《关于深化创业板改革更好服务新质生产力发展的意见》，增设第四套上市标准，不再单纯强调盈利，转而引入营收复合增长率和研发投入指标。政策方向显著增强了资本市场对高成长、未盈利创新企业的包容性。

政策影响可以概括为三层传导：宏观层面形成“宽流动性+慢财政落地”的组合，利多债券、利多成长估值，但对传统内需链支持有限；产业层面形成“政策集中支持科技创新和新质生产力”，使 AI、半导体、先进制造成为景气与政策双升的稀缺方向；资本市场制度层面显著改善硬科技融资生态，使 IPO、并购、再融资、ETF 和中长期资金配置形成闭环，直接改变了 A 股和一级市场的结构重心。

2026 年上半年，A 股市场行情极致分化，科技成长赛道显著跑赢传统权重和红利板块，电子、通信等方向明显占优，商贸零售、食品饮料等偏内需和传统板块承压。市场并非全面牛市，而是资金和估值高度向科技硬件和 AI 链等少数高景气产业集中。AI 及其上游硬科技链条是绝对主线，

反映的不是简单题材炒作，而是全球 AI 资本开支扩张、国产替代预期强化和业绩兑现共振。风格上看，A 股市场完成了从“政策预期驱动”到“产业景气驱动”的切换。年初在流动性宽松和春季躁动下出现普涨，二季度受地缘政治和外部流动性扰动影响，市场出现一致性回撤，但季末重新回归 AI 和中小盘成长抱团。这一过程中，传统大盘价值股并未获得持续资金增配，反而呈现资金从消费、金融等板块持续流出、向科技成长集中的趋势。反映的是宏观映射和结构分化：上半年经济呈现“外需强于内需、新经济强于旧经济”，市场给予出口制造、科技制造和自主可控更高溢价，而将地产链、消费链、金融链视为基本面等待验证的板块。值得注意的是，券商和非银板块在上半年并未充分受益于市场活跃度提升，显著跑输沪深 300 和科创板指数，说明市场风格偏好并没有扩散到全面风险偏好提升，而是高度集中在科技产业趋势本身，持续围绕科技主线的景气确定性与政策支持方向定价，后续需要更加重视盈利验证而非单纯扩张估值。

2026 年上半年，债券市场整体表现偏强，核心逻辑是经济弱修复、货币环境宽松、财政供给节奏偏慢、机构配置压力持续。利率债牛市来自宽流动性和弱内需，信用债行情来自资产荒和低风险偏好，可转债则在供需紧平衡下分享了权益结构行情。信用债市场“低利差、高需求”的格局，随着部分信用事件扰动和利差压到历史低位，信用债未来的资本利得空间或明显收窄。可转债方面，上半年整体跟随权益市场上行，但弹性弱于科技正股，且估值始终偏高。上半年转债市场的本质是供给偏紧、需求稳定、估值高位、结构分化。在权益主线上偏科技成长的背景下，兼具正股景气和转债弹性的品种表现更好，而单纯依赖估值抬升的品种空间有限。

2026 年上半年，A 股 IPO 市场呈现以下特征：总量及审核提速、结构硬科技化、募资集中度上升、上市表现强但分化明显、打新赚钱效应显著。上半年 IPO 板块结构方面，北交所在数量上占优，科创板在硬科技属性和单体募资规模上更突出，成为近期 IPO 募资和大项目的核心承载平台，显示 IPO 市场供给结构正在快速向硬科技倾斜，硬科技、未盈利企业和大项目逐渐成为主角。二级市场风险偏好回升叠加一级市场定价估值克制，形成了较高的新股安全垫和收益率。

2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内，本基金在基金组合投资管理上始终坚持稳健操作的原则，注重加强基金投资者结构与组合资产流动性之间的匹配管理，密切跟踪基金规模的变化，提前做好压力测试，积极应对可能出现的较大规模申购或赎回。

在固定收益资产配置方面，本基金坚持以短期利率债为主，严格控制组合久期，未额外提升杠杆水平。与此同时，本基金综合考量资金面松紧不均和节奏判断，在交易所市场进行多品种、短期限的逆回购滚动操作，保持了组合充裕的流动性，较好地管理了利率风险、信用风险和流动性风险。

本报告期内，本基金增聘了基金经理，加强了量化投资的操作执行。权益投资方面，从之前的维持了中性偏低的股票仓位，策略转向基于深度学习预测模型的量选股票策略，维持较高的股票仓位。股票选择上，从之前的优选中证 A500 指数成份股作为底仓，转向偏向成长风格的量选模型，通过深度学习模型自下而上获取相对市场的超额收益。

此外，本基金积极做好资金与流动性精细化管理，在满足合规、资金头寸和风控要求的前提下，参与北交所新股申购。对于中签的新股，在上市后及时兑现收益，力求为组合争取打新增强回报。

本基金将继续恪守勤勉尽责的原则，在控制风险的前提下，动态优化组合，力争为持有人创造稳健、可持续的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛世混合 A 的基金份额净值为 1.6057 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.17%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%；截至本报告期末长盛盛世混合 C 的基金份额净值为 1.5826 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.07%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2026 年下半年宏观经济大概率在二季度阶段性探底后小幅修复，但难以出现强弹性反转，整体沿续“总量弱修复、结构强分化”的宏观态势。出口和 AI 链条可能继续保持韧性，消费和投资读数可能较上半年边际改善，但地产仍难成为增长弹性来源，全年实际 GDP 增速大概率维持在 4.7%左右。

货币政策方面，预计适度宽松基调大概率延续，但总量工具更偏相机抉择。央行已明确将根据国内外经济金融形势，综合运用准备金、逆回购、MLF 和国债买卖等工具。结合上半年未明显全面降准降息、而金融数据继续偏弱的现实，下半年或存在一次降准甚至一次小幅降息的窗口，但更可能体现为配合财政发债、稳定资金面、继续加码结构性工具，而非“大水漫灌”。财政政策方面，预计下半年比上半年更为关键。但当前最大的边际变化不在总规模，而在执行节奏。随着专项债、超长期特别国债和新型政策性金融工具落地，下半年财政有望从“蓄力”转向“形成实物工作量”，重点投向“两重”、“六张网”、城市更新、地下管网、能源电网、算力网络和民生服务领域。这意味着下半年如果顺周期板块要出现系统性修复，核心触发器是财政资金投放明确提速和项目开工落地。

A 股市场方面，预计结构性机会大概率仍多于总量性机会。上半年科技主线已经获得了显著超额收益，但下半年是否继续强势，关键将从“讲故事”切换到“看业绩”、“消化估值”。当前更值得关注的方向，一是科技自主可控，包括半导体设备材料、国产算力、AI 基础设施、工业

软件；二是高端装备制造，包括机器人、工业母机、航空航天、储能设备；三是受益于低利率环境和中长期资金入市的高股息防御资产，如银行、电力、公用事业。从风格上看，下半年市场可能仍维持“K 型分化”，但内部轮动会加快。若财政落地改善投资端，建筑材料、电网设备、部分机械链和资源品存在阶段性修复机会；若内需政策加码、地产边际企稳，则消费和顺周期板块可能迎来预期修复；但在这些信号未明确前，科技成长或仍是确定性更高的主线。

债券市场方面，下半年判断或应更加中性一些。利率债的中长期支撑仍在于内需偏弱和流动性宽松，但 10 年期国债收益率已经处于较低位置，预计继续单边大幅下行空间有限，或维持中枢震荡。风险或来自于下半年政府债券供给提速、资金面阶段性收敛，以及若政策超预期加码导致市场重新定价增长预期。信用债方面，下半年或需从“赚利差压缩的钱”切换到“赚票息和波段的钱”。当前多数中高等级信用利差已处历史低位，进一步压缩空间有限。若三季度出现供给上升、权益波动或个别信用事件扰动，可能提供更好的配置机会。可转债则仍受制于高估值和供给缩量，若权益主线继续围绕科技成长演绎，具备正股景气支撑的转债或有相对优势，但整体性价比已弱于上半年。

IPO 与新股市场下半年预计仍将维持“常态化发行+硬科技倾斜+质量优先”格局。随着科创板和创业板改革继续落地，AI、商业航天、低空经济、半导体、新型消费等赛道的上市供给可能继续增加。但要重点关注两个风险：一是超级大项目集中发行是否会对二级市场流动性阶段性抽水；二是新股上市冲高后，估值消化和回归风险或提升。

综合来看，2026 年下半年的投资重点，不是押注全面牛市或全面复苏，而是寻找“宏观弱复苏环境中的结构性、高确定性资产”。真正的超额收益，或仍将来自对“结构分化”、而非“总量改善”的准确把握。在权益上，优先看产业趋势和盈利预期兑现；在固收上，优先看票息安全垫与流动性环境；在一级市场上，优先看制度红利与供给结构变化。

2026 年下半年，或有以下风险需要警惕：第一，内需修复继续不及预期，使顺周期修复迟迟无法兑现；第二，海外流动性和地缘政治扰动，尤其是美联储路径、美元走势和大宗商品波动对全球风险偏好的冲击；第三，财政执行仍慢于预期，导致市场对政策托底失望；第四，科技主线估值过高后的业绩不及预期风险，即从“高景气预期”向“高景气验证”切换时的波动加大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投

资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2025 年 12 月 22 日至 2026 年 02 月 26 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合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

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

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	3,376,054.79	207,322.32
结算备付金		1,817,726.84	1,019,969.18
存出保证金		20,093.87	28,512.19
交易性金融资产	6.4.7.2	47,019,083.94	34,657,144.99
其中：股票投资		46,783,448.45	8,186,569.43
基金投资		-	-
债券投资		235,635.49	26,470,575.56
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	-	10,998,762.13
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		2,349,977.30	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,113.57	55,530.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		54,593,050.31	46,967,241.02
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		2,717,478.54	87,537.16
应付赎回款		9,037.02	21,852.04

应付管理人报酬		25,048.18	68,322.25
应付托管费		8,349.38	22,774.08
应付销售服务费		7,124.13	14,247.81
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.12	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	91,675.14	151,952.43
负债合计		2,858,712.51	366,685.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	32,619,908.08	30,275,874.34
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,114,429.72	16,324,680.91
净资产合计		51,734,337.80	46,600,555.25
负债和净资产总计		54,593,050.31	46,967,241.02

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛盛世混合 A 的基金份额净值为 1.6057 元，份额总额为 4,712,603.00 份;长盛盛世混合 C 的基金份额净值为 1.5826 元，份额总额为 27,907,305.08 份。基金份额总额 32,619,908.08 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,819,228.29	6,917,035.59
1.利息收入		94,803.02	99,318.45
其中：存款利息收入	6.4.7.13	19,645.78	16,475.14
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		75,157.24	82,843.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		500,274.90	5,717,702.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	225,557.79	4,696,195.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	74,421.95	107,995.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	200,295.16	913,511.19
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	1,218,089.70	1,097,895.65
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	6,060.67	2,118.64
减：二、营业总支出		295,310.26	524,986.32
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	146,933.52	317,287.71
2．托管费	6.4.10.2.2	48,977.82	105,762.62
3．销售服务费	6.4.10.2.3	41,127.33	12,079.46
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		0.01	-
8．其他费用	6.4.7.23	58,271.58	89,856.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,523,918.03	6,392,049.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,523,918.03	6,392,049.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,523,918.03	6,392,049.27

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,275,874.34	16,324,680.91	46,600,555.25
二、本期期初净资产	30,275,874.34	16,324,680.91	46,600,555.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,344,033.74	2,789,748.81	5,133,782.55
（一）、综合收益总额	-	1,523,918.03	1,523,918.03

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	2,344,033.74	1,265,830.78	3,609,864.52
其中：1.基金申购款	4,328,401.37	2,367,012.90	6,695,414.27
2.基金赎回款	-1,984,367.63	-1,101,182.12	-3,085,549.75
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	32,619,908.08	19,114,429.72	51,734,337.80

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	86,894,119.76	18,004,344.27	104,898,464.03
二、本期期初净资产	86,894,119.76	18,004,344.27	104,898,464.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,768,618.32	5,743,477.11	2,974,858.79
（一）、综合收益总额	-	6,392,049.27	6,392,049.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,768,618.32	-648,572.16	-3,417,190.48
其中：1.基金申购款	1,365,390.40	328,246.13	1,693,636.53
2.基金赎回款	-4,134,008.72	-976,818.29	-5,110,827.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	84,125,501.44	23,747,821.38	107,873,322.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

胡甲	张壬午	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1989 号《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共 382,205,154.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 1347 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 382,216,462.07 份基金份额(长盛盛世灵活配置混合基金 A 类份额(以下简称“长盛盛世灵活配 A”)13,184,407.64 份，长盛盛世灵活配置混合基金 C 类份额(以下简称“长盛盛世灵活配置 C”)369,032,054.43 份)，包含认购资金利息折合 11,308.07 份(长盛盛世灵活配置 A 为 2,196.74 份，长盛盛世灵活配置 C 为 9,111.33 份)。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为包商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》（2020）京 01 破 270 号之一及中国证监会指定，中国建设银行股份有限公司自包商银行股份有限公司被依法宣告破产之日起担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金临时基金托管人。

后经召开基金份额持有人大会于 2021 年 6 月 21 日表决通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司。自 2021 年 6 月 21 日起，原《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，更换基金托管人后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

根据《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计

算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票等权益类资产投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率＋50%×中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	3,376,054.79
等于：本金	3,375,708.16
加：应计利息	346.63
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	3,376,054.79

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		45,504,651.91	-	46,783,448.45	1,278,796.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	235,000.00	4.49	235,635.49	631.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	235,000.00	4.49	235,635.49	631.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	45,739,651.91	4.49	47,019,083.94	1,279,427.54

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,003.56
其中：交易所市场	42,841.06
银行间市场	162.50
应付利息	-
预提费用	48,671.58
合计	91,675.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛世混合 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	5,472,277.16	5,472,277.16
本期申购	436,865.18	436,865.18

本期赎回（以“-”号填列）	-1,196,539.34	-1,196,539.34
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,712,603.00	4,712,603.00

长盛盛世混合 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	24,803,597.18	24,803,597.18
本期申购	3,891,536.19	3,891,536.19
本期赎回（以“-”号填列）	-787,828.29	-787,828.29
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	27,907,305.08	27,907,305.08

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛世混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,080,149.11	-36,144.94	3,044,004.17
本期期初	3,080,149.11	-36,144.94	3,044,004.17
本期利润	68,864.44	167,949.82	236,814.26
本期基金份额交易产生的变动数	-442,194.88	15,819.06	-426,375.82
其中：基金申购款	259,676.60	-11,795.15	247,881.45
基金赎回款	-701,871.48	27,614.21	-674,257.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,706,818.67	147,623.94	2,854,442.61

长盛盛世混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,456,879.14	-176,202.40	13,280,676.74
本期期初	13,456,879.14	-176,202.40	13,280,676.74
本期利润	236,963.89	1,050,139.88	1,287,103.77
本期基金份额交易产生的变动数	1,721,453.06	-29,246.46	1,692,206.60

其中：基金申购款	2,167,229.64	-48,098.19	2,119,131.45
基金赎回款	-445,776.58	18,851.73	-426,924.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,415,296.09	844,691.02	16,259,987.11

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	17,325.83
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	2,229.73
其他	90.22
合计	19,645.78

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	225,557.79
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	225,557.79

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	44,420,883.13
减：卖出股票成本总额	44,109,016.57
减：交易费用	86,308.77
买卖股票差价收入	225,557.79

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	144,757.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	-70,335.96

券到期兑付）差价收入	
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	74,421.95

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	31,634,419.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,903,255.00
减：应计利息总额	801,336.62
减：交易费用	163.82
买卖债券差价收入	-70,335.96

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	200,295.16
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	200,295.16

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	1,218,089.70
股票投资	1,196,588.70
债券投资	21,501.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-

其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,218,089.70

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,060.67
合计	6,060.67

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	58,271.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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	146,933.52	317,287.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,900.65	11,560.59
应支付基金管理人的净管理费	129,032.87	305,727.12

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

H=E×年管理费率/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	48,977.82	105,762.62

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年托管费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	25,583.67	25,583.67
合计	-	25,583.67	25,583.67
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		
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	1.82	1.82
合计	-	1.82	1.82

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.20%。计算方法如下：

H=E×年销售服务费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

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

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,376,054.79	17,325.83	13,716,881.65	14,176.71
合计	3,376,054.79	17,325.83	13,716,881.65	14,176.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	限售期锁定	8.62	57.30	4,643	40,022.66	266,043.90	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110101	宝钛转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	2,310	231,000.00	231,003.54	-
111025	圣泉转债	2026 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.03	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之

间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	异常波动停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	200	24,596.00	28,800.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,858,876.93
合计	-	5,858,876.93

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	231,003.54	-
AAA 以下	4,631.95	-
未评级	-	20,611,698.63
合计	235,635.49	20,611,698.63

注：上述评级均取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,375,708.16	-	-	346.63	3,376,054.79
结算备付金	1,817,567.81	-	-	159.03	1,817,726.84
存出保证金	20,092.16	-	-	1.71	20,093.87
交易性金融资产	-	-	235,631.00	46,783,452.94	47,019,083.94
应收申购款	-	-	-	10,113.57	10,113.57
应收清算款	-	-	-	2,349,977.30	2,349,977.30
资产总计	5,213,368.13	-	235,631.00	49,144,051.18	54,593,050.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,037.02	9,037.02
应付管理人报酬	-	-	-	25,048.18	25,048.18
应付托管费	-	-	-	8,349.38	8,349.38
应付清算款	-	-	-	2,717,478.54	2,717,478.54
应付销售服务费	-	-	-	7,124.13	7,124.13
应交税费	-	-	-	0.12	0.12
其他负债	-	-	-	91,675.14	91,675.14
负债总计	-	-	-	2,858,712.51	2,858,712.51
利率敏感度缺口	5,213,368.13	-	235,631.00	46,285,338.67	51,734,337.80
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	206,408.55	-	-	913.77	207,322.32
结算备付金	1,019,869.98	-	-	99.20	1,019,969.18
存出保证金	28,509.39	-	-	2.80	28,512.19
交易性金融资产	25,863,650.00	-	-	8,793,494.99	34,657,144.99
买入返售金融资产	11,000,000.00	-	-	-1,237.87	10,998,762.13
应收申购款	-	-	-	55,530.21	55,530.21
资产总计	38,118,437.92	-	-	8,848,803.10	46,967,241.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,852.04	21,852.04
应付管理人报酬	-	-	-	68,322.25	68,322.25
应付托管费	-	-	-	22,774.08	22,774.08
应付清算款	-	-	-	87,537.16	87,537.16
应付销售服务费	-	-	-	14,247.81	14,247.81
其他负债	-	-	-	151,952.43	151,952.43
负债总计	-	-	-	366,685.77	366,685.77
利率敏感度缺口	38,118,437.92	-	-	8,482,117.33	46,600,555.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）
	1.市场利率下降 25 个基点	-	12,745.92
	2.市场利率上升 25 个基点	-	-12,745.92

注：本基金本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	46,783,448.45	90.43	8,186,569.43	17.57
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,783,448.45	90.43	8,186,569.43	17.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.业绩比较基准上升 5%	3,183,029.11	-
	2.业绩比较基准下降 5%	-3,183,029.11	-

注：本基金上年度末未持有交易性权益类投资或持有的交易性权益类投资占比并不重大，因此除

市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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	46,491,236.47	8,048,918.76
第二层次	261,803.57	26,470,575.56
第三层次	266,043.90	137,650.67
合计	47,019,083.94	34,657,144.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	46,783,448.45	85.69
	其中：股票	46,783,448.45	85.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	235,635.49	0.43
	其中：债券	235,635.49	0.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,193,781.63	9.51
8	其他各项资产	2,380,184.74	4.36
9	合计	54,593,050.31	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	149,592.00	0.29
B	采矿业	725,695.00	1.40
C	制造业	32,991,089.68	63.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,863,216.00	3.60
E	建筑业	759,970.00	1.47
F	批发和零售业	499,366.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	1,340,611.00	2.59
H	住宿和餐饮业	48,573.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,346,957.30	6.47
J	金融业	2,419,800.00	4.68
K	房地产业	406,775.00	0.79
L	租赁和商务服务业	591,837.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	557,197.78	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	637,203.69	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	3,045.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	438,759.00	0.85
S	综合	3,761.00	0.01
	合计	46,783,448.45	90.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300604	长川科技	1,900	648,698.00	1.25
2	300857	协创数据	1,700	577,830.00	1.12
3	002281	光迅科技	2,200	565,268.00	1.09
4	688347	华虹宏力	1,589	534,380.70	1.03
5	301308	江波龙	700	492,660.00	0.95
6	002353	杰瑞股份	3,100	472,750.00	0.91
7	600549	厦门钨业	5,400	460,080.00	0.89
8	002436	兴森科技	8,500	433,075.00	0.84
9	000657	中钨高新	4,500	430,740.00	0.83
10	300223	北京君正	1,500	373,350.00	0.72
11	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.72
12	002851	麦格米特	2,200	367,796.00	0.71
13	300054	鼎龙股份	3,300	349,701.00	0.68
14	300567	精测电子	1,100	349,360.00	0.68
15	600498	烽火通信	4,600	338,560.00	0.65
16	300285	国瓷材料	3,200	330,176.00	0.64
17	002138	顺络电子	4,400	321,640.00	0.62
18	002185	华天科技	14,300	319,033.00	0.62
19	300395	菲利华	2,300	307,579.00	0.59
20	300136	信维通信	2,500	298,125.00	0.58
21	688120	华海清科	923	297,372.14	0.57
22	688469	芯联集成	27,883	295,838.63	0.57
23	002409	雅克科技	1,300	291,850.00	0.56
24	688002	睿创微纳	1,870	289,270.30	0.56
25	300570	太辰光	1,100	271,381.00	0.52
26	600392	盛和资源	9,100	270,907.00	0.52
27	002273	水晶光电	7,500	266,100.00	0.51
28	688783	西安奕材	4,643	266,043.90	0.51
29	001389	广合科技	1,100	260,975.00	0.50
30	301536	星宸科技	2,000	257,420.00	0.50
31	002195	岩山科技	39,300	257,022.00	0.50
32	000783	长江证券	26,200	255,450.00	0.49

33	688017	绿的谐波	600	250,716.00	0.48
34	600497	驰宏锌锗	20,100	243,411.00	0.47
35	600909	华安证券	21,900	243,309.00	0.47
36	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.45
37	000021	深科技	3,600	231,372.00	0.45
38	688052	纳芯微	800	230,648.00	0.45
39	300058	蓝色光标	16,600	228,416.00	0.44
40	300017	网宿科技	17,300	225,073.00	0.44
41	300458	全志科技	5,600	220,976.00	0.43
42	300373	扬杰科技	1,400	220,122.00	0.43
43	688777	中控技术	1,843	216,552.50	0.42
44	600456	宝钛股份	7,700	210,595.00	0.41
45	002008	大族激光	1,400	210,154.00	0.41
46	600563	法拉电子	1,100	209,880.00	0.41
47	601991	大唐发电	29,200	206,736.00	0.40
48	605589	圣泉集团	3,200	203,424.00	0.39
49	002271	东方雨虹	16,900	200,603.00	0.39
50	300012	华测检测	14,400	199,584.00	0.39
51	688301	奕瑞科技	1,600	198,400.00	0.38
52	002756	永兴材料	3,500	198,240.00	0.38
53	002025	航天电器	2,600	198,172.00	0.38
54	300623	捷捷微电	4,400	197,956.00	0.38
55	688676	金盘科技	2,321	196,449.44	0.38
56	002444	巨星科技	6,300	195,930.00	0.38
57	000060	中金岭南	25,400	192,278.00	0.37
58	603920	世运电路	4,000	192,160.00	0.37
59	603688	石英股份	2,300	190,003.00	0.37
60	000960	锡业股份	4,400	187,836.00	0.36
61	603290	斯达半导	1,200	183,528.00	0.35
62	000623	吉林敖东	10,300	182,619.00	0.35
63	601717	中创智领	12,900	179,439.00	0.35
64	002065	东华软件	25,100	179,214.00	0.35
65	605358	立昂微	2,300	178,480.00	0.34
66	603345	安井食品	2,200	176,418.00	0.34
67	002841	视源股份	5,100	176,103.00	0.34
68	603699	纽威股份	3,500	176,050.00	0.34
69	600642	申能股份	20,100	175,473.00	0.34
70	601128	常熟银行	30,100	175,182.00	0.34
71	600312	平高电气	9,900	174,834.00	0.34
72	000032	深桑达 A	7,000	174,650.00	0.34
73	600369	西南证券	43,300	174,066.00	0.34
74	000683	博源化工	29,900	172,224.00	0.33
75	600153	建发股份	21,700	172,081.00	0.33

76	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.33
77	600109	国金证券	19,400	170,332.00	0.33
78	002266	浙富控股	33,100	167,486.00	0.32
79	601000	唐山港	39,800	165,170.00	0.32
80	600483	福能股份	16,200	165,078.00	0.32
81	600008	首创环保	60,600	164,832.00	0.32
82	000997	新 大 陆	10,100	164,630.00	0.32
83	002152	广电运通	17,400	163,212.00	0.32
84	603338	浙江鼎力	3,800	161,500.00	0.31
85	600282	南钢股份	35,100	161,109.00	0.31
86	603816	顾家家居	7,200	160,992.00	0.31
87	600583	海油工程	32,000	160,960.00	0.31
88	000951	中国重汽	8,200	159,982.00	0.31
89	002203	海亮股份	7,000	159,950.00	0.31
90	600820	隧道股份	30,700	159,947.00	0.31
91	002410	广联达	19,600	159,936.00	0.31
92	600398	海澜之家	30,400	158,992.00	0.31
93	601156	东航物流	9,800	157,976.00	0.31
94	600816	建元信托	63,800	155,672.00	0.30
95	000528	柳　　工	20,600	155,530.00	0.30
96	601608	中信重工	32,600	155,502.00	0.30
97	000598	兴蓉环境	24,200	155,364.00	0.30
98	600535	天士力	11,700	154,791.00	0.30
99	000883	湖北能源	35,600	153,792.00	0.30
100	002299	圣农发展	10,100	153,116.00	0.30
101	002120	韵达股份	24,000	152,640.00	0.30
102	603000	人民网	10,300	152,337.00	0.29
103	000088	盐 田 港	37,000	151,330.00	0.29
104	600598	北大荒	13,800	149,592.00	0.29
105	000709	河钢股份	76,600	148,604.00	0.29
106	000825	太钢不锈	43,500	148,335.00	0.29
107	601598	中国外运	29,800	147,808.00	0.29
108	688563	航材股份	2,885	147,798.55	0.29
109	002984	森麒麟	11,300	147,691.00	0.29
110	600848	上海临港	19,700	147,553.00	0.29
111	601098	中南传媒	14,900	146,616.00	0.28
112	600295	鄂尔多斯	13,600	145,792.00	0.28
113	601966	玲珑轮胎	14,300	145,717.00	0.28
114	600968	海油发展	43,500	144,855.00	0.28
115	002508	老板电器	9,900	144,738.00	0.28
116	002155	湖南黄金	6,000	143,220.00	0.28
117	000537	绿发电力	19,500	142,545.00	0.28
118	600098	广州发展	24,000	141,840.00	0.27

119	000733	振华科技	2,500	141,600.00	0.27
120	603833	欧派家居	4,700	141,517.00	0.27
121	600131	国网信通	9,600	140,160.00	0.27
122	600764	中国海防	8,000	139,440.00	0.27
123	601139	深圳燃气	24,600	139,236.00	0.27
124	688582	芯动联科	2,120	137,800.00	0.27
125	603156	养元饮品	2,800	137,396.00	0.27
126	002402	和而泰	5,300	136,899.00	0.26
127	600499	科达制造	9,900	136,620.00	0.26
128	688692	达梦数据	558	136,313.82	0.26
129	601799	星宇股份	1,500	135,930.00	0.26
130	688615	合合信息	1,200	135,720.00	0.26
131	000898	鞍钢股份	71,900	134,453.00	0.26
132	300724	捷佳伟创	1,900	134,140.00	0.26
133	601880	辽港股份	97,100	133,998.00	0.26
134	001286	陕西能源	13,200	133,848.00	0.26
135	300140	节能环境	26,700	132,699.00	0.26
136	300679	电连技术	2,200	131,978.00	0.26
137	600566	济川药业	5,900	130,921.00	0.25
138	600299	安迪苏	16,600	130,310.00	0.25
139	000423	东阿阿胶	2,800	127,008.00	0.25
140	600901	江苏金租	22,000	126,500.00	0.24
141	003031	中瓷电子	700	126,210.00	0.24
142	601665	齐鲁银行	21,500	124,055.00	0.24
143	600637	东方明珠	14,800	122,988.00	0.24
144	603766	隆鑫通用	9,900	118,107.00	0.23
145	601997	贵阳银行	22,900	117,477.00	0.23
146	688172	燕东微	1,400	117,124.00	0.23
147	600765	中航重机	9,000	116,280.00	0.22
148	600704	物产中大	24,500	115,640.00	0.22
149	002850	科达利	600	113,580.00	0.22
150	688037	芯源微	253	111,079.65	0.21
151	000987	越秀资本	14,100	110,262.00	0.21
152	600998	九州通	23,300	109,277.00	0.21
153	002500	山西证券	21,100	108,876.00	0.21
154	601228	广州港	38,600	108,852.00	0.21
155	600170	上海建工	48,900	108,558.00	0.21
156	000009	中国宝安	17,400	108,402.00	0.21
157	600329	达仁堂	2,900	107,938.00	0.21
158	300735	光弘科技	4,700	106,878.00	0.21
159	600038	中直股份	4,200	106,218.00	0.21
160	600988	赤峰黄金	4,000	105,280.00	0.20
161	688322	奥比中光	800	104,440.00	0.20

162	600380	健康元	11,000	103,620.00	0.20
163	600970	中材国际	14,500	103,385.00	0.20
164	600132	重庆啤酒	2,500	103,250.00	0.20
165	300146	汤臣倍健	11,300	102,152.00	0.20
166	300346	南大光电	1,100	101,915.00	0.20
167	600801	华新建材	6,500	101,400.00	0.20
168	000027	深圳能源	16,300	101,060.00	0.20
169	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.19
170	300144	宋城演艺	17,300	100,513.00	0.19
171	600967	内蒙一机	9,200	99,820.00	0.19
172	002926	华西证券	12,200	99,674.00	0.19
173	600004	白云机场	13,700	99,462.00	0.19
174	002032	苏 泊 尔	2,500	99,000.00	0.19
175	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.19
176	603565	中谷物流	10,000	98,100.00	0.19
177	601928	凤凰传媒	11,100	97,569.00	0.19
178	688425	铁建重工	23,954	96,295.08	0.19
179	600062	华润双鹤	6,000	96,240.00	0.19
180	603233	大参林	6,400	96,192.00	0.19
181	002837	英维克	1,200	95,472.00	0.18
182	002265	建设工业	5,400	93,960.00	0.18
183	301301	川宁生物	11,600	92,104.00	0.18
184	601019	山东出版	14,100	90,240.00	0.17
185	600927	永安期货	7,200	89,640.00	0.17
186	002461	珠江啤酒	11,700	88,569.00	0.17
187	688778	厦钨新能	1,608	87,475.20	0.17
188	002202	金风科技	3,600	86,040.00	0.17
189	688018	乐鑫科技	669	85,578.48	0.17
190	002821	凯莱英	500	81,000.00	0.16
191	002340	格林美	12,100	79,981.00	0.15
192	600141	兴发集团	1,700	79,849.00	0.15
193	002131	利欧股份	16,700	79,325.00	0.15
194	601233	桐昆股份	3,600	77,940.00	0.15
195	002532	天山铝业	7,200	77,256.00	0.15
196	002738	中矿资源	1,300	76,687.00	0.15
197	601108	财通证券	8,800	76,120.00	0.15
198	300390	天华新能	800	74,808.00	0.14
199	002126	银轮股份	1,500	74,700.00	0.14
200	600879	航天电子	3,500	74,515.00	0.14
201	002056	横店东磁	2,400	73,152.00	0.14
202	002465	海格通信	5,600	71,512.00	0.14
203	601958	金钼股份	2,500	70,275.00	0.14
204	000893	亚钾国际	1,700	69,513.00	0.13

205	603650	彤程新材	700	68,586.00	0.13
206	002429	兆驰股份	6,600	68,574.00	0.13
207	601615	明阳智能	5,900	68,263.00	0.13
208	300454	深信服	700	67,340.00	0.13
209	002078	太阳纸业	5,300	66,197.00	0.13
210	300957	贝泰妮	2,100	66,171.00	0.13
211	601696	中银证券	5,200	65,780.00	0.13
212	002064	华峰化学	6,900	65,481.00	0.13
213	300487	蓝晓科技	1,100	64,735.00	0.13
214	300432	富临精工	3,200	64,288.00	0.12
215	002831	裕同科技	1,800	64,008.00	0.12
216	688248	南网科技	916	63,368.88	0.12
217	300699	光威复材	2,200	63,030.00	0.12
218	301086	鸿富瀚	300	62,784.00	0.12
219	300073	当升科技	1,300	62,452.00	0.12
220	603806	福斯特	3,700	62,123.00	0.12
221	000750	国海证券	16,800	61,824.00	0.12
222	301321	翰博高新	1,400	61,810.00	0.12
223	688099	晶晨股份	600	61,740.00	0.12
224	600862	中航高科	3,400	61,302.00	0.12
225	300919	中伟新材	1,400	61,250.00	0.12
226	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.12
227	000415	渤海租赁	14,600	59,422.00	0.11
228	002223	鱼跃医疗	2,300	59,018.00	0.11
229	301189	奥尼电子	1,000	58,930.00	0.11
230	601212	白银有色	11,600	58,928.00	0.11
231	000155	川能动力	4,900	58,702.00	0.11
232	600332	白云山	2,900	58,116.00	0.11
233	605289	罗曼股份	400	58,000.00	0.11
234	601216	君正集团	13,000	57,980.00	0.11
235	688209	英集芯	1,992	57,927.36	0.11
236	000039	中集集团	7,100	57,581.00	0.11
237	600118	中国卫星	700	57,435.00	0.11
238	603077	和邦生物	24,700	57,304.00	0.11
239	000932	华菱钢铁	16,500	57,255.00	0.11
240	688173	希荻微	2,971	56,864.94	0.11
241	000738	航发控制	3,100	56,699.00	0.11
242	603150	万朗磁塑	800	56,640.00	0.11
243	300002	神州泰岳	7,200	56,232.00	0.11
244	300488	恒锋工具	1,200	56,196.00	0.11
245	688609	九联科技	5,101	56,162.01	0.11
246	603223	恒通股份	4,300	56,115.00	0.11
247	002007	华兰生物	4,600	56,074.00	0.11

248	688511	天微电子	1,854	56,009.34	0.11
249	300635	中达安	4,600	55,982.00	0.11
250	300948	冠中生态	2,100	55,923.00	0.11
251	600166	福田汽车	19,200	55,872.00	0.11
252	688620	安凯微	3,440	55,728.00	0.11
253	002861	瀛通通讯	2,500	55,700.00	0.11
254	000591	太阳能	12,100	55,660.00	0.11
255	688299	长阳科技	3,329	55,627.59	0.11
256	301280	珠城科技	1,100	55,627.00	0.11
257	301502	华阳智能	800	55,616.00	0.11
258	688388	嘉元科技	1,261	55,484.00	0.11
259	600714	金瑞矿业	2,700	55,431.00	0.11
260	300606	金太阳	1,300	55,328.00	0.11
261	300786	国林科技	2,200	55,154.00	0.11
262	688218	江苏北人	1,000	54,960.00	0.11
263	688653	康希通信	3,162	54,955.56	0.11
264	301198	喜悦智行	4,100	54,940.00	0.11
265	301203	国泰环保	1,300	54,925.00	0.11
266	300745	欣锐科技	1,300	54,886.00	0.11
267	600435	北方导航	4,900	54,880.00	0.11
268	301295	美硕科技	1,300	54,834.00	0.11
269	002972	科安达	2,800	54,768.00	0.11
270	600511	国药股份	2,100	54,684.00	0.11
271	603596	伯特利	2,200	54,648.00	0.11
272	301448	开创电气	1,200	54,456.00	0.11
273	001373	翔腾新材	1,800	54,270.00	0.10
274	600159	大龙地产	24,400	53,924.00	0.10
275	688667	菱电电控	403	53,860.95	0.10
276	300112	万讯自控	8,700	53,853.00	0.10
277	688737	中自科技	2,811	53,802.54	0.10
278	601567	三星电气	3,600	53,784.00	0.10
279	605588	冠石科技	800	53,736.00	0.10
280	002391	长青股份	11,000	53,570.00	0.10
281	301273	瑞晨环保	1,700	53,567.00	0.10
281	301372	科净源	1,700	53,567.00	0.10
282	688051	佳华科技	2,330	53,543.40	0.10
283	601106	中国一重	16,200	53,460.00	0.10
284	000573	粤宏远 A	15,100	53,454.00	0.10
285	600685	中船防务	2,100	53,424.00	0.10
286	300405	科隆股份	10,300	53,354.00	0.10
287	300417	南华仪器	5,200	53,352.00	0.10
288	300656	民德电子	1,400	53,326.00	0.10
289	600533	栖霞建设	28,200	53,298.00	0.10

290	603990	麦迪科技	2,500	53,225.00	0.10
291	300535	达威股份	3,900	53,157.00	0.10
292	300106	西部牧业	5,400	53,136.00	0.10
293	600502	安徽建工	12,200	53,070.00	0.10
294	601399	国机重装	15,100	52,850.00	0.10
295	002133	广宇集团	22,100	52,819.00	0.10
296	301037	保立佳	4,400	52,800.00	0.10
297	688081	兴图新科	1,291	52,776.08	0.10
298	301272	英华特	1,600	52,704.00	0.10
299	301252	同星科技	1,300	52,689.00	0.10
300	688398	赛特新材	2,030	52,597.30	0.10
301	603679	华体科技	2,600	52,468.00	0.10
302	603829	洛凯股份	3,200	52,384.00	0.10
303	301571	国科天成	800	52,144.00	0.10
304	603519	立霸股份	3,400	52,020.00	0.10
305	301371	敷尔佳	2,000	52,000.00	0.10
306	002154	报 喜 鸟	14,600	51,976.00	0.10
307	688030	山石网科	3,288	51,917.52	0.10
308	002244	滨江集团	6,800	51,680.00	0.10
308	002803	吉宏股份	2,000	51,680.00	0.10
309	000739	普洛药业	3,100	51,646.00	0.10
310	301024	霍普股份	1,400	51,548.00	0.10
311	601865	福莱特	4,900	51,499.00	0.10
312	601666	平煤股份	7,200	51,480.00	0.10
313	300478	杭州高新	1,400	51,366.00	0.10
314	601155	新城控股	5,000	51,300.00	0.10
315	603790	雅运股份	2,400	51,216.00	0.10
316	603341	龙旗科技	1,200	50,988.00	0.10
317	688156	路德科技	1,676	50,699.00	0.10
318	603737	三棵树	2,100	50,610.00	0.10
319	600517	国网英大	10,800	50,544.00	0.10
320	300985	致远新能	1,300	50,050.00	0.10
321	300938	信测标准	1,000	49,880.00	0.10
322	688199	久日新材	1,441	49,757.73	0.10
323	603858	步长制药	3,400	49,640.00	0.10
324	603356	华菱精工	3,000	49,560.00	0.10
325	603899	晨光股份	2,400	49,512.00	0.10
326	301169	零点有数	700	49,462.00	0.10
327	688561	奇安信	2,045	49,039.10	0.09
328	300718	长盛轴承	800	48,776.00	0.09
329	605068	明新旭腾	2,900	48,662.00	0.09
330	600754	锦江酒店	2,700	48,573.00	0.09
331	002328	新朋股份	6,600	48,444.00	0.09

332	002153	石基信息	6,700	48,441.00	0.09
333	003035	南网能源	8,300	48,306.00	0.09
334	002998	优彩资源	7,400	48,174.00	0.09
335	600808	马钢股份	19,000	47,500.00	0.09
336	688178	万德斯	1,400	47,334.00	0.09
337	688355	明志科技	2,446	47,085.50	0.09
338	603121	华培动力	4,000	47,000.00	0.09
339	600606	绿地控股	38,800	46,948.00	0.09
340	688004	博汇科技	2,572	46,810.40	0.09
341	300097	智云股份	5,000	45,400.00	0.09
342	300605	恒锋信息	4,900	45,276.00	0.09
343	603186	华正新材	200	45,060.00	0.09
344	301498	乖宝宠物	1,100	44,649.00	0.09
345	300767	震安科技	2,000	44,580.00	0.09
346	688038	中科通达	2,643	44,455.26	0.09
347	603289	泰瑞机器	5,500	44,385.00	0.09
348	001221	悍高集团	1,100	44,242.00	0.09
349	002800	天顺股份	3,400	44,166.00	0.09
350	300681	英搏尔	1,500	42,930.00	0.08
351	003023	彩虹集团	2,200	42,768.00	0.08
352	002888	惠威科技	1,900	41,762.00	0.08
353	688060	云涌科技	1,268	41,704.52	0.08
354	688096	京源环保	3,084	41,202.24	0.08
355	603726	朗迪集团	1,200	41,100.00	0.08
356	301072	中捷精工	1,000	41,010.00	0.08
357	002624	完美世界	3,300	40,986.00	0.08
358	603116	红蜻蜓	7,200	40,896.00	0.08
359	300909	汇创达	700	40,754.00	0.08
360	300450	先导智能	1,000	40,720.00	0.08
361	001360	南矿集团	2,300	40,687.00	0.08
362	002057	中钢天源	3,200	39,776.00	0.08
363	605111	新洁能	400	39,656.00	0.08
364	301057	汇隆新材	1,700	39,100.00	0.08
365	688565	力源科技	4,121	38,943.45	0.08
366	688061	灿瑞科技	781	38,792.27	0.07
367	688328	深科达	405	38,758.50	0.07
368	600546	山煤国际	3,500	38,255.00	0.07
369	688683	莱尔科技	1,005	38,109.60	0.07
370	601866	中远海发	17,100	37,791.00	0.07
371	301429	森泰股份	2,400	37,608.00	0.07
372	688629	华丰科技	200	37,502.00	0.07
373	600582	天地科技	8,400	37,380.00	0.07
374	300037	新宙邦	400	37,140.00	0.07

375	301181	标榜股份	1,600	37,024.00	0.07
376	002966	苏州银行	5,300	36,888.00	0.07
377	688220	翱捷科技	296	36,798.72	0.07
378	688035	德邦科技	400	36,720.00	0.07
379	300949	奥雅股份	1,800	36,306.00	0.07
380	002247	聚力文化	17,200	36,292.00	0.07
381	603738	泰晶科技	600	36,030.00	0.07
382	688531	日联科技	200	35,568.00	0.07
383	301227	森鹰窗业	1,400	35,294.00	0.07
384	688291	金橙子	600	35,088.00	0.07
385	002949	华阳国际	3,500	34,615.00	0.07
386	002079	苏州固锝	2,300	34,569.00	0.07
387	605186	健麾信息	1,100	34,496.00	0.07
388	688701	卓锦股份	4,573	34,434.69	0.07
389	300958	建工修复	3,200	34,048.00	0.07
390	605318	法狮龙	300	33,858.00	0.07
391	688045	必易微	419	33,846.82	0.07
392	300281	金明精机	5,400	32,562.00	0.06
393	600493	凤竹纺织	6,200	32,488.00	0.06
394	688260	昀冢科技	200	28,800.00	0.06
395	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.05
396	000582	北部湾港	2,600	27,898.00	0.05
397	300074	华平股份	7,900	26,860.00	0.05
398	301045	天禄科技	300	26,724.00	0.05
399	002384	东山精密	100	26,235.00	0.05
400	300270	中威电子	2,000	26,020.00	0.05
401	688693	锴威特	248	25,779.60	0.05
402	002849	威星智能	1,500	25,380.00	0.05
403	688296	和达科技	2,185	24,996.40	0.05
404	600232	金鹰股份	3,900	24,570.00	0.05
405	688266	泽璟制药	200	23,332.00	0.05
406	688608	恒玄科技	136	22,737.84	0.04
407	000831	中国稀土	400	22,196.00	0.04
408	688375	国博电子	200	20,860.00	0.04
409	002890	弘宇股份	1,400	20,006.00	0.04
410	688090	瑞松科技	170	18,096.50	0.03
411	601336	新华保险	300	17,898.00	0.03
412	301122	采纳股份	600	17,646.00	0.03
413	600692	亚通股份	3,000	16,290.00	0.03
414	600641	先导基电	400	15,944.00	0.03
415	688318	财富趋势	206	14,689.86	0.03
416	002968	新大正	1,700	14,382.00	0.03
417	688011	新光光电	204	14,253.48	0.03

418	301326	捷邦科技	100	13,937.00	0.03
419	688385	复旦微电	186	13,259.94	0.03
420	688638	誉辰智能	421	13,122.57	0.03
421	601319	中国人保	1,900	12,844.00	0.02
422	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.02
423	002484	江海股份	100	10,500.00	0.02
424	688356	键凯科技	134	10,328.72	0.02
425	601688	华泰证券	500	10,310.00	0.02
426	002080	中材科技	100	9,000.00	0.02
427	300844	山水比德	400	8,884.00	0.02
428	600941	中国移动	100	8,613.00	0.02
429	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.01
430	002156	通富微电	100	7,587.00	0.01
431	300836	佰奥智能	100	7,399.00	0.01
432	603228	景旺电子	100	7,241.00	0.01
433	301631	壹连科技	100	7,186.00	0.01
434	301328	维峰电子	100	7,120.00	0.01
435	300331	苏大维格	100	7,111.00	0.01
436	601628	中国人寿	200	7,070.00	0.01
437	002432	九安医疗	100	7,068.00	0.01
438	001259	利仁科技	100	6,697.00	0.01
439	301580	爱迪特	100	6,433.00	0.01
440	601126	四方股份	100	6,320.00	0.01
441	000708	中信特钢	500	6,310.00	0.01
442	002552	宝鼎科技	100	6,100.00	0.01
443	600561	江西长运	1,200	5,940.00	0.01
444	300508	维宏股份	100	5,743.00	0.01
445	601601	中国太保	200	5,704.00	0.01
446	688378	奥来德	91	5,642.00	0.01
447	603989	艾华集团	100	5,250.00	0.01
448	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.01
449	688309	恒誉环保	81	4,931.28	0.01
450	601318	中国平安	100	4,774.00	0.01
451	301087	可孚医疗	100	4,765.00	0.01
452	300943	春晖智控	100	4,495.00	0.01
453	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.01
454	301020	密封科技	200	4,368.00	0.01
455	002335	科华数据	100	4,245.00	0.01
456	603786	科博达	100	4,091.00	0.01
457	002885	京泉华	100	4,086.00	0.01
458	688293	奥浦迈	90	3,752.10	0.01
459	000651	格力电器	100	3,750.00	0.01
460	002955	鸿合科技	100	3,575.00	0.01

461	001268	联合精密	100	3,542.00	0.01
462	002876	三利谱	100	3,521.00	0.01
463	600885	宏发股份	100	3,449.00	0.01
464	600673	东阳光	100	3,358.00	0.01
465	000426	兴业银锡	100	3,296.00	0.01
466	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.01
467	002787	华源控股	100	3,220.00	0.01
468	002959	小熊电器	100	3,172.00	0.01
469	301239	普瑞眼科	100	3,045.00	0.01
470	600096	云天化	100	3,040.00	0.01
471	301222	浙江恒威	100	2,996.00	0.01
472	000513	丽珠集团	100	2,889.00	0.01
473	000963	华东医药	100	2,812.00	0.01
474	300899	上海凯鑫	100	2,769.00	0.01
475	002558	巨人网络	100	2,756.00	0.01
476	002921	联诚精密	100	2,734.00	0.01
477	000429	粤高速 A	200	2,730.00	0.01
478	601168	西部矿业	100	2,714.00	0.01
479	002414	高德红外	200	2,652.00	0.01
480	600900	长江电力	100	2,647.00	0.01
481	601881	中国银河	200	2,514.00	0.00
481	601899	紫金矿业	100	2,514.00	0.00
482	600976	健民集团	100	2,491.00	0.00
483	000959	首钢股份	700	2,457.00	0.00
484	600352	浙江龙盛	200	2,422.00	0.00
485	002318	久立特材	100	2,390.00	0.00
486	603298	杭叉集团	100	2,386.00	0.00
487	300837	浙矿股份	100	2,376.00	0.00
487	601555	东吴证券	300	2,376.00	0.00
488	300003	乐普医疗	200	2,370.00	0.00
489	605009	豪悦护理	100	2,331.00	0.00
490	002128	电投能源	100	2,312.00	0.00
491	600177	雅戈尔	300	2,259.00	0.00
492	000895	双汇发展	100	2,240.00	0.00
493	301206	三元生物	100	2,223.00	0.00
494	002868	绿康生化	100	2,209.00	0.00
495	300908	仲景食品	100	2,204.00	0.00
496	300700	岱勒新材	100	2,128.00	0.00
497	000933	神火股份	100	2,120.00	0.00
498	301027	华蓝集团	100	2,069.00	0.00
499	001368	通达创智	100	2,057.00	0.00
500	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.00
501	002853	皮阿诺	100	2,008.00	0.00

502	002673	西部证券	300	1,947.00	0.00
503	600663	陆家嘴	300	1,884.00	0.00
504	688772	珠海冠宇	89	1,747.07	0.00
505	300137	先河环保	100	1,744.00	0.00
506	600872	中炬高新	100	1,736.00	0.00
507	688510	航亚科技	71	1,695.48	0.00
508	688709	成都华微	44	1,675.96	0.00
509	002939	长城证券	200	1,668.00	0.00
510	601166	兴业银行	100	1,656.00	0.00
511	688671	碧兴物联	46	1,636.22	0.00
512	002517	恺英网络	100	1,625.00	0.00
513	000878	云南铜业	100	1,588.00	0.00
514	605005	合兴股份	100	1,581.00	0.00
515	001323	慕思股份	100	1,580.00	0.00
515	600803	新奥股份	100	1,580.00	0.00
516	603568	伟明环保	100	1,538.00	0.00
517	688349	三一重能	101	1,533.18	0.00
518	002884	凌霄泵业	100	1,524.00	0.00
519	002603	以岭药业	100	1,500.00	0.00
520	300931	通用电梯	100	1,477.00	0.00
521	600873	梅花生物	200	1,470.00	0.00
522	605266	健之佳	100	1,464.00	0.00
523	688281	华秦科技	29	1,456.67	0.00
524	600674	川投能源	100	1,417.00	0.00
525	603020	爱普股份	100	1,410.00	0.00
526	603201	常润股份	100	1,396.00	0.00
527	688329	艾隆科技	63	1,273.23	0.00
528	688479	友车科技	33	1,253.01	0.00
529	002275	桂林三金	100	1,219.00	0.00
530	000830	鲁西化工	100	1,200.00	0.00
531	601965	中国汽研	100	1,196.00	0.00
532	600587	新华医疗	100	1,188.00	0.00
533	000719	中原传媒	100	1,143.00	0.00
534	603107	上海汽配	100	1,135.00	0.00
535	603309	维力医疗	100	1,122.00	0.00
536	688528	秦川物联	122	1,115.08	0.00
537	603587	地素时尚	100	1,111.00	0.00
538	603071	物产环能	100	1,106.00	0.00
539	601811	新华文轩	100	1,094.00	0.00
540	002858	力盛体育	100	1,091.00	0.00
541	601061	中信金属	100	1,077.00	0.00
542	603035	常熟汽饰	100	1,062.00	0.00
543	002014	永新股份	100	1,056.00	0.00

544	300929	华骐环保	100	1,054.00	0.00
545	000967	盈峰环境	100	1,053.00	0.00
546	002818	富森美	100	1,039.00	0.00
547	002293	罗莱生活	100	989.00	0.00
548	601658	邮储银行	200	986.00	0.00
549	002283	天润工业	100	965.00	0.00
549	603408	建霖家居	100	965.00	0.00
550	603970	中农立华	100	963.00	0.00
551	002911	佛燃能源	100	949.00	0.00
552	000828	东莞控股	100	936.00	0.00
553	600479	千金药业	100	930.00	0.00
554	001965	招商公路	100	916.00	0.00
555	600639	浦东金桥	100	912.00	0.00
556	600461	洪城环境	100	906.00	0.00
557	603551	奥普科技	100	899.00	0.00
558	688533	上声电子	43	896.98	0.00
559	603600	永艺股份	100	887.00	0.00
560	600817	宇通重工	100	880.00	0.00
561	603648	畅联股份	100	858.00	0.00
562	603167	渤海轮渡	100	857.00	0.00
563	603909	建发合诚	100	853.00	0.00
564	603053	成都燃气	100	836.00	0.00
565	603012	创力集团	100	820.00	0.00
566	002372	伟星新材	100	819.00	0.00
567	600548	深高速	100	813.00	0.00
568	600283	钱江水利	100	802.00	0.00
569	600648	外高桥	100	799.00	0.00
570	600356	恒丰纸业	100	741.00	0.00
571	000848	承德露露	100	740.00	0.00
572	601827	三峰环境	100	727.00	0.00
573	600742	富维股份	100	724.00	0.00
574	688192	迪哲医药	18	718.74	0.00
575	600064	南京高科	100	713.00	0.00
576	603707	健友股份	100	707.00	0.00
577	000544	中原环保	100	697.00	0.00
577	002233	塔牌集团	100	697.00	0.00
578	603689	皖天然气	100	693.00	0.00
579	002763	汇洁股份	100	679.00	0.00
580	601065	江盐集团	100	671.00	0.00
581	600425	青松建化	200	654.00	0.00
582	300055	万邦达	100	643.00	0.00
583	300621	维业股份	100	635.00	0.00
584	600305	恒顺醋业	100	631.00	0.00

585	603018	华设集团	120	616.80	0.00
586	002591	恒大高新	100	612.00	0.00
587	605368	蓝天燃气	100	610.00	0.00
588	603357	设计总院	100	608.00	0.00
589	600987	航民股份	100	605.00	0.00
590	000089	深圳机场	100	603.00	0.00
591	300030	阳普医疗	100	581.00	0.00
592	600051	宁波联合	100	563.00	0.00
593	605001	威奥股份	100	545.00	0.00
594	603801	志邦家居	100	543.00	0.00
595	600874	创业环保	100	536.00	0.00
596	600123	兰花科创	100	534.00	0.00
597	002381	双箭股份	100	518.00	0.00
598	603878	武进不锈	100	514.00	0.00
599	603128	华贸物流	100	505.00	0.00
600	000906	浙商中拓	100	504.00	0.00
601	601801	皖新传媒	100	493.00	0.00
602	601107	四川成渝	100	488.00	0.00
603	600720	中交设计	100	482.00	0.00
604	600335	国机汽车	100	468.00	0.00
605	600795	国电电力	100	467.00	0.00
606	000529	广弘控股	100	426.00	0.00
607	000755	山西高速	100	424.00	0.00
608	601368	绿城水务	100	409.00	0.00
609	002316	亚联发展	100	406.00	0.00
610	600662	外服控股	100	403.00	0.00
610	600805	悦达投资	100	403.00	0.00
611	601968	宝钢包装	100	392.00	0.00
612	601158	重庆水务	100	386.00	0.00
613	000789	万年青	100	374.00	0.00
614	002662	峰璟股份	100	370.00	0.00
615	603866	桃李面包	100	368.00	0.00
616	000900	现代投资	100	346.00	0.00
617	600035	楚天高速	100	337.00	0.00
618	000629	钒钛股份	100	334.00	0.00
619	600790	轻纺城	100	327.00	0.00
620	603818	曲美家居	100	297.00	0.00
621	600959	江苏有线	100	289.00	0.00
622	601333	广深铁路	100	275.00	0.00
623	600017	日照港	100	250.00	0.00
624	688389	普门科技	17	166.43	0.00
625	688616	西力科技	16	161.60	0.00
626	600653	申华控股	100	150.00	0.00

627	920187	通领科技	5	92.05	0.00
628	688382	益方生物	1	18.00	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	601336	新华保险	2,080,073.00	4.46
2	601319	中国人保	1,770,658.00	3.80
3	600456	宝钛股份	1,418,704.00	3.04
4	605589	圣泉集团	1,268,015.00	2.72
5	600030	中信证券	1,221,506.00	2.62
6	601628	中国人寿	995,631.00	2.14
7	601688	华泰证券	902,361.00	1.94
8	000887	中鼎股份	852,851.00	1.83
9	000776	广发证券	833,683.00	1.79
10	301631	壹连科技	708,979.00	1.52
11	000708	中信特钢	646,159.00	1.39
12	000791	甘肃能源	598,426.00	1.28
13	300604	长川科技	542,000.00	1.16
14	002281	光迅科技	511,614.00	1.10
15	601601	中国太保	498,790.00	1.07
16	002353	杰瑞股份	477,111.00	1.02
17	603786	科博达	458,628.00	0.98
18	002008	大族激光	455,743.00	0.98
19	688092	爱科科技	449,994.94	0.97
20	000338	潍柴动力	447,175.00	0.96

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	601336	新华保险	1,778,061.00	3.82
2	601319	中国人保	1,516,533.00	3.25
3	600030	中信证券	1,318,715.00	2.83
4	605589	圣泉集团	1,126,908.00	2.42
5	601398	工商银行	965,038.00	2.07
6	601688	华泰证券	954,430.00	2.05
7	000887	中鼎股份	953,120.00	2.05
8	600456	宝钛股份	944,052.00	2.03
9	000776	广发证券	920,893.00	1.98
10	601628	中国人寿	850,790.00	1.83
11	301631	壹连科技	777,011.00	1.67
12	601288	农业银行	618,861.00	1.33
13	000791	甘肃能源	586,930.00	1.26

14	000708	中信特钢	548,742.00	1.18
15	688047	龙芯中科	531,590.69	1.14
16	000338	潍柴动力	496,878.12	1.07
17	688092	爱科科技	486,637.74	1.04
18	605196	华通线缆	480,681.00	1.03
19	300346	南大光电	479,616.00	1.03
20	300881	盛德鑫泰	465,955.00	1.00

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	81,509,306.89
卖出股票收入（成交）总额	44,420,883.13

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	235,635.49	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	235,635.49	0.46

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	110101	宝钛转债	2,310	231,003.54	0.45
2	118067	上 26 转债	20	2,631.92	0.01
3	111025	圣泉转债	20	2,000.03	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,093.87
2	应收清算款	2,349,977.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,113.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,380,184.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
长盛盛世混合 A	284	16,593.67	3,166,211.19	67.19	1,546,391.81	32.81
长盛盛世混合 C	273	102,224.56	26,875,790.58	96.30	1,031,514.50	3.70
合计	557	58,563.57	30,042,001.77	92.10	2,577,906.31	7.90

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

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	74.42

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛盛世混合 A	93.78	0.0020
	长盛盛世混合 C	580.42	0.0021
	合计	674.20	0.0021

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 11 日）基金份额总额	13,184,407.64	369,032,054.43
本报告期期初基金份额总额	5,472,277.16	24,803,597.18
本报告期基金总申购份额	436,865.18	3,891,536.19
减：本报告期基金总赎回份额	1,196,539.34	787,828.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,712,603.00	27,907,305.08

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议，公司副总经理郭堃同志不再担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”，专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2026 年 6 月 8 日起，石晓冉同志担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东北证券	1	51,329,764.22	40.84	22,887.65	40.88	-
中金公司	1	25,833,372.24	20.55	11,519.00	20.58	-
国泰海通	1	21,134,014.86	16.82	9,424.74	16.83	-
银河证券	1	19,109,005.76	15.20	8,521.01	15.22	-
长江证券	1	7,451,353.21	5.93	3,322.70	5.94	-
招商证券	2	824,191.80	0.66	309.08	0.55	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

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(%)

东北证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	885,571,000.00	77.19	-	-
国泰海通	15,765.77	47.65	-	-	-	-
银河证券	17,323.71	52.35	143,900,000.00	12.54	-	-
长江证券	-	-	117,800,000.00	10.27	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准

（1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。

（2）具有较强的研究服务能力、有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

（1）基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 6 日
2	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 6 日
3	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 6 日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
5	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
7	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基	中国证监会指定披露媒	2026 年 3 月 28 日

	金 2025 年年度报告	介	
8	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 15 日
10	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
11	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司关于调整长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 10 日
13	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日
14	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日
15	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 11 日
16	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 26 日
17	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 26 日
18	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 26 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 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	20260101~20260630	14,517,786.73	0.00	0.00	14,517,786.73	44.51
	2	20260101~20260630	9,115,689.67	0.00	0.00	9,115,689.67	27.95
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎							

回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；

2、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日