

景顺长城智享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：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 02 月 12 日(基金合同生效日)起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城智享混合型证券投资基金
基金简称	景顺长城智享混合
基金主代码	026709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 2 月 12 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	120,287,348.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和中长期资本增值。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。 （二）股票投资策略 本基金结合行业景气度研究，遵循“自下而上”的个股投资策略，利用我公司股票研究数据库（SRD）对企业进行深入细致的分析，并进一步挖掘出景气度向上且具有核心竞争力的个股。 （三）存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。 （四）债券投资策略 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。 （五）股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。 （1）时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。 （2）套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。 （3）合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

	（六）国债期货投资策略 本基金可投资国债期货，本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。 （七）股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 （八）资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。 （九）参与融资业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，对冲系统性风险，实现保值和锁定收益。 （十）信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债-新综合全价（1-3 年）指数收益率*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 本基金还可能投资港股通标的股票。除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	任航
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		叶才	谷澍

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	www.igwfm.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 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 2 月 12 日(基金合同生效日) - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	55,287,788.25
本期利润	130,259,943.13
加权平均基金份额本期利润	0.3454
本期加权平均净值利润率	33.16%
本期基金份额净值增长率	53.79%
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	37,322,712.03
期末可供分配基金份额利润	0.3103
期末基金资产净值	184,990,852.54
期末基金份额净值	1.5379
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	53.79%

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、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。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

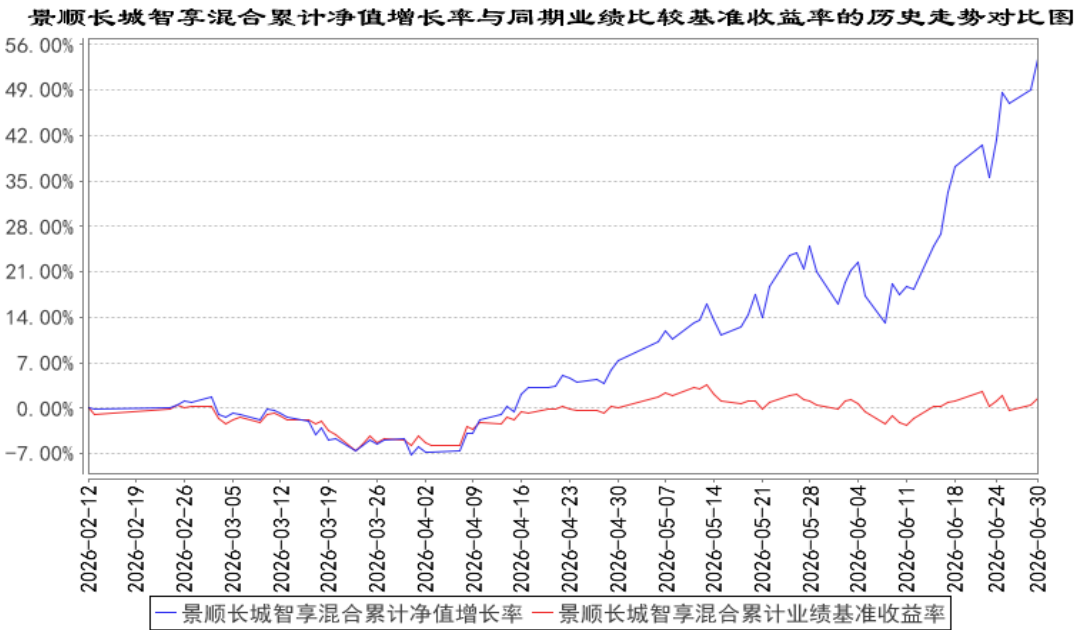
5、本基金基金合同生效日为 2026 年 02 月 12 日。

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	65.53%	2.37%	7.67%	1.02%	57.86%	1.35%
自基金合同生效起至今	53.79%	2.11%	1.47%	1.01%	52.32%	1.10%

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



注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2026 年 2 月 12 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2026 年 2 月 12 日）起至本报告期末不满一年。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
郭琳	本基金的基金经理	2026 年 2 月 12 日	-	12 年	理学硕士。曾任大成国际资产管理有限公司投资研究部高级研究员。2016 年 8 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理、研究部基金经理助理，自 2022 年 7 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

无。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资

基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 10 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，在一季度经济实现开门红之后，二季度经济呈现下滑的局面，主要是财政支出力度边际放缓的结果。二季度 GDP 同比增长 4.3%，相较一季度 5%的增速出现回落，但整个上半年依然实现了 4.7%的累计增速，处于经济增速目标区间的中沿。价格指数在二季度加速修复，二季度 GDP 平减指数同比上涨 1.4%，后续随着油价的回落和基数的走高，GDP 平减指数预计可能会回落，但近期中东地区冲突再度升温，后续油价的走势仍具备高度不确定性，从而对价格走势判断造成较大扰动。从 6 月的单月数据来看，内需方面，社零在基数走低的支撑下由负转正，回升至同比增长 1%，本月“以旧换新”的品类有明显修复。虽然社零数据在二季度下滑明显，但是口径更全的居民消费支出季度数据指向二季度居民消费边际回升，从 3.6%回升至 3.8%，说明社零的下滑更多受到“以旧换新”退坡的拖累，更广泛的居民服务消费韧性尚可。投资 6 月当月同比下滑 10%，与前值相比变化不大，制造业投资跌幅有所收敛，从-4.2%回升至-3.2%，基建投资下滑 10.2%，房地产投资下滑 24.4%，跌幅持平前值。6 月出口（美元计价）同比增速由前值 19.4%进一步上行至 27%，继续大超市场预期。AI 产业高景气度、关税扰动消退、中国供应链优势依旧是出口强劲表现的核心动力。除 AI 相关产品外，更广泛的机电产品、劳动密集型商品和原材料出口

都在 6 月迎来广谱的改善，出口品类的广谱改善或是受益于 6 月美伊和谈进展带动的油价显著回落背景下，对全球经济的压制大幅减轻。在出口大超预期的强劲表现下，生产端明显修复，工业增加值同比读数从 4.5%回升至 5.3%。即便生产还在持续强于需求，但是二季度产能利用率大幅走低，从 73.6%回落至 73%，距离历史最低点 72.9%（2016 年一季度）仅一步之遥，因此，后续价格企稳回升的内生动能仍然较弱。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 53.79%，业绩比较基准收益率为 1.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，出口韧性大概率持续，面对二季度内需加速下滑，7 月政治局会议预计将重新定调，推动超长期特别国债和专项债加快发行使用，并推动政策性金融工具加快落地，这有望带动基建投资提速，消费仍受居民就业和预期偏弱制约，预计维持低速弱修复，房地产市场延续“销售回暖、投资仍待企稳”的分化格局，PPI 同比涨幅受基数效应以及油价回落影响将有所放缓，整体经济将呈现“稳中承压、结构分化”的运行态势。

海外方面，6 月 FOMC 会议是新任主席沃什首秀，政策利率维持 3.5%-3.75%不变，但会议释放了强烈鹰派信号。经济预测摘要（SEP）大幅上调 2026 年 PCE 通胀预测至 3.6%（较 3 月上调 0.9 个百分点）。点阵图显示 18 位委员中半数预计年内至少加息一次，六人预期加息两次及以上，年底利率中值上修至 3.75%，市场紧缩定价明显升温。沃什本人公开批评点阵图参考价值有限，并宣布成立五大改革工作组，覆盖沟通机制、资产负债表、数据来源、AI 生产率与就业、通胀框架，核心思路是打破美联储长期“引导预期”的模式，改革方案预计 2026 年底成型、2027 年落地，未来市场波动率预计将持续抬升。就业方面，5 月非农新增 17.2 万人，远超预期的 8.8 万人，前两个月合计上修 9.3 万人，三个月均值升至 18.83 万人，为 2025 年 1 月以来新高，劳动力市场呈现超预期韧性。通胀方面，5 月 CPI 同比上行至 4.2%，能源分项是主要驱动；核心 CPI 环比 0.2%，弱于市场预期的 0.3%，核心商品价格环比转负，主要是因为关税通胀效应阶段性消退叠加油价高企对其他消费品类的挤出效应。核心通胀的边际走弱阶段性缓解了市场对通胀全面扩散的担忧，但能源高通胀令整体通胀难以快速回落。展望未来，财政退税的刺激效应或逐步减弱，高利率的紧缩效应或持续显现，基本面压力边际加大，随着美伊冲突和谈进展良好，油价已出现快速回落，三季度通胀或将迎来回落，届时紧缩预期或逐步缓解，若就业市场超预期走弱，市场或重新定价美联储的宽松预期。

总结来说，2026 年上半年市场在“AI 产业催化、两存 IPO 临近、美联储转鹰”三组力量拉锯下波动加剧，结构性机会与阶段性兑现压力并存。从产业进展的角度，科技创新中长期趋势和进

展仍在分歧中推进，中美 AI 领域均有突破性进展，头部模型厂迭代加速，ARR 环比仍然健康，中尾部的云厂商出现洗牌，策略转型并更加聚焦。AI 上游各个环节有不同程度的紧缺，供需错配未见缓解。同时半导体自主可控的产业景气度较好，国内扩产超预期带来订单上修，全球半导体产能的紧缺也带来国产替代加速的机遇。

基金整体风格偏均衡，选股逻辑和投资理念没有发生变化，聚焦在科技创新、成长领域，优选符合产业趋势、具备核心竞争优势的企业，同时结构上更加均衡，科技主线当前位置较高波动加大；我们更注重企业的自由现金流、股东回报和估值水平。进入二季度，地缘风险逐步消化脱敏，市场风险偏好开始修复。基金也逐步调整了结构，提升了仓位至 85%左右，布局的核心方向包括季报超预期的个股及板块，以及围绕科技成长产业进展超预期兑现的板块。二季度，在科技成长方向的选股和配置均体现出一定的超额收益。

报告期内，市场表现较为分化，沪深 300 指数上涨 7.55%，中小 100 指数上涨 17.26%，科创 50 指数上涨 65.25%。行业方面表现分化，根据申万一级行业指数，电子(+86.29%)、通信(+73.59%)表现突出；商贸零售、农林牧渔、美容护理板块表现落后。港股方面，恒生指数下跌 10.73%，恒生国企指数下跌 15.21%，恒生科技指数下跌 18.92%。

投资策略上，我们依然坚定围绕创新与安全方向来构建组合，每个时代有每个时代的特征，科技创新是中国未来 5-10 年最强 alpha 的产业方向，同时伴随着自主可控及能源安全。长期核心看好的方向包括：1) 半导体自主可控景气度也持续向好，订单有所上修带来板块性机会，核心布局半导体设备、材料、零部件环节；国产算力进展顺利催化持续释放，且逐步从订单向业绩兑现转换，芯片环节持续紧张供需错配，优选核心芯片及晶圆厂；海外与国内 AI 产业趋势共振，在上中下游形成闭环，看好上游环节，优选性价比较高、确定性较强的龙头企业；2) 电力设备方向优选储能、锂电相关，一方面地缘冲突后全球对新能源的需求长期增加，其次优选业绩兑现度高、供需紧张的环节和个股；3) 顺周期板块下半年预计或有机会，目前已经看到通用制造业不同环节出现不同程度的复苏，该板块大部分公司估值性价比较好，下半年预计能见度和确定性会有所增强。

我们对中长期的权益市场保持乐观，企业盈利有望逐步企稳回升，产业景气行业也会从叙事向业绩兑现逐步迈进。整体组合构建会综合考虑行业景气度、个股估值性价比、外部市场环境等因素，力争给投资者带来中长期的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：景顺长城智享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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	19,300,163.31
结算备付金		1,332,425.62
存出保证金		278,760.76
交易性金融资产	6.4.7.2	172,177,978.06
其中：股票投资		170,742,309.71
基金投资		—
债券投资		1,435,668.35
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		2,882,565.70
应收股利		21,818.63
应收申购款		3,886,961.90
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		199,880,673.98
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		410,857.39
应付赎回款		13,534,668.12
应付管理人报酬		269,075.01
应付托管费		31,870.46
应付销售服务费		—
应付投资顾问费		—
应交税费		1.69

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	643,348.77
负债合计		14,889,821.44
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	120,287,348.25
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	64,703,504.29
净资产合计		184,990,852.54
负债和净资产总计		199,880,673.98

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5379 元，基金份额总额 120,287,348.25 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 02 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城智享混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		132,453,561.42
1. 利息收入		350,598.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	183,266.70
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		167,331.36
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		54,183,258.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	53,421,687.54
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	3.29
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	761,567.73
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“-”	6.4.7.20	74,972,154.88

号填列)		
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	2, 947, 549. 92
减：二、营业总支出		2, 193, 618. 29
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 585, 595. 94
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	302, 485. 97
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-
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. 19
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	305, 536. 19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		130, 259, 943. 13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		130, 259, 943. 13
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		130, 259, 943. 13

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城智享混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	494, 614, 797. 44	-	-	494, 614, 797. 44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-374, 327, 449. 19	-	64, 703, 504. 29	-309, 623, 944. 90
（一）、综合收益总额	-	-	130, 259, 943. 13	130, 259, 943. 13

（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）	-374,327,449.19	-	-65,556,438.84	-439,883,888.03
其中：1. 基金申购款	72,389,345.13	-	17,169,419.77	89,558,764.90
2. 基金赎回款	-446,716,794.32	-	-82,725,858.61	-529,442,652.93
（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	120,287,348.25	-	64,703,504.29	184,990,852.54

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城智享混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]3071 号文《关于准予景顺长城智享混合型证券投资基金注册的批复》，由景顺长城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《景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，经向中国证监会备案，基金合同于 2026 年 2 月 12 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2026 年 2 月 2 日至 2026 年 2 月 10 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 494,555,217.44 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 59,580.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 494,614,797.44 元，折合 494,614,797.44 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2026）验字第 70015711_H06 号验资报告予以验证。本基

金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第

一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。本基金的管理费由固定管理费、或有管理费和超额管理费组成，其中或有管理费和超额管理费取决于每笔基金份额的持有时长和持有期间年化收益率水平。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配仅有现金分红一种方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 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《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》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、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

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

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

（3）个人所得税

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

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

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

（4）印花税

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

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《财政部 国家税务总局 证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部 国家税务总局 证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	19,300,163.31
等于：本金	19,297,258.82
加：应计利息	2,904.49
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 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	19,300,163.31

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		95,986,553.33	-	170,742,309.71	74,755,756.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,218,227.10	1,042.75	1,435,668.35	216,398.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,218,227.10	1,042.75	1,435,668.35	216,398.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		97,204,780.43	1,042.75	172,177,978.06	74,972,154.88

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

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	349,477.25
其中：交易所市场	349,477.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,551.60
或有管理费	229,319.92
合计	643,348.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	494,614,797.44	494,614,797.44
本期申购	72,389,345.13	72,389,345.13
本期赎回（以“-”号填列）	-446,716,794.32	-446,716,794.32
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	120,287,348.25	120,287,348.25

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2026 年 2 月 12 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 494,555,217.44 元，折合 494,555,217.44 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 59,580.00 元，折合 59,580.00 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 494,614,797.44 元，折合 494,614,797.44 份基金份额。

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	55,287,788.25	74,972,154.88	130,259,943.13
本期基金份额交易产生的变动数	-17,965,076.22	-47,591,362.62	-65,556,438.84
其中：基金申购款	12,902,144.10	4,267,275.67	17,169,419.77
基金赎回款	-30,867,220.32	-51,858,638.29	-82,725,858.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,322,712.03	27,380,792.26	64,703,504.29

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	115,868.14
定期存款利息收入	57,120.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,061.92
其他	216.64
合计	183,266.70

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2月12日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	53,421,687.54
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	53,421,687.54

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 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	662,036,710.78
减：卖出股票成本总额	607,448,866.53
减：交易费用	1,166,156.71
买卖股票差价收入	53,421,687.54

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月12日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	50.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-47.38
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	3.29
----	------

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2月12日（基金合同生效日）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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	47.38
买卖债券差价收入	-47.38

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月12日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	761,567.73
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	761,567.73

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 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	74,972,154.88
股票投资	74,755,756.38
债券投资	216,398.50
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	74,972,154.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,946,778.43
基金转换费收入	771.49
合计	2,947,549.92

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 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,213.76
信息披露费	47,337.84
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,989.66
其他	860.00
证券组合费	815.01
或有管理费	229,319.92
合计	305,536.19

注：当满足本基金合同规定的特定条件时，或有管理费将返还给投资者或确认为应由管理人收取

的管理费。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	58,837,719.28	4.31

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月12日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	26,770.80	4.32	-	-

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，被动股票型基金不得通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,585,595.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	777,652.93
应支付基金管理人的净管理费	807,943.01

注：本基金的管理费包含固定管理费、或有管理费和超额管理费。

1、固定管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日固定管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

2、或有管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率每日计提，计入其他费用，逐日累计。其计算公式为：

$$\text{日或有管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，若该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，且该笔基金份额的持有期间相对业绩比较基准的年化超额收益率（R-Rb）在-3%及以下时，或有管理费为 0，则该笔基金份额持有期内计提的或有管理费将全额随赎回款（转换转出款或清算款）一并返还给投资者；在其他情形下，该笔基金份额持有期内计提的或有管理费应确认为应由基金管理人收取的管理费，计入管理人报酬。

3、超额管理费由基金管理人按前一日基金资产净值 0.30%的年费率预估计算，但不从基金资产中实际计提，逐日累计。其计算公式为：

$$\text{日预估计算的基金超额管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

投资者赎回、转换转出基金份额或基金合同终止的情形发生时，当且仅当该笔基金份额持有天数达到或超过 365 天，且该笔基金份额的持有期间相对业绩比较基准的拟扣除超额管理费后的年化超额收益率（R*-Rb）超过 6%且拟扣除超额管理费后的年化收益率（R*）为正时，将从该笔基金份额的赎回款（转换转出款或清算款）中扣除 0.30%年费率的超额管理费，并随已计提的或有管理费一同确认为应由基金管理人收取的管理费，计入管理人报酬。

每笔基金份额的持有期年化收益率（R）计算方法如下：

$$R = ((A - B) / C) \times 365 / D \times 100\%$$

拟扣除超额管理费后的年化收益率（R*）的计算方法如下：

$$R^* = ((F \times (A - B) - Mc) / (F \times C)) \times 365 / D \times 100\%$$

R 为该笔基金份额的年化收益率；Rb 为本基金业绩比较基准同期年化收益率；

A 为该笔基金份额赎回日/转换转出日/基金合同终止情形发生日的基金份额累计净值；

B 为该笔基金份额认/申购/转换转入日的基金份额累计净值，其中份额认购日的基金份额（累计）净值为 1.00 元；

C 为该笔基金份额认/申购/转换转入日的基金份额净值，其中份额认购日的基金份额净值为 1.00 元；

D 为基金合同生效日（针对募集期内认购的基金份额）或该笔基金份额申购/转换转入确认日与赎回/转换转出确认日或基金合同终止情形发生日下一工作日的间隔天数；

F 为该笔基金份额的份额数；

Mc 为该笔基金份额持有期内累计计算的超额管理费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	302,485.97

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无支付给各关联方的销售服务费。

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

本基金本报告期末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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期末与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金的基金管理人于本报告期末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

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

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 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行-活期	19,300,163.31	115,868.14

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

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

本基金本报告期无利润分配。

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

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
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	217	11,557.42	12,746.58	-
001312	福恩股	2026 年 4 月 14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

	份	日								
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	539	14,655.41	16,876.09	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	379	11,514.02	14,777.21	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,148	11,617.76	31,834.04	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

	子	日								
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	85	3,787.60	39,836.95	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	128	10,480.64	202,794.24	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	745	14,661.60	105,410.05	-

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
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.49	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	12,122	4,665,262.40	10,085,504.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还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，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.78%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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该比例限制）。

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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	19,300,163.31	-	-	-	-	-	19,300,163.31
结算备付金	1,332,425.62	-	-	-	-	-	1,332,425.62
存出保证金	278,760.76	-	-	-	-	-	278,760.76
交易性金融资产	-	-	-	1,407,667.86	28,000.49	170,742,309.71	172,177,978.06
应收股利	-	-	-	-	-	21,818.63	21,818.63
应收申购款	-	-	-	-	-	3,886,961.90	3,886,961.90
应收清算款	-	-	-	-	-	2,882,565.70	2,882,565.70
资产总计	20,911,349.69	-	-	1,407,667.86	28,000.49	177,533,655.94	199,880,673.98
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	13,534,668.12	13,534,668.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	269,075.01	269,075.01
应付托管费	-	-	-	-	-	31,870.46	31,870.46
应付清算款	-	-	-	-	-	410,857.39	410,857.39
应交税费	-	-	-	-	-	1.69	1.69
其他负债	-	-	-	-	-	643,348.77	643,348.77
负债总计	-	-	-	-	-	14,889,821.44	14,889,821.44
利率敏感度缺口	20,911,349.69	-	-	1,407,667.86	28,000.49	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.78%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有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	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,302,903.03	-	7,302,903.03
资产合计	-	7,302,903.03	-	7,302,903.03
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,302,903.03	-	7,302,903.03

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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）
	所有外币相对人民币升值 5%	365,145.15
	所有外币相对人民币贬值 5%	-365,145.15

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，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。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	170,742,309.71	92.30
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	170,742,309.71	92.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	14,065,337.94
	沪深 300 指数下降 5%	-14,065,337.94

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
第一层次	161,529,585.96
第二层次	10,113,504.49
第三层次	534,887.61
合计	172,177,978.06

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,742,309.71	85.42
	其中：股票	170,742,309.71	85.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,435,668.35	0.72
	其中：债券	1,435,668.35	0.72
	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	20,632,588.93	10.32
8	其他各项资产	7,070,106.99	3.54
9	合计	199,880,673.98	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 7,302,903.03 元，占基金资产净值的比例为 3.95%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	148,515,608.67	80.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,923,798.01	8.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	163,439,406.68	88.35

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	5,253,120.68	2.84
必需消费品	-	-
非必需消费品	8,064.49	0.00
能源	-	-
金融	-	-
政府	-	-
工业	-	-
医疗保健	-	-
房地产	-	-
科技	2,041,717.86	1.10
公用事业	-	-
通讯	-	-
合计	7,302,903.03	3.95

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	10,800	13,716,000.00	7.41
2	002371	北方华创	13,400	11,853,104.00	6.41
3	300502	新易盛	18,880	11,460,160.00	6.19
4	600176	中国巨石	142,000	10,348,960.00	5.59
5	688072	拓荆科技	12,122	10,085,504.00	5.45
6	603986	兆易创新	11,900	9,698,500.00	5.24
7	688256	寒武纪	5,697	9,089,848.35	4.91
8	002436	兴森科技	146,300	7,453,985.00	4.03
9	300408	三环集团	43,800	7,310,220.00	3.95
10	688548	广钢气体	137,316	7,154,163.60	3.87
11	603256	宏和科技	25,600	6,792,448.00	3.67
12	688521	芯原股份	15,719	5,833,949.66	3.15
13	688041	海光信息	14,729	5,454,148.70	2.95
14	01888	建滔积层板	61,000	5,253,120.68	2.84
15	688200	华峰测控	7,447	3,910,419.70	2.11
16	603078	江化微	74,300	3,671,906.00	1.98
17	000725	京东方 A	409,000	3,550,120.00	1.92
18	688082	盛美上海	8,109	3,503,088.00	1.89
19	688545	兴福电子	23,536	3,131,700.16	1.69
20	688403	汇成股份	76,981	3,056,145.70	1.65
21	002636	金安国纪	25,200	3,023,244.00	1.63
22	600105	永鼎股份	44,500	3,002,860.00	1.62
23	688233	神工股份	13,944	2,989,872.48	1.62
24	300776	帝尔激光	13,600	2,923,456.00	1.58
25	300666	江丰电子	7,100	2,617,060.00	1.41
26	688347	华虹宏力	7,573	2,546,799.90	1.38
27	688720	艾森股份	18,686	1,887,286.00	1.02
28	002080	中材科技	20,400	1,836,000.00	0.99
29	605117	德业股份	14,760	1,567,216.80	0.85
30	688797	臻宝科技	1,731	1,175,758.01	0.64
31	300321	同大股份	17,700	1,139,526.00	0.62
32	300223	北京君正	4,400	1,095,160.00	0.59
33	00522	ASMPT	4,400	912,602.86	0.49
34	02513	智谱	400	730,971.68	0.40
35	09903	天数智芯	600	398,143.32	0.22
36	688808	联讯仪器	128	202,794.24	0.11
37	688820	盛合晶微	745	105,410.05	0.06
38	001399	惠科股份	2,870	97,580.00	0.05

39	688635	长进光子	128	39,448.32	0.02
40	001365	天海电子	539	16,876.09	0.01
41	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
42	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
43	001393	维通利	379	14,777.21	0.01
44	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.01
45	001237	惠康科技	217	12,746.58	0.01
46	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.01
47	09988	阿里巴巴-W	100	8,064.49	0.00
48	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
49	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
50	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
51	001312	福恩股份	134	2,248.52	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002371	北方华创	22,278,876.93	12.04
2	300308	中际旭创	19,529,994.00	10.56
3	601899	紫金矿业	18,187,793.00	9.83
4	00883	中国海洋石油	17,817,481.47	9.63
5	688521	芯原股份	17,449,184.18	9.43
6	688548	广钢气体	16,940,399.23	9.16
7	600176	中国巨石	15,510,889.00	8.38
8	300750	宁德时代	15,507,973.00	8.38
9	09988	阿里巴巴-W	15,196,181.16	8.21
10	002028	思源电气	14,673,023.00	7.93
11	300502	新易盛	13,221,025.00	7.15
12	688072	拓荆科技	13,199,128.82	7.14
13	002487	大金重工	13,001,370.00	7.03
14	002532	天山铝业	12,705,511.00	6.87
15	605117	德业股份	12,256,161.79	6.63
16	000338	潍柴动力	12,000,353.00	6.49
17	688308	欧科亿	9,668,604.47	5.23
18	000688	国城矿业	9,280,205.00	5.02
19	300274	阳光电源	8,886,027.00	4.80
20	600150	中国船舶	8,211,551.26	4.44
21	000933	神火股份	8,211,162.00	4.44
22	688041	海光信息	8,162,615.13	4.41
23	301018	申菱环境	7,915,047.00	4.28
24	301326	捷邦科技	7,906,305.00	4.27
25	600893	航发动力	7,807,420.00	4.22
26	688256	寒武纪	7,677,423.84	4.15

27	688717	艾罗能源	7,632,156.61	4.13
28	300757	罗博特科	7,497,505.00	4.05
29	000039	中集集团	7,491,704.00	4.05
30	00981	中芯国际	7,161,651.37	3.87
31	002203	海亮股份	7,114,785.32	3.85
32	00700	腾讯控股	7,104,146.48	3.84
33	01171	兖矿能源	7,047,313.24	3.81
34	603986	兆易创新	6,881,101.00	3.72
35	00522	ASMPT	6,615,487.56	3.58
36	688200	华峰测控	6,461,458.54	3.49
37	603629	利通电子	6,459,854.00	3.49
38	300548	长芯博创	6,412,091.00	3.47
39	603256	宏和科技	6,154,798.00	3.33
40	000534	万泽股份	6,017,250.00	3.25
41	600105	永鼎股份	5,993,283.00	3.24
42	002916	深南电路	5,971,552.00	3.23
43	920018	宏远股份	5,954,799.48	3.22
44	600673	东阳光	5,934,528.00	3.21
45	300136	信维通信	5,931,124.89	3.21
46	601233	桐昆股份	5,693,414.00	3.08
47	002436	兴森科技	5,631,378.00	3.04
48	688472	阿特斯	5,579,226.78	3.02
49	600111	北方稀土	5,443,382.00	2.94
50	301611	珂玛科技	5,439,253.00	2.94
51	000960	锡业股份	5,438,809.00	2.94
52	688205	德科立	5,187,257.39	2.80
53	300438	鹏辉能源	5,176,993.00	2.80
54	300408	三环集团	5,154,627.80	2.79
55	300666	江丰电子	5,151,640.00	2.78
56	600773	西藏城投	5,004,600.42	2.71
57	603186	华正新材	4,952,547.00	2.68
58	600391	航发科技	4,950,431.00	2.68
59	600499	科达制造	4,946,014.00	2.67
60	301035	润丰股份	4,943,116.00	2.67
61	300033	同花顺	4,853,060.40	2.62
62	600482	中国动力	4,851,993.30	2.62
63	300498	温氏股份	4,800,827.00	2.60
64	002851	麦格米特	4,735,596.00	2.56
65	688012	中微公司	4,731,640.05	2.56
66	300390	天华新能	4,655,504.06	2.52
67	06088	FIT HON TENG	4,568,981.20	2.47
68	605376	博迁新材	4,441,564.00	2.40
69	600338	西藏珠峰	4,373,734.00	2.36

70	002080	中材科技	4, 202, 844. 00	2. 27
71	601138	工业富联	4, 140, 636. 00	2. 24
72	000973	佛塑科技	4, 081, 409. 00	2. 21
73	03323	中国建材	3, 850, 811. 83	2. 08
74	688375	国博电子	3, 768, 767. 81	2. 04
75	688387	信科移动	3, 767, 695. 59	2. 04
76	03858	佳鑫国际资源	3, 707, 749. 83	2. 00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	23, 265, 539. 80	12. 58
2	600176	中国巨石	18, 685, 028. 00	10. 10
3	300750	宁德时代	17, 119, 613. 00	9. 25
4	00883	中国海洋石油	17, 102, 695. 48	9. 25
5	688548	广钢气体	16, 660, 282. 50	9. 01
6	002371	北方华创	16, 422, 842. 00	8. 88
7	605117	德业股份	14, 954, 969. 54	8. 08
8	601899	紫金矿业	14, 903, 115. 00	8. 06
9	002487	大金重工	14, 460, 285. 00	7. 82
10	688308	欧科亿	14, 427, 272. 76	7. 80
11	000338	潍柴动力	14, 027, 275. 00	7. 58
12	688072	拓荆科技	13, 333, 003. 45	7. 21
13	603629	利通电子	13, 254, 156. 00	7. 16
14	688521	芯原股份	13, 244, 617. 60	7. 16
15	002028	思源电气	13, 006, 518. 00	7. 03
16	09988	阿里巴巴-W	12, 296, 395. 97	6. 65
17	002532	天山铝业	11, 057, 959. 00	5. 98
18	301018	申菱环境	10, 783, 213. 96	5. 83
19	300502	新易盛	9, 780, 492. 00	5. 29
20	002203	海亮股份	9, 726, 211. 00	5. 26
21	000688	国城矿业	9, 584, 604. 76	5. 18
22	603256	宏和科技	9, 427, 413. 00	5. 10
23	600150	中国船舶	8, 717, 828. 87	4. 71
24	300274	阳光电源	8, 360, 834. 05	4. 52
25	301326	捷邦科技	7, 671, 088. 00	4. 15
26	300757	罗博特科	7, 362, 804. 00	3. 98
27	00522	ASMPT	7, 305, 039. 71	3. 95
28	300136	信维通信	7, 239, 786. 00	3. 91
29	000933	神火股份	7, 180, 171. 00	3. 88
30	300548	长芯博创	7, 168, 483. 00	3. 88
31	300438	鹏辉能源	7, 148, 357. 00	3. 86
32	688205	德科立	7, 051, 396. 58	3. 81

33	600893	航发动力	6,930,635.57	3.75
34	688717	艾罗能源	6,891,417.91	3.73
35	600105	永鼎股份	6,663,235.00	3.60
36	000039	中集集团	6,563,664.00	3.55
37	000534	万泽股份	6,352,582.00	3.43
38	01171	兖矿能源	6,097,370.40	3.30
39	00700	腾讯控股	6,051,239.36	3.27
40	688200	华峰测控	5,904,827.02	3.19
41	688808	联讯仪器	5,766,354.92	3.12
42	300390	天华新能	5,672,773.00	3.07
43	600673	东阳光	5,533,397.00	2.99
44	00981	中芯国际	5,407,881.93	2.92
45	600773	西藏城投	5,377,778.00	2.91
46	000960	锡业股份	5,367,994.00	2.90
47	002916	深南电路	5,274,319.00	2.85
48	06088	FIT HON TENG	5,150,980.00	2.78
49	688472	阿特斯	5,004,623.77	2.71
50	601233	桐昆股份	4,912,301.00	2.66
51	600111	北方稀土	4,900,905.00	2.65
52	300033	同花顺	4,842,586.40	2.62
53	600499	科达制造	4,823,213.00	2.61
54	600482	中国动力	4,731,307.00	2.56
55	002851	麦格米特	4,691,544.00	2.54
56	920018	宏远股份	4,688,574.01	2.53
57	301035	润丰股份	4,671,353.00	2.53
58	300666	江丰电子	4,576,318.64	2.47
59	603986	兆易创新	4,519,849.00	2.44
60	600338	西藏珠峰	4,514,586.00	2.44
61	688041	海光信息	4,418,887.98	2.39
62	000973	佛塑科技	4,414,535.00	2.39
63	300498	温氏股份	4,323,042.00	2.34
64	301611	珂玛科技	4,269,094.00	2.31
65	601138	工业富联	4,245,752.00	2.30
66	002080	中材科技	4,113,318.00	2.22
67	688387	信科移动	4,096,688.78	2.21
68	002957	科瑞技术	4,084,959.00	2.21
69	688012	中微公司	4,019,521.04	2.17
70	002850	科达利	3,956,174.00	2.14
71	600391	航发科技	3,934,076.00	2.13
72	688256	寒武纪	3,901,150.97	2.11
73	688375	国博电子	3,848,734.71	2.08

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	703,435,419.86
卖出股票收入（成交）总额	662,036,710.78

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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）	1,435,668.35	0.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,435,668.35	0.78

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	123176	精测转 2	2,620	1,407,667.86	0.76
2	118071	华峰转债	280	28,000.49	0.02

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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

（1）时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

（2）套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保

比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

(3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约作为交易标的。

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

本基金可投资国债期货，本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	278,760.76
2	应收清算款	2,882,565.70
3	应收股利	21,818.63
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,886,961.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,070,106.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123176	精测转2	1,407,667.86	0.76

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	10,085,504.00	5.45	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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（%）
2,109	57,035.25	3,274,027.30	2.72	117,013,320.95	97.28

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	169,540.67	0.140946

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2026 年 2 月 12 日）基金份额总额	494,614,797.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	72,389,345.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	446,716,794.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,287,348.25

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，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

基金管理人重大人事变动：
报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
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

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

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，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金托管人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，不存在基金托管人相关从业人员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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例(%)		(%)	
国金证券股份有限公司	1	315,197,279.89	23.10	143,415.90	23.13	本期报告新增 1 个
国信证券股份有限公司	2	209,377,056.15	15.34	95,267.05	15.36	本期报告新增 2 个
华创证券有限责任公司	1	103,744,204.45	7.60	47,203.60	7.61	本期报告新增 1 个
光大证券股份有限公司	2	101,380,709.96	7.43	46,128.37	7.44	本期报告新增 2 个
长江证券股份有限公司	2	77,809,648.89	5.70	35,403.49	5.71	本期报告新增 2 个
中国国际金融股份有限公司	2	77,581,687.08	5.69	35,299.66	5.69	本期报告新增 2 个
民生证券股份有限公司	1	74,972,611.36	5.49	34,113.33	5.50	本期报告新增 1 个
中信证券股份有限公司	5	74,169,363.50	5.44	32,963.15	5.32	本期报告新增 5 个
华福证券股份有限公司	1	64,785,755.57	4.75	29,477.51	4.75	本期报告新增 1 个
国泰海通证券股份有限公司	2	63,171,231.91	4.63	28,742.92	4.64	本期报告新增 2 个
长城证券股份有限公司	2	58,837,719.28	4.31	26,770.80	4.32	本期报告新增 2 个
申万宏源证券有限公司	2	40,635,487.82	2.98	18,489.36	2.98	本期报告新增 2 个
广发证券股份有限公司	2	38,966,295.84	2.86	17,729.92	2.86	本期报告新增 2 个
国盛证券股份有限公	1	36,018,050.85	2.64	16,388.05	2.64	本期报告新增 1 个

天风证券股份有限公司	1	21,238,579.83	1.56	9,663.56	1.56	本期报告新增 1 个
东方证券股份有限公司	2	5,604,210.63	0.41	2,550.07	0.41	本期报告新增 2 个
中国银河证券股份有限公司	2	1,086,402.00	0.08	494.31	0.08	本期报告新增 2 个
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
招商证券股份有限	1	-	-	-	-	本期报告新增

公司						1 个
中信建投 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增 1 个

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

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 (%)
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	110,712,000.00	3.31	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	391,706,000.00	11.72	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	962,783,000.00	28.80	-	-
长江证券 股份有限 公司	1,191,217.68	100.00	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	729,135,000.00	21.81	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	172,315,000.00	5.15	-	-

股份有限 公司						
国泰海通 证券股份 有限公司	-	-	247,152,000.00	7.39	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	636,526,000.00	19.04	-	-
国盛证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	93,232,000.00	2.79	-	-
诚通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
3	景顺长城智享混合型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
4	景顺长城智享混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
5	景顺长城智享混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
6	景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
7	景顺长城智享混合型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
8	景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 28 日
9	景顺长城智享混合型证券投资基金新增蚂蚁基金等多家公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 4 日
10	关于景顺长城智享混合型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 6 日

11	关于景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 13 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
15	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 1 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 3 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
21	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
22	关于景顺长城智享混合型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 8 日
23	景顺长城智享混合型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 8 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 12 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
28	关于景顺长城智享混合型证券投资基	中国证监会指定报刊及	2026 年 5 月 22 日

	金新增基煜基金为销售机构的公告	网站	
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 29 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城智享混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城智享混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城智享混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城智享混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日