

长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月20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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58

§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	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	61
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	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	长江中证全指指数增强发起	
基金主代码	026183	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 29 日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,024,140.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江中证全指指数增强发起 A	长江中证全指指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	026183	026184
报告期末下属分级基金的份额总额	34,698,050.07 份	13,326,090.58 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金,在力求对中证全指指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括: 1、股票投资策略; 2、债券投资策略; 3、衍生品投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、可转换债券、可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长江证券（上海）资产管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨	潘琦
	联系电话	4001-166-866	0755-22168257
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		4001-166-866	95511-3
传真		021-65779500	0755-82080387
注册地址		上海市虹口区新建路 200 号 B 栋 19 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		200080	518001
法定代表人		张波	谢永林

注：自 2026 年 8 月 4 日起，长江证券（上海）资产管理有限公司法定代表人变更为张波先生。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cjzcg1.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 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 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	长江中证全指指数增强发起 A	长江中证全指指数增强发起 C
本期已实现收益	-1,186,397.13	-470,453.27

本期利润	-336,151.22	-284,411.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0065	-0.0098
本期加权平均净值利润率	-0.66%	-0.99%
本期基金份额净值增长率	-1.60%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-1,162,755.76	-471,946.37
期末可供分配基金份额利润	-0.0335	-0.0354
期末基金资产净值	34,141,809.64	13,086,313.75
期末基金份额净值	0.9840	0.9820
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-1.60%	-1.80%

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）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（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。

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

长江中证全指指数增强发起 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	4.23%	1.22%	11.53%	1.30%	-7.30%	-0.08%
过去六个月	-1.60%	1.09%	10.19%	1.26%	-11.79%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-1.60%	1.08%	9.85%	1.25%	-11.45%	-0.17%

长江中证全指指数增强发起 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	4.11%	1.22%	11.53%	1.30%	-7.42%	-0.08%
过去六个月	-1.80%	1.09%	10.19%	1.26%	-11.99%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-1.80%	1.08%	9.85%	1.25%	-11.65%	-0.17%

注：（1）本基金的业绩比较基准为中证全指指数收益率 $\times 95\%$ + 银行人民币活期存款利率（税后） $\times 5\%$ ；（2）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日。

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

长江中证全指指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月29日-2026年06月30日)



长江中证全指指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年12月29日-2026年06月30日)



注：（1）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年；（2）本基金建仓期为基金合同生效日起 6 个月内，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长江证券（上海）资产管理有限公司于 2014 年 9 月 16 日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江惠盈 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江楚财一年持有期混合型发起式证券投资基金、长江乐睿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长江安悦利率债债券型证券投资基金、长江长扬混合型发起式证券投资基金、长江长宏混合型发起式证券投资基金、长江 90 天持有期债券型证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江旭日混合型证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江医药健康精选混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金和长江货币管家货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）	证券	说明
----	----	---------------	----	----

		期限		从业 年限	
		任职日期	离任日期		
张帅	本基金的 基金经理	2025-12-29	-	9 年	国籍：中国。博士研究生，具备基金从业资格。曾任天翼电子商务有限公司财富管理部见习总裁，长江证券股份有限公司互联网金融总部金融产品工程师、证券投资部量化投资总监，长江证券（上海）资产管理有限公司综合管理部战略支持岗、量化投资部研究员。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
秦昌贵	本基金的 基金经 理、量化 投资部总 经理	2025-12-29	-	21 年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任长江证券有限责任公司衍生产品部研究员，长江证券股份有限公司资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管，长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，创金合信基金管理有限公司量化投资部副总监、CTA 投资部总监。现任长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证

					券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；（2）证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（1）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（2）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（3）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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。

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 年上半年股票市场整体呈震荡上行走势，主要宽基指数中，中盘指数（中证 500、中证 1000）表现强于大盘指数（沪深 300）与小盘指数（中证 2000）。全市场股票涨跌分布严重不均，万得全 A 等权指数涨跌幅落后于中证全指指数涨跌幅近 10%。在中证全指指数的因子表现层面，流动性、动量、成长等因子超额表现较强，价值、杠杆、质量等因子表现较弱。

报告期内，本基金采用指数增强型投资策略，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，综合利用多种量化投资模型和指数增强技术，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。指数增强策略是以标的指数成份股在标的指数中的基准权重为基础，利用量化投资模型、在有限范围内对指数成份股进行超配或低配或在有限范围内配置其他股票，以构建股票组合，力争实现指数增强效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 0.9840 元，C 类基金份额净值为 0.9820 元。本报告期内，A 类基金份额净值增长率为-1.60%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%；C 类基金份额净值增长率为-1.80%，同期业绩比较基准收益率为 10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着半年度财报的陆续公布，上市公司成长预期的兑现程度将影响投资者对企业盈利能力及质量的观点再平衡，上市公司的真实盈利能力及其稳定性将是市场关注点。中证全指指数由沪、深、京符合条件的股票及存托凭证构成，为代表 A 股市场整体表现的指数，权重分权较分散、行业分布较平均。在标的指数成份股分布基础上，我们进一步采用量化投资模型和指数增强技术构建股票组合，力争实现超越标的指数的

投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 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，平安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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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：长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,248,294.70	19,458,795.51
结算备付金		801,707.66	130,004,808.22
存出保证金		400,910.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	41,039,484.71	-
其中：股票投资		41,039,484.71	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		71.54	—
应收申购款		11,638.92	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		47,502,107.93	149,463,603.73
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		—	—
应付赎回款		150,501.54	—
应付管理人报酬		31,959.86	6,551.49
应付托管费		3,994.99	818.93
应付销售服务费		4,312.26	1,391.62
应付投资顾问费		—	—
应交税费		2,999.86	—
应付利润		—	—

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,216.03	-
负债合计		273,984.54	8,762.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	48,024,140.65	149,456,183.60
未分配利润	6.4.7.8	-796,017.26	-1,341.91
净资产合计		47,228,123.39	149,454,841.69
负债和净资产总计		47,502,107.93	149,463,603.73

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 48,024,140.65 份。其中长江中证全指指数增强发起 A 基金份额净值 0.9840 元，基金份额总额 34,698,050.07 份；长江中证全指指数增强发起 C 基金份额净值 0.9820 元，基金份额总额 13,326,090.58 份。

6.2 利润表

会计主体：长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-124,086.58
1. 利息收入		113,977.88
其中：存款利息收入	6.4.7.9	113,977.88
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,274,403.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,975,506.42

基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.11	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.13	394,282.78
股利收益	6.4.7.14	306,820.13
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,036,288.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	50.97
减：二、营业总支出		496,475.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	318,510.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,813.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	57,387.79
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	6.4.7.17	—
7. 税金及附加		1,420.85
8. 其他费用	6.4.7.18	79,343.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-620,562.32
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-620,562.32
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		-620,562.32

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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	149,456,183.60	-1,341.91	149,454,841.69
二、本期期初净资产	149,456,183.60	-1,341.91	149,454,841.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-101,432,042.95	-794,675.35	-102,226,718.30
（一）、综合收益总额	-	-620,562.32	-620,562.32
（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）	-101,432,042.95	-174,113.03	-101,606,155.98
其中：1. 基金申购款	898,779.69	-25,836.12	872,943.57
2. 基金赎回款	-102,330,822.64	-148,276.91	-102,479,099.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	48,024,140.65	-796,017.26	47,228,123.39

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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：

张波	潘山	何永生
_____	_____	_____
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

长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]2540 号文《关于准予长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江中证全指指数增强型发

起式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，基金存续期限为不定期，首次设立募集资金为 149,437,485.78 元，认购资金在募集期间产生的利息 18,697.82 元，合计为 149,456,183.60 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 149,456,183.60 份，业经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）众环验字（2025）0100049 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 29 日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江中证全指指数增强型发起式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，以标的指数（即中证全指指数）的成份股及其备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，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、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金投资于股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产比例不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为中证全指指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下简称“企业会计准则”），以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业

实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、债券投资及资产支持证券投资等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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金目前无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

衍生工具亦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，在资产负债表中以衍生金融资产/负债列示。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- ①本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。

管理金融资产的商业模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

（2）金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

本基金现无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。

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

（1）金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

（2）金融工具的后续计量

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益。

②以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

④以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（3）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

②该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

③该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

①所转移金融资产的账面价值；

②因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（4）金融工具的减值

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会计处理并确认损失准备：

①预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期间为企业面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

②预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

③核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件时，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- （1）本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的。
- （2）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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

处置交易性金融资产、衍生工具的投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。交易费用于交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变

动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金利润的构成：基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(2) 基金可供分配利润：基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(3) 基金收益分配原则

①基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

②在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告。《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

③本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成相应类别的基金份额，红利再投资的 A 类基金份额免收申购费；

④基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

⑤由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

⑥法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在不违反法律法规的前提下

酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

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

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

（1）对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（2）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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》、财税[2008]132号文《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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、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2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税；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，继续免征增值税直至债券到期。存款利息收入不征收增值税；金融机构开展的质押式买入返售金融资产及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的A股上市公司股

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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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

（5）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，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

（6）对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,504,621.01
等于：本金	2,504,322.09
加：应计利息	298.92
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	2,743,673.69
等于：本金	2,743,642.91
加：应计利息	30.78
减：坏账准备	—
合计	5,248,294.70

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	40,092,156.77	-	41,039,484.71	947,327.94
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	40,092,156.77	-	41,039,484.71	947,327.94

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,248,960.00	-	-	-
一股指期货	3,248,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,248,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2609	IM2609	1	1,697,000.00	120,720.00
IM2612	IM2612	1	1,643,920.00	-28,760.00
合计				91,960.00

减：可抵销期货暂收款				91,960.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。（2）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他应付	872.87
合计	80,216.03

6.4.7.7 实收基金

长江中证全指指数增强发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,963,480.31	85,963,480.31
本期申购	356,895.27	356,895.27
本期赎回（以“-”号填列）	-51,622,325.51	-51,622,325.51
本期末	34,698,050.07	34,698,050.07

长江中证全指指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,492,703.29	63,492,703.29
本期申购	541,884.42	541,884.42
本期赎回（以“-”号填列）	-50,708,497.13	-50,708,497.13
本期末	13,326,090.58	13,326,090.58

注：上述申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

长江中证全指指数增强发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28.60	-	28.60
本期期初	28.60	-	28.60
本期利润	-1,186,397.13	850,245.91	-336,151.22
本期基金份额交易产生的变动数	23,612.77	-243,730.58	-220,117.81
其中：基金申购款	-1,227.99	-14,615.86	-15,843.85
基金赎回款	24,840.76	-229,114.72	-204,273.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,162,755.76	606,515.33	-556,240.43

长江中证全指指数增强发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,370.51	-	-1,370.51
本期期初	-1,370.51	-	-1,370.51
本期利润	-470,453.27	186,042.17	-284,411.10
本期基金份额交易产生的变动数	-122.59	46,127.37	46,004.78

其中：基金申购款	-3,324.68	-6,667.59	-9,992.27
基金赎回款	3,202.09	52,794.96	55,997.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-471,946.37	232,169.54	-239,776.83

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	10,549.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,701.53
结算备付金利息收入	99,726.67
其他	-
合计	113,977.88

6.4.7.10 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	147,339,951.58
减：卖出股票成本总额	149,154,140.81
减：交易费用	161,317.19
买卖股票差价收入	-1,975,506.42

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益--申购差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货本期收益	394,282.78

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	306,820.13
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	306,820.13

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	947,327.94
——股票投资	947,327.94
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	91,960.00
——权证投资	—
——期货投资	91,960.00
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	2,999.86
合计	1,036,288.08

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	50.97
合计	50.97

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
合计	79,343.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人母公司、基金销售机构
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人母公司的子公司、期货经纪服务机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未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

本基金本报告期未产生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	318,510.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	133,085.70
应支付基金管理人的净管理费	185,424.46

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,813.78

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江中证全指指数增强发起 A	长江中证全指指数增强发起 C	合计
长江证券（上海）资产管理有限公司	-	0.00	0.00
平安银行股份有限公司	-	15,091.03	15,091.03
长江证券股份有限公司	-	5,407.79	5,407.79
合计	-	20,498.82	20,498.82

注：（1）本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

（2）销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末未发生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。

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

情况

本基金本报告期末未发生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。

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

长江中证全指指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,002,722.49
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,002,722.49
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.83%

注：（1）基金管理人运用固有资金投资本基金，适用费率符合基金合同和招募说明书的相关约定；（2）申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额；（3）报告期期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额；（4）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	2,504,621.01	10,549.68

注：（1）上述银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按约定利率计息；（2）本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 29 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未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

本基金委托长江期货作为本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同。本基金支付给长江期货的期货交易手续费参考市场价格经本基金管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于 2026 年 06 月 30 日，本基金无应付交易手续费余额（2025 年 12 月 31 日：无）。于报告期内，本基金当期交易手续费支出 396.83 元（2025 年同期：无）。

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于长江期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按协议利率计息，存出保证金不计息。于 2026 年 06 月 30 日，本基金存放于长江期货的结算备付金余额（不含应计利息）为 801,419.50 元，存出保证金余额为 400,910.40 元（2025 年 12 月 31 日：结算备付金余额 130,000,000.00 元，存出保证金余额 0.00 元）。于报告期内，本基金存放于长江期货的结算备付金利息收入为 99,726.59 元（2025 年同期：无）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	2026-06-29	筹划发行股	832.00	2026-07-13	890.99	600	357,172.00	499,200.00	-

			份及支付现金购买资产并募集配套资金							
688121	*ST卓然	2026-05-06	无法在法定期限内披露定期报告	6.48	2026-07-07	5.18	50,800	321,463.70	329,184.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金未持有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

本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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，因此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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日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个开放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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市，持有资产流动性高，本基金可通过卖出资产方式应对流动性需求。本基金管理人每日预测本基金的流动性管理，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的检测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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 06 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	5,248,294.70	-	-	-	5,248,294.70
结算备付金	801,707.66	-	-	-	801,707.66
存出保证金	400,910.40	-	-	-	400,910.40
交易性金融资产	-	-	-	41,039,484.71	41,039,484.71
应收股利	-	-	-	71.54	71.54
应收申购款	-	-	-	11,638.92	11,638.92
资产总计	6,450,912.76	-	-	41,051,195.17	47,502,107.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	150,501.54	150,501.54
应付管理人报酬	-	-	-	31,959.86	31,959.86
应付托管费	-	-	-	3,994.99	3,994.99
应付销售服务费	-	-	-	4,312.26	4,312.26
应交税费	-	-	-	2,999.86	2,999.86
其他负债	-	-	-	80,216.03	80,216.03
负债总计	-	-	-	273,984.54	273,984.54
利率敏感度缺口	6,450,912.76	-	-	40,777,210.63	47,228,123.39
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,458,795.51	-	-	-	19,458,795.51
结算备付金	130,004,808.22	-	-	-	130,004,808.22
资产总计	149,463,603.73	-	-	-	149,463,603.73
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,551.49	6,551.49
应付托管费	-	-	-	818.93	818.93
应付销售服务费	-	-	-	1,391.62	1,391.62
负债总计	-	-	-	8,762.04	8,762.04
利率敏感度缺口	149,463,603.73	-	-	-8,762.04	149,454,841.69

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

2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，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。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金资产净值产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

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 06 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	-	45,394.77	-	45,394.77
应收股利	-	71.54	-	71.54
资产合计	-	45,466.31	-	45,466.31
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	-	45,466.31	-	45,466.31
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变，且未考虑基金管理人为降低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币 平均升值 5%	-2, 273. 32	-
	假设人民币对一揽子货币 平均贬值 5%	2, 273. 32	-

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及银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，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，也可能源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 06 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	41, 039, 484. 71	86. 90	-	-
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	41, 039, 484. 71	86. 90	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变。		
	以下分析中，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上涨 5%	1,864,988.53	-
	业绩比较基准下跌 5%	-1,864,988.53	-

注：（1）上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，组合业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响；（2）由于截至 2025 年 12 月 31 日，本基金运行期间不足一个月，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于其他价格风险的敏感性做定量分析。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	40,211,100.71	-
第二层次	828,384.00	-
第三层次	-	-
合计	41,039,484.71	-

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	41,039,484.71	86.40
	其中：股票	41,039,484.71	86.40
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	6,050,002.36	12.74
8	其他各项资产	412,620.86	0.87
9	合计	47,502,107.93	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 45,394.77 元，占期末净值比例为 0.10%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	181,216.00	0.38
B	采矿业	613,652.00	1.30
C	制造业	32,929,357.94	69.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	280,320.00	0.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,329,188.00	2.81
G	交通运输、仓储和邮政业	586,136.00	1.24
H	住宿和餐饮业	18,564.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,532,754.00	3.25
J	金融业	1,413,800.00	2.99
K	房地产业	491,861.00	1.04
L	租赁和商务服务业	392,913.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	28,301.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	673,662.00	1.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	178,969.00	0.38
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,212.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	40,664,905.94	86.10

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	329,184.00	0.70
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	-	-
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	329,184.00	0.70

7.2.3 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	8,064.49	0.02
通讯业务	37,330.28	0.08
合计	45,394.77	0.10

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	900	1,143,000.00	2.42
2	001309	德明利	1,100	1,037,190.00	2.20
3	600867	通化东宝	116,100	933,444.00	1.98
4	300750	宁德时代	2,200	864,622.00	1.83
5	300502	新易盛	1,180	716,260.00	1.52
6	002384	东山精密	2,700	708,345.00	1.50
7	002532	天山铝业	61,100	655,603.00	1.39
8	002415	海康威视	18,200	622,440.00	1.32
9	688525	佰维存储	1,200	593,676.00	1.26
10	688012	中微公司	1,200	562,200.00	1.19
11	601766	中国中车	104,000	540,800.00	1.15
12	002266	浙富控股	104,500	528,770.00	1.12
13	688041	海光信息	1,400	518,420.00	1.10
14	688072	拓荆科技	600	499,200.00	1.06

15	600595	中孚实业	86,800	487,816.00	1.03
16	300694	蠡湖股份	50,700	486,720.00	1.03
17	300176	鸿特科技	99,400	482,090.00	1.02
18	600499	科达制造	33,700	465,060.00	0.98
19	300514	友讯达	47,200	441,320.00	0.93
20	688036	传音控股	7,203	424,616.85	0.90
21	688981	中芯国际	2,600	412,932.00	0.87
22	000757	浩物股份	120,400	410,564.00	0.87
23	601877	正泰电器	15,800	396,106.00	0.84
24	000408	藏格矿业	5,700	395,124.00	0.84
25	300371	汇中股份	40,100	392,178.00	0.83
26	600183	生益科技	2,200	381,480.00	0.81
27	300476	胜宏科技	1,100	381,073.00	0.81
28	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.80
29	603321	梅轮电梯	65,900	376,948.00	0.80
30	002027	分众传媒	77,600	375,584.00	0.80
31	605117	德业股份	3,500	371,630.00	0.79
32	300433	蓝思科技	6,900	370,254.00	0.78
33	300394	天孚通信	1,220	369,269.60	0.78
34	000858	五 粮 液	4,900	362,600.00	0.77
35	600989	宝丰能源	17,800	361,874.00	0.77
36	600150	中国船舶	10,600	358,174.00	0.76
37	600036	招商银行	9,800	347,900.00	0.74
38	601166	兴业银行	20,800	344,448.00	0.73
39	000538	云南白药	7,100	336,327.00	0.71
40	001965	招商公路	36,400	333,424.00	0.71
41	601857	中国石油	38,100	330,708.00	0.70
42	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.68
43	300274	阳光电源	2,000	318,040.00	0.67
44	300124	汇川技术	4,300	285,219.00	0.60
45	600487	亨通光电	2,600	284,284.00	0.60
46	300150	世纪瑞尔	71,600	284,252.00	0.60
47	301308	江波龙	400	281,520.00	0.60
48	600901	江苏金租	48,900	281,175.00	0.60
49	603345	安井食品	3,500	280,665.00	0.59
50	002916	深南电路	600	274,740.00	0.58
51	300604	长川科技	800	273,136.00	0.58
52	002371	北方华创	300	265,368.00	0.56
53	688597	煜邦电力	38,561	250,646.50	0.53
54	000725	京东方 A	28,500	247,380.00	0.52
55	603089	正裕工业	29,600	247,160.00	0.52
56	301032	新柴股份	25,600	238,080.00	0.50
57	601138	工业富联	3,200	230,880.00	0.49

58	300610	晨化股份	23,000	224,250.00	0.47
59	600883	博闻科技	31,200	218,400.00	0.46
60	601698	中国卫通	7,100	214,775.00	0.45
61	002494	华斯股份	47,700	211,788.00	0.45
62	002475	立讯精密	3,000	211,200.00	0.45
63	688468	科美诊断	36,599	208,248.31	0.44
64	000063	中兴通讯	5,700	206,283.00	0.44
65	002281	光迅科技	800	205,552.00	0.44
66	300387	富邦科技	30,100	204,379.00	0.43
67	302132	中航成飞	3,500	204,120.00	0.43
68	300857	协创数据	600	203,940.00	0.43
69	688019	安集科技	600	203,676.00	0.43
70	603022	新通联	25,400	202,946.00	0.43
71	600750	华润江中	9,100	200,837.00	0.43
72	600128	苏豪弘业	26,400	200,376.00	0.42
73	300412	迦南科技	43,800	199,728.00	0.42
74	603501	豪威集团	2,100	199,185.00	0.42
75	601168	西部矿业	7,300	198,122.00	0.42
76	300357	我武生物	8,400	195,888.00	0.41
77	603900	莱绅通灵	34,300	193,109.00	0.41
78	002271	东方雨虹	15,800	187,546.00	0.40
79	688629	华丰科技	1,000	187,510.00	0.40
80	002495	佳隆股份	90,400	185,320.00	0.39
81	600561	江西长运	36,900	182,655.00	0.39
82	002247	聚力文化	85,100	179,561.00	0.38
83	600661	昂立教育	25,900	178,969.00	0.38
84	002188	中天服务	36,500	178,850.00	0.38
85	688002	睿创微纳	1,134	175,418.46	0.37
86	600760	中航沈飞	4,200	172,620.00	0.37
87	603506	南都物业	18,300	170,922.00	0.36
88	603787	新日股份	18,700	169,983.00	0.36
89	600097	开创国际	21,200	164,936.00	0.35
90	688266	泽璟制药	1,400	163,324.00	0.35
91	002144	宏达高科	16,400	161,540.00	0.34
92	600660	福耀玻璃	3,200	161,408.00	0.34
93	002999	天禾股份	29,900	159,068.00	0.34
94	600031	三一重工	9,200	158,976.00	0.34
95	605567	春雪食品	19,400	155,006.00	0.33
96	002738	中矿资源	2,600	153,374.00	0.32
97	000933	神火股份	7,200	152,640.00	0.32
98	301200	大族数控	400	144,260.00	0.31
99	600497	驰宏锌锗	11,900	144,109.00	0.31
100	688627	精智达	200	143,000.00	0.30

101	600287	苏豪时尚	31,900	140,679.00	0.30
102	600406	国电南瑞	6,100	139,385.00	0.30
103	000729	燕京啤酒	13,700	138,781.00	0.29
104	300017	网宿科技	10,600	137,906.00	0.29
105	000657	中钨高新	1,400	134,008.00	0.28
106	688063	派能科技	2,490	132,642.30	0.28
107	002566	益盛药业	21,700	131,068.00	0.28
108	688387	信科移动	6,400	126,976.00	0.27
109	688008	澜起科技	400	123,960.00	0.26
110	002133	广宇集团	50,800	121,412.00	0.26
111	300953	震裕科技	900	120,330.00	0.25
112	002156	通富微电	1,500	113,805.00	0.24
113	002635	安洁科技	5,500	112,475.00	0.24
114	002851	麦格米特	600	100,308.00	0.21
115	300408	三环集团	600	100,140.00	0.21
116	688127	蓝特光学	1,000	97,600.00	0.21
117	688153	唯捷创芯	3,032	97,387.84	0.21
118	605123	派克新材	1,000	97,010.00	0.21
119	001287	中电港	3,100	96,565.00	0.20
120	002518	科士达	1,800	96,462.00	0.20
121	600051	宁波联合	16,700	94,021.00	0.20
122	002396	星网锐捷	4,870	93,357.90	0.20
123	688327	云从科技	7,000	87,220.00	0.18
124	603588	高能环境	4,400	84,480.00	0.18
125	002815	崇达技术	5,000	82,950.00	0.18
126	688717	艾罗能源	1,000	82,570.00	0.17
127	688110	东芯股份	400	81,480.00	0.17
128	601778	晶科科技	18,900	81,270.00	0.17
129	600821	金开新能	12,900	80,625.00	0.17
130	688652	京仪装备	400	80,068.00	0.17
131	002414	高德红外	5,900	78,234.00	0.17
132	603083	剑桥科技	300	76,461.00	0.16
133	000600	建投能源	8,700	76,125.00	0.16
134	002545	东方铁塔	4,600	74,612.00	0.16
135	688521	芯原股份	200	74,228.00	0.16
136	301526	国际复材	1,500	70,005.00	0.15
137	300296	利亚德	12,100	67,760.00	0.14
138	002673	西部证券	10,100	65,549.00	0.14
139	600166	福田汽车	22,200	64,602.00	0.14
140	300298	三诺生物	4,600	64,170.00	0.14
141	600761	安徽合力	3,900	63,804.00	0.14
142	688097	博众精工	1,000	63,050.00	0.13
143	603306	华懋科技	600	62,214.00	0.13

144	002745	木林森	4,900	61,495.00	0.13
145	300482	万孚生物	3,700	61,457.00	0.13
146	600685	中船防务	2,400	61,056.00	0.13
147	600323	瀚蓝环境	2,200	60,412.00	0.13
148	603305	旭升集团	4,900	59,388.00	0.13
149	301511	德福科技	400	57,540.00	0.12
150	002993	奥海科技	800	57,288.00	0.12
151	000848	承德露露	7,600	56,240.00	0.12
152	603338	浙江鼎力	1,300	55,250.00	0.12
153	002466	天齐锂业	900	55,188.00	0.12
154	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.12
155	603308	应流股份	900	54,360.00	0.12
156	002249	大洋电机	7,200	54,000.00	0.11
157	002468	申通快递	3,700	53,872.00	0.11
158	600908	无锡银行	10,600	53,848.00	0.11
159	002603	以岭药业	3,500	52,500.00	0.11
160	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.11
161	600686	金龙汽车	4,600	51,934.00	0.11
162	600869	远东股份	1,500	50,205.00	0.11
163	000589	贵州轮胎	12,300	49,938.00	0.11
164	300438	鹏辉能源	600	49,710.00	0.11
165	603690	至纯科技	1,400	49,560.00	0.10
166	002202	金风科技	2,000	47,800.00	0.10
167	002812	恩捷股份	700	46,837.00	0.10
168	002807	江阴银行	12,600	46,746.00	0.10
169	603323	苏农银行	11,600	44,892.00	0.10
170	000690	宝新能源	9,000	42,300.00	0.09
171	300760	迈瑞医疗	300	40,749.00	0.09
172	688126	沪硅产业	1,000	39,890.00	0.08
173	300014	亿纬锂能	600	39,018.00	0.08
174	603383	顶点软件	1,400	37,184.00	0.08
175	603444	吉比特	100	35,842.00	0.08
176	601187	厦门银行	5,200	35,516.00	0.08
177	601528	瑞丰银行	8,000	35,360.00	0.07
178	600389	江山股份	1,800	35,136.00	0.07
179	300442	润泽科技	400	33,228.00	0.07
180	001227	兰州银行	16,300	32,600.00	0.07
181	600572	康恩贝	8,100	31,752.00	0.07
182	002643	万润股份	1,500	31,425.00	0.07
183	603236	移远通信	580	29,678.60	0.06
184	603156	养元饮品	600	29,442.00	0.06
185	600267	海正药业	2,900	29,319.00	0.06
186	002493	荣盛石化	2,700	29,025.00	0.06

187	300661	圣邦股份	200	28,696.00	0.06
188	000893	亚钾国际	700	28,623.00	0.06
189	000703	恒逸石化	2,100	28,497.00	0.06
190	688183	生益电子	214	28,333.60	0.06
191	000778	新兴铸管	7,600	28,196.00	0.06
192	600177	雅戈尔	3,700	27,861.00	0.06
193	002170	芭田股份	2,500	27,150.00	0.06
194	688388	嘉元科技	610	26,840.00	0.06
195	002488	金固股份	2,900	25,839.00	0.05
196	300034	钢研高纳	1,500	25,710.00	0.05
197	601126	四方股份	400	25,280.00	0.05
198	600864	哈投股份	4,800	24,912.00	0.05
199	300568	星源材质	1,300	24,336.00	0.05
200	300702	天宇股份	1,200	24,192.00	0.05
201	000682	东方电子	1,900	23,997.00	0.05
202	002507	涪陵榨菜	2,200	23,760.00	0.05
203	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.05
204	301345	涛涛车业	100	23,100.00	0.05
205	600369	西南证券	5,700	22,914.00	0.05
206	002926	华西证券	2,800	22,876.00	0.05
207	002756	永兴材料	400	22,656.00	0.05
208	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.05
209	002373	千方科技	3,000	21,540.00	0.05
210	000623	吉林敖东	1,200	21,276.00	0.05
211	603638	艾迪精密	900	21,105.00	0.04
212	000550	江铃汽车	1,300	21,086.00	0.04
213	300457	赢合科技	1,000	21,080.00	0.04
214	000049	德赛电池	900	21,033.00	0.04
215	603317	天味食品	1,600	20,816.00	0.04
216	600064	南京高科	2,900	20,677.00	0.04
217	601061	中信金属	1,900	20,463.00	0.04
218	300450	先导智能	500	20,360.00	0.04
219	000987	越秀资本	2,600	20,332.00	0.04
220	688271	联影医疗	200	20,246.00	0.04
221	603699	纽威股份	400	20,120.00	0.04
222	600458	时代新材	1,200	19,860.00	0.04
223	688396	华润微	200	19,510.00	0.04
224	600782	新钢股份	7,800	19,344.00	0.04
225	301327	华宝新能	400	19,228.00	0.04
226	688543	国科军工	480	18,936.00	0.04
227	300001	特锐德	500	18,915.00	0.04
228	002063	远光软件	3,700	18,870.00	0.04
229	300390	天华新能	200	18,702.00	0.04

230	000973	佛塑科技	1,300	18,655.00	0.04
231	002690	美亚光电	1,300	18,629.00	0.04
232	601222	林洋能源	3,500	18,620.00	0.04
233	600258	首旅酒店	1,700	18,564.00	0.04
234	600301	华锡有色	300	18,396.00	0.04
235	688349	三一重能	1,200	18,216.00	0.04
236	300316	晶盛机电	300	18,120.00	0.04
237	300682	朗新科技	1,800	17,820.00	0.04
238	688612	威迈斯	600	17,754.00	0.04
239	603979	金诚信	300	17,709.00	0.04
240	300775	三角防务	800	17,632.00	0.04
241	002839	张家港行	4,500	17,550.00	0.04
242	000555	神州信息	1,700	17,510.00	0.04
243	300224	正海磁材	1,300	17,329.00	0.04
244	600662	外服控股	4,300	17,329.00	0.04
245	601860	紫金银行	7,100	17,182.00	0.04
246	600801	华新建材	1,100	17,160.00	0.04
247	000519	中兵红箭	800	16,856.00	0.04
248	002268	电科网安	1,300	16,770.00	0.04
249	600718	东软集团	2,300	16,652.00	0.04
250	000426	兴业银锡	500	16,480.00	0.03
251	601666	平煤股份	2,300	16,445.00	0.03
252	603477	巨星农牧	1,100	16,280.00	0.03
253	601000	唐山港	3,900	16,185.00	0.03
254	002557	洽洽食品	900	16,164.00	0.03
255	600171	上海贝岭	500	15,970.00	0.03
256	600988	赤峰黄金	600	15,792.00	0.03
257	002368	太极股份	1,100	15,389.00	0.03
258	002436	兴森科技	300	15,285.00	0.03
259	603379	三美股份	200	15,178.00	0.03
260	301150	中一科技	240	15,146.40	0.03
261	300759	康龙化成	500	14,465.00	0.03
262	688561	奇安信	600	14,388.00	0.03
263	301263	泰恩康	700	14,343.00	0.03
264	301087	可孚医疗	300	14,295.00	0.03
265	600977	中国电影	1,100	14,212.00	0.03
266	002975	博杰股份	100	14,200.00	0.03
267	688443	智翔金泰	600	13,950.00	0.03
268	688248	南网科技	200	13,836.00	0.03
269	600105	永鼎股份	200	13,496.00	0.03
270	600566	济川药业	600	13,314.00	0.03
271	301536	星宸科技	100	12,871.00	0.03
272	688090	瑞松科技	120	12,774.00	0.03

273	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.03
274	002487	大金重工	200	11,594.00	0.02
275	688003	天准科技	90	11,457.00	0.02
276	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.02
277	300260	新莱应材	100	10,046.00	0.02
278	001339	智微智能	90	9,205.20	0.02
279	688433	华曙高科	100	8,560.00	0.02
280	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.02
281	002929	润建股份	100	6,688.00	0.01
282	301489	思泉新材	20	3,291.60	0.01
283	301607	富特科技	40	2,090.00	0.00
284	301529	福赛科技	20	1,927.20	0.00
285	688285	高铁电气	74	530.58	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	688121	*ST 卓然	50,800	329,184.00	0.70
2	H00700	腾讯控股	100	37,330.28	0.08
3	H09988	阿里巴巴—W	100	8,064.49	0.02

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	600660	福耀玻璃	2,556,063.00	1.71
2	601138	工业富联	2,457,348.00	1.64
3	603288	海天味业	2,228,961.36	1.49
4	600362	江西铜业	2,178,843.00	1.46
5	600809	山西汾酒	1,985,415.00	1.33
6	300308	中际旭创	1,984,436.00	1.33
7	600480	凌云股份	1,965,512.00	1.32
8	002415	海康威视	1,952,698.00	1.31
9	300841	康华生物	1,939,929.00	1.30
10	300760	迈瑞医疗	1,922,670.00	1.29
11	600867	通化东宝	1,869,301.00	1.25
12	002352	顺丰控股	1,851,094.00	1.24
13	600690	海尔智家	1,837,144.00	1.23

14	002598	ST 章鼓	1,610,011.00	1.08
15	688597	煜邦电力	1,604,710.13	1.07
16	002850	科达利	1,501,808.00	1.00
17	300150	世纪瑞尔	1,443,441.00	0.97
18	300124	汇川技术	1,438,808.00	0.96
19	688468	科美诊断	1,412,136.93	0.94
20	000963	华东医药	1,381,690.00	0.92

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601138	工业富联	2,444,520.00	1.64
2	603288	海天味业	2,220,011.00	1.49
3	600660	福耀玻璃	2,169,150.00	1.45
4	600362	江西铜业	1,935,716.00	1.30
5	600480	凌云股份	1,717,654.00	1.15
6	002352	顺丰控股	1,684,449.00	1.13
7	002850	科达利	1,664,320.00	1.11
8	300841	康华生物	1,629,358.00	1.09
9	300760	迈瑞医疗	1,572,124.00	1.05
10	600690	海尔智家	1,569,719.00	1.05
11	002126	银轮股份	1,507,893.00	1.01
12	002598	ST 章鼓	1,496,695.00	1.00
13	600809	山西汾酒	1,425,631.00	0.95
14	002415	海康威视	1,372,716.00	0.92
15	300308	中际旭创	1,316,743.00	0.88
16	603298	杭叉集团	1,311,227.23	0.88
17	600015	华夏银行	1,285,956.00	0.86
18	000963	华东医药	1,272,213.00	0.85
19	002497	雅化集团	1,267,165.00	0.85
20	600887	伊利股份	1,258,371.00	0.84

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	189,246,297.58
卖出股票收入（成交）总额	147,339,951.58

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

本报告期，本基金以套期保值为目的，持有流动性好、交易活跃、与标的指数相关性较高的股指期货多头合约，有效提高了本基金的资金管理效率，从而更好地跟踪标的指数，股指期货资产相关比例严格控制在基金合同约定范围之内。

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

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	400,910.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	71.54
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,638.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	412,620.86

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688121	*ST 卓然	329,184.00	0.70	股票停牌

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
长江中证全指指数增强发起 A	232	149,560.56	10,200,773.41	29.40%	24,497,276.66	70.60%
长江中证全指指数增强发起 C	249	53,518.44	4,650,000.00	34.89%	8,676,090.58	65.11%
合计	477	100,679.54	14,850,773.41	30.92%	33,173,367.24	69.08%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长江中证全指指数增强发起 A	106,498.70	0.3069%
	长江中证全指指数增强发起 C	1,060.22	0.0080%
	合计	107,558.92	0.2240%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长江中证全指指数增强发起 A	10~50
	长江中证全指指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长江中证全指指数增强发起 A	10~50
	长江中证全指指数增强发起 C	0
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,722.49	20.83%	10,002,722.49	20.83%	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,002,722.49	20.83%	10,002,722.49	20.83%	—

注：持有份额占基金总份额比例、发起份额占基金总份额比例的计算中，分母采用报告期末基金份额总额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江中证全指指数增强发起 A	长江中证全指指数增强发起 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 29 日） 基金份额总额	85,963,480.31	63,492,703.29
本报告期期初基金份额总额	85,963,480.31	63,492,703.29
本报告期基金总申购份额	356,895.27	541,884.42
减：本报告期基金总赎回份额	51,622,325.51	50,708,497.13
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,698,050.07	13,326,090.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

- 1、本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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，无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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，本基金管理人无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，本基金管理人相关从业人员无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，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	2	336,586,249.16	100.00%	65,956.48	100.00%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2、本基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，委托其办理本基金的证券交易业务。证券公司的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好，经营行为规范。
- (2) 具备较强的合规风控能力。
- (3) 具备较强的交易服务能力。

3、受托办理证券交易的证券公司选择程序如下：本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与受托证券公司签订证券经纪服务协议。

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	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网	规定报刊、网站	2026-01-09

	站系统暂停服务的公告		
2	长江证券（上海）资产管理有限公司关于设立审计委员会并撤销监事的公告	规定报刊、网站	2026-01-13
3	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	规定报刊、网站	2026-01-27
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票及相关风险提示的公告	规定报刊、网站	2026-03-04
5	长江证券（上海）资产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）	规定网站	2026-03-31
6	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定网站	2026-04-22
7	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2026-04-22
8	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年 05 月 29 日更新）	规定网站	2026-05-29
9	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026-05-29
10	长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026-05-29

§ 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	20260616-20260630	10,002,722.49	-	-	10,002,722.49	20.83%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回、延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项等，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能							

拥有较大话语权。

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、中国证监会准予长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为 www.cjzcg1.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇二六年八月三十一日