

# 长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 29 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 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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              | 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             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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内容的真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 44        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 46        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 46        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 46        |
| 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 ..... | 46        |
| 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 .....    | 46        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 46        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 46        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>47</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 47        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 47        |
| 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 .....      | 48        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>48</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 48        |
| 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 .....      | 49        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 49        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 49        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 49        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 49        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 49        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 50        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>51</b> |
| 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 .....    | 51        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 51        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 51        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                         |                    |
|-----------------|-------------------------|--------------------|
| 基金名称            | 长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金 |                    |
| 基金简称            | 长盛中证红利低波动 100 指数        |                    |
| 基金主代码           | 022342                  |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                  |                    |
| 基金合同生效日         | 2024 年 12 月 24 日        |                    |
| 基金管理人           | 长盛基金管理有限公司              |                    |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司              |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 125,281,372.69 份        |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                     |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 长盛中证红利低波动 100 指数 A      | 长盛中证红利低波动 100 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 022342                  | 022343             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 57,113,919.45 份         | 68,167,453.24 份    |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证红利低波动 100 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。   |
| 投资策略 | <p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。在条件允许的情况下，本基金也可以适当参与中证红利低波动 100 指数所包含指数成份股以外的其他个股（非标的指数成份股及备选成份股），以更好地跟踪指数。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股等进行替代。</p> <p>2、存托凭证的投资策略</p> <p>3、固定收益品种投资策略</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 4、衍生产品投资/交易策略<br>5、融资、转融通证券出借业务投资策略<br>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。 |
| 业绩比较基准 | 中证红利低波动 100 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。                          |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                             | 基金托管人                      |
|-------------|------|-----------------------------------|----------------------------|
| 名称          |      | 长盛基金管理有限公司                        | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张利宁                               | 冯萌                         |
|             | 联系电话 | 010-86497608                      | 021-52629999-213310        |
|             | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn            | fengmeng@cib.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 400-888-2666、010-86497888         | 95561                      |
| 传真          |      | 010-86497999                      | 021-62159217               |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D         | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址        |      | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼       |
| 邮政编码        |      | 100029                            | 200120                     |
| 法定代表人       |      | 胡甲                                | 吕家进                        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公地址  |

### 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025年1月1日-2025年6月30日) |                    |
|---------------|---------------------------|--------------------|
|               | 长盛中证红利低波动 100 指数 A        | 长盛中证红利低波动 100 指数 C |
| 本期已实现收益       | 987,910.88                | 1,089,914.76       |

|               |                  |               |
|---------------|------------------|---------------|
| 本期利润          | 1,113,209.06     | 1,495,096.04  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0123           | 0.0136        |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.23%            | 1.37%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.75%            | 1.66%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025年6月30日) |               |
| 期末可供分配利润      | 899,242.04       | 1,003,396.97  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0157           | 0.0147        |
| 期末基金资产净值      | 58,052,349.35    | 69,217,249.66 |
| 期末基金份额净值      | 1.0164           | 1.0154        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025年6月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 1.64%            | 1.54%         |

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

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

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

4、本基金基金合同生效日为2024年12月24日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛中证红利低波动 100 指数 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | 0.30%    | 0.35%       | -1.01%     | 0.42%         | 1.31% | -0.07% |
| 过去三个月      | 2.34%    | 0.79%       | 0.11%      | 0.96%         | 2.23% | -0.17% |
| 过去六个月      | 1.75%    | 0.60%       | -2.54%     | 0.82%         | 4.29% | -0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.64%    | 0.59%       | -1.19%     | 0.82%         | 2.83% | -0.23% |

长盛中证红利低波动 100 指数 C

| 阶段 | 份额净 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|
|----|-----|------|-------|--------|-----|-----|

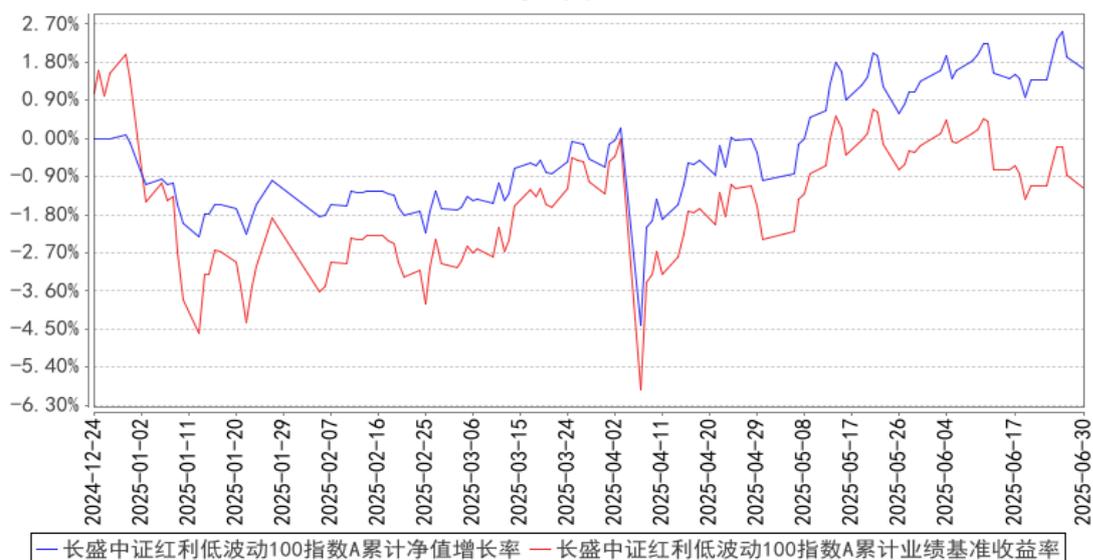
|            | 值增长率① | 增长率标准差② | 准收益率③  | 收益率标准差④ |       |        |
|------------|-------|---------|--------|---------|-------|--------|
| 过去一个月      | 0.29% | 0.35%   | -1.01% | 0.42%   | 1.30% | -0.07% |
| 过去三个月      | 2.30% | 0.79%   | 0.11%  | 0.96%   | 2.19% | -0.17% |
| 过去六个月      | 1.66% | 0.60%   | -2.54% | 0.82%   | 4.20% | -0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.54% | 0.59%   | -1.19% | 0.82%   | 2.73% | -0.23% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

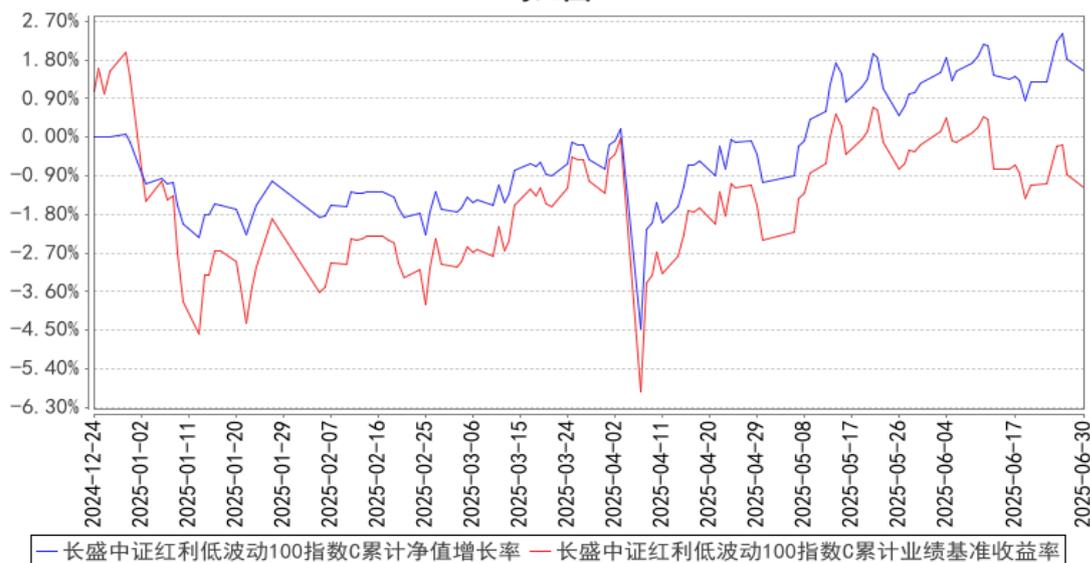
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中中证红利低波动100指数、银行活期存款利率每日按照95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

长盛中证红利低波动100指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长盛中证红利低波动100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为2024年12月24日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

## § 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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于1999年3月26日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币2.06亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外QFII基金的投资顾问。截至2025年6月30日，基金管理人共管理七十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务  | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|---|------------------|------|--------|--|
|     |   | 任职日期             | 离任日期 |        |  |
| 陈亘斯 | 本基金基金经理,长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证 A100 指数证券投资基金基金经理,长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证全指证券公司指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理,量化投资部总经理助理。 | 2024 年 12 月 24 日 | -    | 16 年   | 陈亘斯先生, 硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师, 国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理, 北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任基金经理助理。 |

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年 A 股市场首先在年初经历了小幅快速调整后走出了逐步修复行情，尤其是春节前后由于 DeepSeek 大模型的新版本以及新一代人形机器人的发布和出圈，引发了市场对于科技成长类企业的热切关注和积极展望，尤其与新质生产力高度相关的部分细分行业如软件、互联网、自动化设备、生物科技等与港股市场的科技板块产生共振同步走高。随着节后资金面的回暖，市场交易氛围重新活跃，成交额相较春节前有所放大，带动了小市值和预期高成长风格的持续走强，而红利、低波动、低换手等防御型风格则在区间内窄幅震荡。其后 A 股市场在经历了二季度初期关税冲击后迅速修复并连续温和上涨，得益于政策的及时呵护以及投资者总体对国内的科技突破的前景保持了充分的信心。杠铃策略的红利和成长两端内部均有所变化，其中红利板块内以银行板块一马当先，尤其是业绩增速突出的地方性银行，显示出较强的经营韧性；而成长板块方面，不同于一季度领涨的人工智能、国产替代等偏向内循环的板块，面对关税压力仍能凭借自身产品优势而对外破局的创新药、电路板、光模块、军工等获得市场高度认同，部分成分股走势创出年内新高。但我们也注意到，成长板块的内部轮动十分显著，人气过高时需要评估其交易拥挤度和

预期业绩的估值匹配度。此外，微盘股由于流动性的溢出效应而整体屡创历史新高，但其背后对资金净流入和动量效应的依赖过高而脱离了基本面估值体系，需要关注其急速调整的尾部风险。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛中证红利低波动 100 指数 A 的基金份额净值为 1.0164 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准收益率为-2.54%；截至本报告期末长盛中证红利低波动 100 指数 C 的基金份额净值为 1.0154 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.66%，同期业绩比较基准收益率为-2.54%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0352%，年度化跟踪误差为 6.6173%。由于本报告期内部分时段基金处于建仓阶段，因此跟踪误差会显著大于合同约定目标，待建仓期完成后会力争控制在合同约定范围内。

#### 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 2025 年下半年，在利率保持低位以及居民储蓄高企的背景下，A 股市场已在上半年逐步走出上行态势，对居民储蓄搬家的吸引力也随之提升，有望获得较为持续的增量资金入场。此外社会零售数据受益于以旧换新的补贴政策，同时服务业 CPI 也在持续回暖。经济内生活力在局部显现并扩散，叠加“反内卷”的新政策指引，国内经济格局处于供给驱动向需求拉动转换的关键时期。伴随着人工智能等新科技的协同作用，其间将可能自下而上涌现出新的产业成长机会和投资范式。当然，在积极乐观之余，我们看到外部地缘环境仍存在不确定性，美国的关税政策的左右摇摆以及“大而美”法案的出台使得海外资金对于在美国本土和大中华地区之间的配置调整仍有可能一波三折。虽然美国的技术革新对企业增长预期的支撑仍表现出相当的韧性，但其居民的就业、消费等数据已有疲态，因此我们对于美联储在中期打开降息通道进而改善 A 股外部流动性的趋势抱有高度的信心，但未来几个月应当留意目前较为一致的乐观预期可能会产生短期分歧，从而催化市场出现明显的震荡，但总体市场逐步上台阶的中长期态势大概率会在偶发的调整后更加坚实。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成

员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 11,199,526.53                  | 167,078,043.85                   |
| 结算备付金         |            | -                              | -                                |
| 存出保证金         |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 119,369,798.00                 | 80,861,186.00                    |
| 其中：股票投资       |            | 119,369,798.00                 | 80,861,186.00                    |
| 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    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 1,429,239.55                   | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 131,998,564.08                 | 247,939,229.85                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 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         |            | 4,558,503.70                   | -                                |

|             |          |                |                |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬     |          | 57,974.80      | 23,736.14      |
| 应付托管费       |          | 11,594.94      | 4,747.22       |
| 应付销售服务费     |          | 12,623.36      | 5,015.27       |
| 应付投资顾问费     |          | -              | -              |
| 应交税费        |          | -              | -              |
| 应付利润        |          | -              | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 88,268.27      | -              |
| 负债合计        |          | 4,728,965.07   | 33,498.63      |
| <b>净资产：</b> |          |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 125,281,372.69 | 248,194,227.87 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 1,988,226.32   | -288,496.65    |
| 净资产合计       |          | 127,269,599.01 | 247,905,731.22 |
| 负债和净资产总计    |          | 131,998,564.08 | 247,939,229.85 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，长盛中证红利低波动 100 指数 A 的基金份额净值为 1.0164 元，份额总额为 57,113,919.45 份；长盛中证红利低波动 100 指数 C 的基金份额净值为 1.0154 元，份额总额为 68,167,453.24 份。基金份额总额 125,281,372.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 |
|-------------------|----------|--|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 3,406,557.98                             |
| 1. 利息收入           |          | 36,668.91                                |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 36,668.91                                |
| 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） |          | 2,837,496.90                             |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -723,573.25                              |
| 基金投资收益            |          | -  |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | -  |
| 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 | 3,561,070.15                             |
| 其他投资收益            |          | -  |

|                            |            |                     |
|----------------------------|------------|---------------------|
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20   | 530,479.46          |
| 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   | 1,912.71            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>798,252.88</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 498,298.69          |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 99,659.72           |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 108,966.17          |
| 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                   |            | -                   |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 91,328.30           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>2,608,305.10</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>2,608,305.10</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>2,608,305.10</b> |

注：本基金合同于 2024 年 12 月 24 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |              |                 |
|---|---------------------------------------|--------------|-----------------|
|   | 实收基金                                  | 未分配利润        | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                               | 248,194,227.87                        | -288,496.65  | 247,905,731.22  |
| 二、本期期初净资产                               | 248,194,227.87                        | -288,496.65  | 247,905,731.22  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                    | -122,912,855.18                       | 2,276,722.97 | -120,636,132.21 |
| （一）、综合收益总额                              | -                                     | 2,608,305.10 | 2,608,305.10    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列） | -122,912,855.18                       | -331,582.13  | -123,244,437.31 |
| 其中：1. 基金申购款                             | 46,313,146.73                         | 270,545.57   | 46,583,692.30   |
| 2. 基金赎回款                                | -169,226,001.91                       | -602,127.70  | -169,828,129.61 |
| （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 | 125,281,372.69 | 1,988,226.32 | 127,269,599.01 |

注：本基金合同于 2024 年 12 月 24 日生效，无上年度可比期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |           |
|-----------|------------|-----------|
| <u>胡甲</u> | <u>张壬午</u> | <u>龚珉</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2024〕1348 号的注册，由长盛基金管理有限公司于 2024 年 12 月 2 日至 2024 年 12 月 20 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具（2024）验字第 70015799\_A03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2024 年 12 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2024 年 12 月 24 日止，长盛中证红利低波动 100 指数 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 117,074,413.04 元，折合 117,074,413.04 份长盛中证红利低波动 100 指数 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 14,762.97 元，折合 14,762.97 份长盛中证红利低波动 100 指数 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 117,089,176.01 元，折合 117,089,176.01 份长盛中证红利低波动 100 指数 A 类基金份额。长盛中证红利低波动 100 指数 C 类基金份额已收到首次募集的有效认购金额为人民币 131,079,797.25 元，折合 131,079,797.25 份长盛中证红利低波动 100 指数 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 25,254.61 元，折合 25,254.61 份长盛中证红利低波动 100 指数 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 131,105,051.86 元，折合 131,105,051.86 份长盛中证红利低波动 100 指数 C 类基金份额。长盛中证红利低波动 100 指数 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 248,194,227.87 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 248,194,227.87 份长盛中证红利低波动 100 指数基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用、而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基

金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

本基金的投资范围主要包括标的指数成份股及备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，基金还可投资于包括国内依法发行上市的股票（包括沪深证券交易所、北京证券交易所及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在符合法律法规规定的情况下，本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。未来在法律法规允许的前提下，本基金可根据相关法律法规规定参与融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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。本基金业绩比较基准：中证红利低波动 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%

#### 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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 2025 年 6 月 30 日和 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动

情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

###### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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。

交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具),按照公允价值进行后续计量,其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。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）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其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；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金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予以确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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 号文《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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》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 号文《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 号文《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。

#### 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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 4,345,358.24           |
| 等于：本金          | 4,345,139.50           |
| 加：应计利息         | 218.74                 |
| 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           | 6,854,168.29           |
| 等于：本金          | 6,854,048.81           |
| 加：应计利息         | 119.48                 |
| 减：坏账准备         | -                      |
| 合计             | 11,199,526.53          |

注：其他存款余额为存放在证券经纪商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<br>2025 年 6 月 30 日 |      |                |            |
|-------------------|------------------------|------|----------------|------------|
|                   | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票                | 119,084,961.66         | -    | 119,369,798.00 | 284,836.34 |
| 贵金属投资-金交所<br>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     | 119,084,961.66 | - | 119,369,798.00 | 284,836.34 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025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      | -                 |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 88,268.27         |
| 合计          | 88,268.27         |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 长盛中证红利低波动 100 指数 A

| 项目   | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                |
|------|----------------------------|----------------|
|      | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末 | 117,089,176.01             | 117,089,176.01 |
| 本期申购 | 38,831,458.50              | 38,831,458.50  |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -98,806,715.06 | -98,806,715.06 |
| 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           | 57,113,919.45  | 57,113,919.45  |

## 长盛中证红利低波动 100 指数 C

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 131,105,051.86                        | 131,105,051.86 |
| 本期申购          | 7,481,688.23                          | 7,481,688.23   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -70,419,286.85                        | -70,419,286.85 |
| 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           | 68,167,453.24                         | 68,167,453.24  |

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 长盛中证红利低波动 100 指数 A

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分       | 未分配利润合计      |
|----------------|-------------|-------------|--------------|
| 上年度末           | -17,850.95  | -115,887.96 | -133,738.91  |
| 本期期初           | -17,850.95  | -115,887.96 | -133,738.91  |
| 本期利润           | 987,910.88  | 125,298.18  | 1,113,209.06 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -70,817.89  | 29,777.64   | -41,040.25   |
| 其中：基金申购款       | 142,867.65  | 124,301.80  | 267,169.45   |
| 基金赎回款          | -213,685.54 | -94,524.16  | -308,209.70  |
| 本期已分配利润        | -           | -           | -            |
| 本期末            | 899,242.04  | 39,187.86   | 938,429.90   |

## 长盛中证红利低波动 100 指数 C

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分       | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 上年度末           | -25,002.58   | -129,755.16 | -154,757.74  |
| 本期期初           | -25,002.58   | -129,755.16 | -154,757.74  |
| 本期利润           | 1,089,914.76 | 405,181.28  | 1,495,096.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -61,515.21   | -229,026.67 | -290,541.88  |

|          |              |             |              |
|----------|--------------|-------------|--------------|
| 其中：基金申购款 | 4,800.00     | -1,423.88   | 3,376.12     |
| 基金赎回款    | -66,315.21   | -227,602.79 | -293,918.00  |
| 本期已分配利润  | -            | -           | -            |
| 本期末      | 1,003,396.97 | 46,399.45   | 1,049,796.42 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |  |
|-----------|----------------------|--|
|           | 2025年1月1日至2025年6月30日 |  |
| 活期存款利息收入  | 4,068.15             |  |
| 定期存款利息收入  | -                    |  |
| 其他存款利息收入  | 32,600.76            |  |
| 结算备付金利息收入 | -                    |  |
| 其他        | -                    |  |
| 合计        | 36,668.91            |  |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   |  |
|------------------|----------------------|--|
|                  | 2025年1月1日至2025年6月30日 |  |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -723,573.25          |  |
| 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               | -723,573.25          |  |

##### 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                   |  |
|------------|----------------------|--|
|            | 2025年1月1日至2025年6月30日 |  |
| 卖出股票成交总额   | 98,983,400.91        |  |
| 减：卖出股票成本总额 | 99,231,110.60        |  |
| 减：交易费用     | 475,863.56           |  |
| 买卖股票差价收入   | -723,573.25          |  |

#### 6.4.7.15 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 3,561,070.15                    |
| 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            | 3,561,070.15                    |

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | 530,479.46                      |
| 股票投资                   | 530,479.46                      |
| 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                | -                               |
| 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                     | 530,479.46                      |

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 1,909.59                        |
| 基金转换费收入 | 3.12                            |
| 合计      | 1,912.71                        |

**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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 28,760.90                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行费用    | 1,860.03                              |
| 开户费     | 1,200.00                              |
| 合计      | 91,328.30                             |

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

1、财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），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。

2、本基金的管理人于 2025 年 7 月 4 日发布分红公告，向截至 2025 年 7 月 8 日止本基金登记注册的份额持有人进行利润分配，长盛中证红利低波动 100 指数 A 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.0790 元；长盛中证红利低波动 100 指数 C 类按每 10 份基金份额分配红利人民币 0.0740 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 国元证券股份有限公司（“国元证券”）   | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                     |
|-------|----------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
| 国元证券  | 69,234,187.21              | 29.31               |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                   |              |                     |
|-------|----------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                   | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 国元证券  | 112,960.95                 | 27.47             | -            | -                   |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的研究服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 498,298.69                 |

|                  |            |
|------------------|------------|
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 219,516.19 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 278,782.50 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年管理费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 99,659.72                       |

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

$$H = E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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                              |                       |           |
|----------------|---------------------------------|-----------------------|-----------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                       |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                       |           |
|                | 长盛中证红利低波动<br>100 指数 A           | 长盛中证红利低波动<br>100 指数 C | 合计        |
| 长盛基金公司         | -                               | 49.80                 | 49.80     |
| 兴业银行           | -                               | 33,751.39             | 33,751.39 |
| 国元证券           | -                               | 45,182.67             | 45,182.67 |
| 合计             | -                               | 78,983.86             | 78,983.86 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费率 0.20%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                              |           |
|-------|---------------------------------|-----------|
|       | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |           |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 兴业银行  | 4,345,358.24                    | 4,068.15  |
| 国元证券  | 3,180,435.06                    | 8,250.57  |
| 合计    | 7,525,793.30                    | 12,318.72 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行和证券经纪商国元证券保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配情况请参见资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末（2025 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的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，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，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过

基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而信用风险不重大。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来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<br>2025年6月30日   | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------|----------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                  |                |      |      |                |                |
| 货币资金                | 11,199,188.31  | -    | -    | 338.22         | 11,199,526.53  |
| 交易性金融资产             | -              | -    | -    | 119,369,798.00 | 119,369,798.00 |
| 应收申购款               | -              | -    | -    | 1,429,239.55   | 1,429,239.55   |
| 资产总计                | 11,199,188.31  | -    | -    | 120,799,375.77 | 131,998,564.08 |
| 负债                  |                |      |      |                |                |
| 应付赎回款               | -              | -    | -    | 4,558,503.70   | 4,558,503.70   |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -    | 57,974.80      | 57,974.80      |
| 应付托管费               | -              | -    | -    | 11,594.94      | 11,594.94      |
| 应付销售服务费             | -              | -    | -    | 12,623.36      | 12,623.36      |
| 其他负债                | -              | -    | -    | 88,268.27      | 88,268.27      |
| 负债总计                | -              | -    | -    | 4,728,965.07   | 4,728,965.07   |
| 利率敏感度缺口             | 11,199,188.31  | -    | -    | 116,070,410.70 | 127,269,599.01 |
| 上年度末<br>2024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                | 167,064,208.39 | -    | -    | 13,835.46      | 167,078,043.85 |
| 交易性金融资产             | -              | -    | -    | 80,861,186.00  | 80,861,186.00  |
| 资产总计                | 167,064,208.39 | -    | -    | 80,875,021.46  | 247,939,229.85 |
| 负债                  |                |      |      |                |                |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -    | 23,736.14      | 23,736.14      |
| 应付托管费               | -              | -    | -    | 4,747.22       | 4,747.22       |
| 应付销售服务费             | -              | -    | -    | 5,015.27       | 5,015.27       |
| 负债总计                | -              | -    | -    | 33,498.63      | 33,498.63      |
| 利率敏感度缺口             | 167,064,208.39 | -    | -    | 80,841,522.83  | 247,905,731.22 |

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

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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<br>2025年6月30日 |                  | 上年度末<br>2024年12月31日 |                  |
|--------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
|              | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 119,369,798.00    | 93.79            | 80,861,186.00       | 32.62            |
| 合计           | 119,369,798.00    | 93.79            | 80,861,186.00       | 32.62            |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设            | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|---------------|----------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析            | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|               |                      | 本期末（2025年6月30日）             | 上年度末（2024年12月31日） |
|               | 1. 业绩比较基准上升5%        | 4,367,514.65                | -                 |
| 2. 业绩比较基准下降5% | -4,367,514.65        | -                           |                   |

注：于上年度末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

#### 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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 119,369,798.00         | 80,861,186.00            |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 119,369,798.00         | 80,861,186.00            |

###### 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（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，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。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 119,369,798.00 | 90.43         |
|    | 其中：股票             | 119,369,798.00 | 90.43         |
| 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      | 11,199,526.53  | 8.48          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,429,239.55   | 1.08          |
| 9  | 合计                | 131,998,564.08 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | 10,582,067.00 | 8.31          |
| C  | 制造业              | 41,297,177.00 | 32.45         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,774,387.00  | 4.54          |
| E  | 建筑业              | 6,249,113.00  | 4.91          |
| F  | 批发和零售业           | 4,589,637.00  | 3.61          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 11,887,948.00 | 9.34          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,530,680.00  | 1.20          |
| J  | 金融业              | 29,897,235.00 | 23.49         |
| K  | 房地产业             | 1,865,409.00  | 1.47          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,690,435.00  | 2.11          |
| 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     | 335,936.00     | 0.26  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 116,700,024.00 | 91.70 |

### 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              | 242,424.00   | 0.19         |
| C  | 制造业              | 1,186,316.00 | 0.93         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 283,284.00   | 0.22         |
| 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  | 12,400.00    | 0.01         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 945,350.00   | 0.74         |
| 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               | 2,669,774.00 | 2.10         |

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 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（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000937 | 冀中能源 | 676,800 | 3,891,600.00 | 3.06         |
| 2  | 601006 | 大秦铁路 | 423,700 | 2,796,420.00 | 2.20         |
| 3  | 600755 | 厦门国贸 | 444,700 | 2,690,435.00 | 2.11         |
| 4  | 601568 | 北元集团 | 622,600 | 2,583,790.00 | 2.03         |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 378,700 | 2,135,868.00 | 1.68         |
| 6  | 600177 | 雅戈尔  | 290,400 | 2,119,920.00 | 1.67         |
| 7  | 600273 | 嘉化能源 | 250,400 | 2,118,384.00 | 1.66         |
| 8  | 601088 | 中国神华 | 50,100  | 2,031,054.00 | 1.60         |
| 9  | 603156 | 养元饮品 | 95,700  | 2,025,012.00 | 1.59         |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 80,400  | 1,962,564.00 | 1.54         |
| 11 | 600502 | 安徽建工 | 375,800 | 1,766,260.00 | 1.39         |
| 12 | 600585 | 海螺水泥 | 81,900  | 1,758,393.00 | 1.38         |
| 13 | 600282 | 南钢股份 | 408,100 | 1,714,020.00 | 1.35         |
| 14 | 002032 | 苏泊尔  | 31,900  | 1,671,241.00 | 1.31         |
| 15 | 002004 | 华邦健康 | 395,800 | 1,650,486.00 | 1.30         |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 36,100  | 1,621,612.00 | 1.27         |
| 17 | 002267 | 陕天然气 | 210,000 | 1,589,700.00 | 1.25         |
| 18 | 600820 | 隧道股份 | 256,800 | 1,566,480.00 | 1.23         |
| 19 | 600941 | 中国移动 | 13,600  | 1,530,680.00 | 1.20         |
| 20 | 600873 | 梅花生物 | 141,700 | 1,514,773.00 | 1.19         |
| 21 | 600064 | 南京高科 | 193,900 | 1,494,969.00 | 1.17         |
| 22 | 002233 | 塔牌集团 | 197,500 | 1,461,500.00 | 1.15         |
| 23 | 002304 | 洋河股份 | 22,300  | 1,439,465.00 | 1.13         |
| 24 | 600655 | 豫园股份 | 258,100 | 1,432,455.00 | 1.13         |
| 25 | 600741 | 华域汽车 | 80,500  | 1,420,825.00 | 1.12         |
| 26 | 601598 | 中国外运 | 285,200 | 1,406,036.00 | 1.10         |
| 27 | 601369 | 陕鼓动力 | 158,600 | 1,390,922.00 | 1.09         |
| 28 | 000513 | 丽珠集团 | 38,000  | 1,369,520.00 | 1.08         |
| 29 | 601318 | 中国平安 | 24,600  | 1,364,808.00 | 1.07         |
| 30 | 601668 | 中国建筑 | 234,700 | 1,354,219.00 | 1.06         |
| 31 | 600737 | 中粮糖业 | 141,400 | 1,336,230.00 | 1.05         |
| 32 | 600750 | 江中药业 | 60,800  | 1,327,264.00 | 1.04         |
| 33 | 601857 | 中国石油 | 155,100 | 1,326,105.00 | 1.04         |
| 34 | 600033 | 福建高速 | 368,100 | 1,303,074.00 | 1.02         |
| 35 | 601222 | 林洋能源 | 228,300 | 1,301,310.00 | 1.02         |
| 36 | 600548 | 深高速  | 124,200 | 1,300,374.00 | 1.02         |
| 37 | 600901 | 江苏金租 | 212,900 | 1,290,174.00 | 1.01         |
| 38 | 000012 | 南玻A  | 273,800 | 1,264,956.00 | 0.99         |
| 39 | 600016 | 民生银行 | 264,400 | 1,255,900.00 | 0.99         |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 40 | 600019 | 宝钢股份  | 187,100 | 1,232,989.00 | 0.97 |
| 41 | 600284 | 浦东建设  | 186,200 | 1,228,920.00 | 0.97 |
| 42 | 600008 | 首创环保  | 401,500 | 1,212,530.00 | 0.95 |
| 43 | 600328 | 中盐化工  | 158,200 | 1,210,230.00 | 0.95 |
| 44 | 600089 | 特变电工  | 101,000 | 1,204,930.00 | 0.95 |
| 45 | 000983 | 山西焦煤  | 187,100 | 1,197,440.00 | 0.94 |
| 46 | 600863 | 内蒙华电  | 288,000 | 1,183,680.00 | 0.93 |
| 47 | 000429 | 粤高速 A | 88,200  | 1,175,706.00 | 0.92 |
| 48 | 601328 | 交通银行  | 143,700 | 1,149,600.00 | 0.90 |
| 49 | 000685 | 中山公用  | 129,700 | 1,138,766.00 | 0.89 |
| 50 | 601009 | 南京银行  | 97,800  | 1,136,436.00 | 0.89 |
| 51 | 600350 | 山东高速  | 106,200 | 1,132,092.00 | 0.89 |
| 52 | 600887 | 伊利股份  | 39,800  | 1,109,624.00 | 0.87 |
| 53 | 601169 | 北京银行  | 160,800 | 1,098,264.00 | 0.86 |
| 54 | 600035 | 楚天高速  | 257,300 | 1,090,952.00 | 0.86 |
| 55 | 600916 | 中国黄金  | 130,000 | 1,062,100.00 | 0.83 |
| 56 | 601988 | 中国银行  | 187,700 | 1,054,874.00 | 0.83 |
| 57 | 600648 | 外高桥   | 96,500  | 1,054,745.00 | 0.83 |
| 58 | 601398 | 工商银行  | 137,900 | 1,046,661.00 | 0.82 |
| 59 | 002091 | 江苏国泰  | 143,100 | 1,040,337.00 | 0.82 |
| 60 | 600572 | 康恩贝   | 236,200 | 1,034,556.00 | 0.81 |
| 61 | 601187 | 厦门银行  | 152,100 | 1,032,759.00 | 0.81 |
| 62 | 601939 | 建设银行  | 108,100 | 1,020,464.00 | 0.80 |
| 63 | 601658 | 邮储银行  | 186,500 | 1,020,155.00 | 0.80 |
| 64 | 601818 | 光大银行  | 245,000 | 1,016,750.00 | 0.80 |
| 65 | 601288 | 农业银行  | 170,200 | 1,000,776.00 | 0.79 |
| 66 | 002966 | 苏州银行  | 107,800 | 946,484.00   | 0.74 |
| 67 | 600582 | 天地科技  | 157,700 | 944,623.00   | 0.74 |
| 68 | 601229 | 上海银行  | 89,000  | 944,290.00   | 0.74 |
| 69 | 600919 | 江苏银行  | 78,900  | 942,066.00   | 0.74 |
| 70 | 600015 | 华夏银行  | 113,300 | 896,203.00   | 0.70 |
| 71 | 601997 | 贵阳银行  | 143,100 | 892,944.00   | 0.70 |
| 72 | 601077 | 渝农商行  | 118,900 | 848,946.00   | 0.67 |
| 73 | 001227 | 兰州银行  | 326,600 | 816,500.00   | 0.64 |
| 74 | 601963 | 重庆银行  | 71,100  | 772,146.00   | 0.61 |
| 75 | 601998 | 中信银行  | 90,200  | 766,700.00   | 0.60 |
| 76 | 601825 | 沪农商行  | 77,800  | 754,660.00   | 0.59 |
| 77 | 601838 | 成都银行  | 36,600  | 735,660.00   | 0.58 |
| 78 | 002807 | 江阴银行  | 153,200 | 727,700.00   | 0.57 |
| 79 | 600926 | 杭州银行  | 43,200  | 726,624.00   | 0.57 |
| 80 | 600036 | 招商银行  | 15,500  | 712,225.00   | 0.56 |
| 81 | 000001 | 平安银行  | 58,200  | 702,474.00   | 0.55 |
| 82 | 601860 | 紫金银行  | 230,900 | 692,700.00   | 0.54 |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 83 | 002948 | 青岛银行 | 131,900 | 656,862.00 | 0.52 |
| 84 | 600928 | 西安银行 | 161,500 | 633,080.00 | 0.50 |
| 85 | 601577 | 长沙银行 | 62,500  | 621,250.00 | 0.49 |
| 86 | 002839 | 张家港行 | 137,800 | 620,100.00 | 0.49 |
| 87 | 603167 | 渤海轮渡 | 47,500  | 541,500.00 | 0.43 |
| 88 | 000538 | 云南白药 | 8,700   | 485,373.00 | 0.38 |
| 89 | 601000 | 唐山港  | 110,600 | 449,036.00 | 0.35 |
| 90 | 600987 | 航民股份 | 59,000  | 417,130.00 | 0.33 |
| 91 | 600007 | 中国国贸 | 18,000  | 370,440.00 | 0.29 |
| 92 | 600018 | 上港集团 | 62,800  | 358,588.00 | 0.28 |
| 93 | 600757 | 长江传媒 | 36,200  | 335,936.00 | 0.26 |
| 94 | 000591 | 太阳能  | 76,300  | 334,957.00 | 0.26 |
| 95 | 000900 | 现代投资 | 79,000  | 334,170.00 | 0.26 |
| 96 | 601390 | 中国中铁 | 59,400  | 333,234.00 | 0.26 |
| 97 | 600236 | 桂冠电力 | 50,200  | 314,754.00 | 0.25 |
| 98 | 002478 | 常宝股份 | 59,000  | 309,750.00 | 0.24 |
| 99 | 600535 | 天士力  | 18,900  | 295,785.00 | 0.23 |

### 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（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000708 | 中信特钢 | 85,800  | 1,009,008.00 | 0.79         |
| 2  | 002027 | 分众传媒 | 129,500 | 945,350.00   | 0.74         |
| 3  | 601225 | 陕西煤业 | 12,600  | 242,424.00   | 0.19         |
| 4  | 605368 | 蓝天燃气 | 18,600  | 183,024.00   | 0.14         |
| 5  | 000830 | 鲁西化工 | 17,000  | 175,100.00   | 0.14         |
| 6  | 601158 | 重庆水务 | 21,400  | 99,296.00    | 0.08         |
| 7  | 601728 | 中国电信 | 1,600   | 12,400.00    | 0.01         |
| 8  | 601216 | 君正集团 | 400     | 2,208.00     | 0.00         |
| 9  | 600461 | 洪城环境 | 100     | 964.00       | 0.00         |

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 000937 | 冀中能源 | 3,597,499.00 | 1.45           |
| 2  | 600177 | 雅戈尔  | 2,422,125.00 | 0.98           |
| 3  | 601006 | 大秦铁路 | 2,306,405.00 | 0.93           |
| 4  | 600755 | 厦门国贸 | 2,218,644.00 | 0.89           |
| 5  | 601222 | 林洋能源 | 2,143,067.00 | 0.86           |
| 6  | 601598 | 中国外运 | 2,097,718.00 | 0.85           |
| 7  | 601369 | 陕鼓动力 | 2,035,964.00 | 0.82           |
| 8  | 600750 | 江中药业 | 2,013,419.00 | 0.81           |
| 9  | 002027 | 分众传媒 | 1,977,725.00 | 0.80           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 601568 | 北元集团 | 1,966,430.00 | 0.79 |
| 11 | 600273 | 嘉化能源 | 1,952,811.00 | 0.79 |
| 12 | 600648 | 外高桥  | 1,908,478.00 | 0.77 |
| 13 | 600284 | 浦东建设 | 1,907,177.00 | 0.77 |
| 14 | 601225 | 陕西煤业 | 1,875,905.00 | 0.76 |
| 15 | 600008 | 首创环保 | 1,868,682.00 | 0.75 |
| 16 | 000895 | 双汇发展 | 1,825,654.00 | 0.74 |
| 17 | 601857 | 中国石油 | 1,824,118.00 | 0.74 |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 1,791,612.00 | 0.72 |
| 19 | 603156 | 养元饮品 | 1,751,022.00 | 0.71 |
| 20 | 000685 | 中山公用 | 1,740,363.00 | 0.70 |

#### 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  | 601225 | 陕西煤业  | 2,582,890.00 | 1.04           |
| 2  | 000581 | 威孚高科  | 2,500,558.00 | 1.01           |
| 3  | 000830 | 鲁西化工  | 2,445,565.00 | 0.99           |
| 4  | 601728 | 中国电信  | 2,230,244.00 | 0.90           |
| 5  | 605368 | 蓝天燃气  | 2,220,417.00 | 0.90           |
| 6  | 601006 | 大秦铁路  | 2,139,249.00 | 0.86           |
| 7  | 000937 | 冀中能源  | 2,006,733.00 | 0.81           |
| 8  | 601158 | 重庆水务  | 1,928,762.00 | 0.78           |
| 9  | 600177 | 雅戈尔   | 1,741,907.00 | 0.70           |
| 10 | 601216 | 君正集团  | 1,740,651.00 | 0.70           |
| 11 | 600461 | 洪城环境  | 1,706,135.00 | 0.69           |
| 12 | 000157 | 中联重科  | 1,651,419.00 | 0.67           |
| 13 | 600479 | 千金药业  | 1,584,040.00 | 0.64           |
| 14 | 600704 | 物产中大  | 1,490,487.00 | 0.60           |
| 15 | 000429 | 粤高速 A | 1,405,754.00 | 0.57           |
| 16 | 600377 | 宁沪高速  | 1,355,491.00 | 0.55           |
| 17 | 600273 | 嘉化能源  | 1,354,543.00 | 0.55           |
| 18 | 000333 | 美的集团  | 1,332,370.00 | 0.54           |
| 19 | 600929 | 雪天盐业  | 1,322,155.00 | 0.53           |
| 20 | 002545 | 东方铁塔  | 1,318,201.00 | 0.53           |

#### 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 | 137,209,243.14 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 98,983,400.91  |

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | -            |
| 2  | 应收清算款 | -            |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 1,429,239.55 |
| 6  | 其他应收款 | -            |

|   |      |              |
|---|------|--------------|
| 7 | 待摊费用 | -            |
| 8 | 其他   | -            |
| 9 | 合计   | 1,429,239.55 |

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                           | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基金<br>份额 | 持有人结构        |                   |                |                       |
|--------------------------------|--------------|---------------|--------------|-------------------|----------------|-----------------------|
|                                |              |               | 机构投资者        |                   | 个人投资者          |                       |
|                                |              |               | 持有份额         | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 长盛中证<br>红利低波<br>动 100 指<br>数 A | 489          | 116,797.38    | 1,492,499.95 | 2.61              | 55,621,419.50  | 97.39                 |
| 长盛中证<br>红利低波<br>动 100 指<br>数 C | 674          | 101,138.65    | 350,033.33   | 0.51              | 67,817,419.91  | 99.49                 |
| 合计                             | 1,163        | 107,722.59    | 1,842,533.28 | 1.47              | 123,438,839.41 | 98.53                 |

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|----|------|-----------|-------------|
|----|------|-----------|-------------|

|                  |                    |            |        |
|------------------|--------------------|------------|--------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长盛中证红利低波动 100 指数 A | 51,791.24  | 0.0907 |
|                  | 长盛中证红利低波动 100 指数 C | 50,027.78  | 0.0734 |
|                  | 合计                 | 101,819.02 | 0.0813 |

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

### 8.3 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 | 长盛中证红利低波动 100 指数 A | 0                 |
|                                | 长盛中证红利低波动 100 指数 C | 0~10              |
|                                | 合计                 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 长盛中证红利低波动 100 指数 A | 0                 |
|                                | 长盛中证红利低波动 100 指数 C | 0                 |
|                                | 合计                 | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                              | 长盛中证红利低波动 100 指数 A | 长盛中证红利低波动 100 指数 C |
|---------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2024 年 12 月 24 日）基金份额总额 | 117,089,176.01     | 131,105,051.86     |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 117,089,176.01     | 131,105,051.86     |
| 本报告期基金总申购份额                     | 38,831,458.50      | 7,481,688.23       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 98,806,715.06      | 70,419,286.85      |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -                  | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 57,113,919.45      | 68,167,453.24      |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

### 10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未发生变动。

### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用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 (%) |    |
| 西部证券 | 3      | 166,958,456.84 | 70.69            | 298,220.33 | 72.53          | -  |
| 国元证券 | 2      | 69,234,187.21  | 29.31            | 112,960.95 | 27.47          | -  |

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式。本基金管理人负责选择证券公司，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券公司的选择标准如下：

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

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

(3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要。

(4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

## 2、证券公司的选择程序

(1) 基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券公司。

(2) 基金管理人和被选中的证券公司签订协议。

## 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  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信期货有限公司费率优惠活动的公告               | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 20 日 |
| 2  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券华南股份有限公司费率优惠活动的公告           | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 20 日 |
| 3  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券（山东）有限责任公司费率优惠活动的公告         | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 20 日 |
| 4  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券股份有限公司费率优惠活动的公告             | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 20 日 |
| 5  | 长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告   | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 2 月 25 日 |
| 6  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告                 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 7  | 长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告            | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 8  | 长盛基金管理有限公司关于增加开源证券为旗下部分开放式基金销售机构及开通基金定投业务与转换业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 5 月 20 日 |
| 9  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行股份有限公司为销售机                  | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网  | 2025 年 5 月 23 日 |

|               |   |
|---------------|---|
| 构并参加费率优惠活动的公告 | 站 |
|---------------|---|

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日