

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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	43
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末上市基金前十名持有人	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同智优势混合（LOF）
场内简称	长盛同智 LOF
基金主代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 5 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	460,688,271.75 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性 & 资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径，投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66596688
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		胡甲	葛海蛟

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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)
本期已实现收益	-23,195,691.77
本期利润	-18,422,200.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0394
本期加权平均净值利润率	-6.01%
本期基金份额净值增长率	-5.62%
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	-159,701,837.56
期末可供分配基金份额利润	-0.3467
期末基金资产净值	300,986,434.19
期末基金份额净值	0.6533
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	93.71%

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、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.73%	0.77%	1.78%	0.37%	1.95%	0.40%

过去三个月	-0.21%	1.09%	1.29%	0.70%	-1.50%	0.39%
过去六个月	-5.62%	0.98%	0.61%	0.65%	-6.23%	0.33%
过去一年	14.86%	2.01%	11.11%	0.89%	3.75%	1.12%
过去三年	-36.11%	1.69%	-2.89%	0.71%	-33.22%	0.98%
自基金转型起至今	93.71%	1.55%	119.62%	1.05%	-25.91%	0.50%

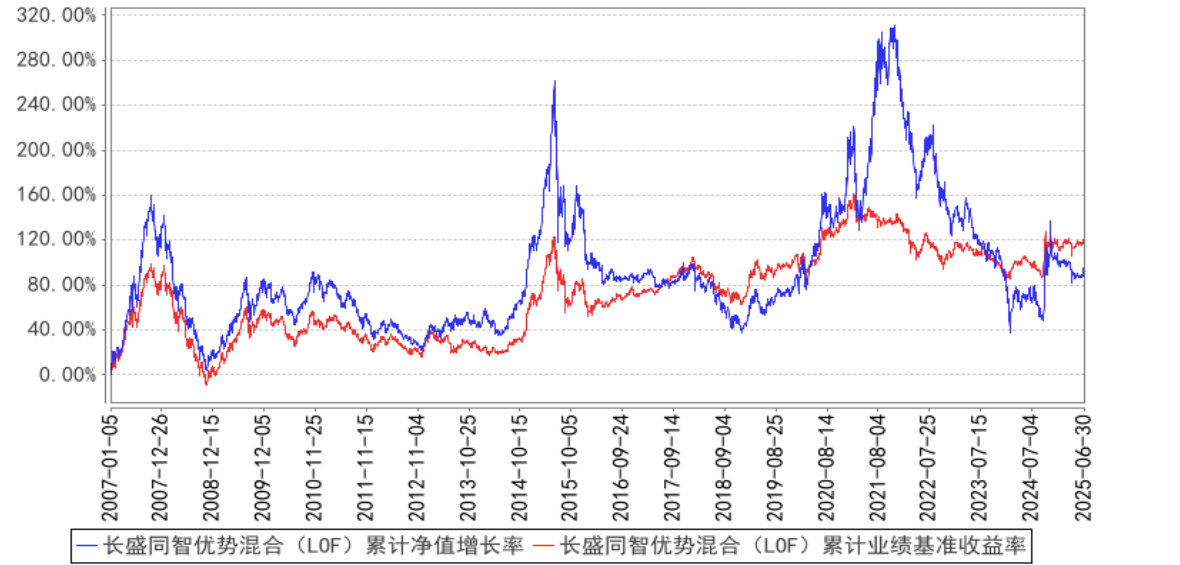
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0—65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。
- 3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 65%、30%、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 自基金转型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

长盛同智优势混合（LOF）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、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。
2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组

合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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		
钱文礼	本基金基金经理，长盛成长龙头混合型证券投资基金基金经理，长盛成长精选混合型证券投资基金基金经理。	2023 年 4 月 13 日	-	16 年	钱文礼先生，硕士。曾任平安证券，金元证券，国海证券研究员。2013 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理等职务。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合

同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内宏观经济维持平稳增长，在“以旧换新”政策刺激下消费增速有所增加，消费增长对经济起到了很好的托底作用。上半年出口超市场预期，在关税压力导致部分企业提前备货的

影响下，出口增速明显超出市场预期，成为上半年经济重要的拉动力。PPI 连续多季度负增长，到六月份 PPI 下滑幅度进一步加大，后续反内卷能否提升 PPI 有待进一步验证，CPI 低位运行，反映企业盈利承压。投资快速增长，但是环比逐步回落。政府债券发行快速增长，保证了社融的稳定增长，个人和企业的融资需求依然较弱。

上半年指数震荡上行，缓慢抬升，整体行情偏成长投资和主题投资，小市值股票表现优于大盘股。大盘价值股中除了银行外，其他行业机会缺乏。科技股赚钱效应主要集中在 1 季度，在进入到 3 月份以后赚钱效应明显减弱，在 6 月份有所恢复。反思上半年基金配置错误在于基金配置小盘成长股占比较低，大盘价值股占比较高，在 4 月份大盘下跌时跟随大盘下跌，但是在后续反弹中反弹较少，未能获得反弹收益，大盘价值股中银行股的配置比例偏低，周期价值股配置偏高导致亏损。根据行情走势，基金持仓做了以下调整：

一、减少周期行业的配置，增加了稀土的配置。二季度固定资产投资环比走弱，特别是五月份固定资产投资环比增速明显减弱，水泥等周期品价格在一季度走高后持续走弱回落，基金减少了对于周期行业的配置。无论是下游需求还是国家战略层面稀土的重要性都更加突出，基金增加了对中重稀土行业的配置。

二、增加了大金融的配置。基金增加了较多的银行和非银的行业配置，当前银行板块市净率（PB）普遍低于 1，相对小盘成长股涨幅较小，存在均值回归动力。市场交易日趋活跃，港股 IPO 快速增大这些都给券商带来了业绩支撑。基金增加了大金融板块的配置，希望获得估值修复和业务创新带来的收益。

三、减仓食品饮料，增加了部分低位绩优成长股的配置。二季度餐饮行业客流为平淡，基金减配了食品饮料行业个股。临近中报基金增加了部分业绩高增长，同时估值合理的成长股的配置。在化工、半导体、军工等行业，有些个股业绩能够实现高速增长，估值相对合理，股价也处在底部，基金增加了部分低位绩优股的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6533 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.62%，同期业绩比较基准收益率为 0.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济在出口和消费两方面都会面临比上半年更大的压力，同时市场也预期政策上会加大的刺激力度，宏观经济有望保持稳定增长。行情上看小盘和主题投资在上半年有较强的超额收益，进入三季度在大金融的带动下指数有望持续上行，个股有进一步上涨的空间。伴随中报业绩的落地，业绩高速增长，估值较低的个股有望迎来股价上涨估值修复，大盘价值股也

有望迎来估值提升。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,294,225.18	18,360,089.70
结算备付金		1,983,227.94	2,612,201.59
存出保证金		173,762.51	128,227.27
交易性金融资产	6.4.7.2	281,376,229.44	308,382,708.89
其中：股票投资		281,376,229.44	308,382,708.89
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		192,181.28	2,377,084.18
应收股利		-	-

应收申购款		1,773.65	5,739.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		305,021,400.00	331,866,050.97
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		1,454,333.07	741,519.09
应付赎回款		456,618.22	353,842.24
应付管理人报酬		290,502.94	334,751.35
应付托管费		48,417.16	55,791.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		305,932.19	305,932.19
应付利润		428,798.09	428,798.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,050,364.14	1,294,451.38
负债合计		4,034,965.81	3,515,086.23
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	460,688,271.75	474,331,878.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-159,701,837.56	-145,980,913.50
净资产合计		300,986,434.19	328,350,964.74
负债和净资产总计		305,021,400.00	331,866,050.97

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.6533 元，基金份额总额 460,688,271.75 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-16,178,975.86	-37,511,430.43
1. 利息收入		48,684.97	38,340.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	48,684.97	38,340.82
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）		-21,004,572.07	-35,275,753.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-24,693,283.00	-36,479,287.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	5,522.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	3,688,710.93	1,198,011.32
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	4,773,491.25	-2,276,734.91
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	3,419.99	2,717.49
减：二、营业总支出		2,243,224.66	2,022,802.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,825,226.16	1,637,713.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	304,204.39	272,952.25
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	113,794.11	112,137.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,422,200.52	-39,534,233.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,422,200.52	-39,534,233.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-18,422,200.52	-39,534,233.33

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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 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	474,331,878.24	-145,980,913.50	328,350,964.74
二、本期期初净资产	474,331,878.24	-145,980,913.50	328,350,964.74
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-13,643,606.49	-13,720,924.06	-27,364,530.55
（一）、综合收益总额	-	-18,422,200.52	-18,422,200.52
（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）	-13,643,606.49	4,701,276.46	-8,942,330.03
其中：1. 基金申购款	2,012,781.24	-687,872.45	1,324,908.79
2. 基金赎回款	-15,656,387.73	5,389,148.91	-10,267,238.82
（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	460,688,271.75	-159,701,837.56	300,986,434.19
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	483,851,039.97	-168,914,418.79	314,936,621.18
二、本期期初净资产	483,851,039.97	-168,914,418.79	314,936,621.18
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-4,766,732.84	-37,687,496.20	-42,454,229.04
（一）、综合收益总额	-	-39,534,233.33	-39,534,233.33
（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）	-4,766,732.84	1,846,737.13	-2,919,995.71

其中：1. 基金申购款	8,576,289.93	-3,901,942.61	4,674,347.32
2. 基金赎回款	-13,343,022.77	5,748,679.74	-7,594,343.03
（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	479,084,307.13	-206,601,914.99	272,482,392.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

胡甲

张壬午

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2006]260 号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自 2007 年 1 月 5 日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金于 2007 年 1 月 22 日（“转换基准日”）的基金净值为人民币 955,116,003.53 元，于 2007 年 1 月 23 日（“转换日”）折合基金份额 955,116,000.00 份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×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 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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费附加，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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	21,294,225.18
等于：本金	21,291,917.68
加：应计利息	2,307.50
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	21,294,225.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		269,944,364.40	-	281,376,229.44	11,431,865.04
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		269,944,364.40	-	281,376,229.44	11,431,865.04

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	1,035.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	556,797.39
其中：交易所市场	556,797.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	97,268.27
其他	145,262.54
合计	1,050,364.14

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	474,331,878.24	474,331,878.24
本期申购	2,012,781.24	2,012,781.24
本期赎回（以“-”号填列）	-15,656,387.73	-15,656,387.73
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	460,688,271.75	460,688,271.75

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,904,598.10	-176,885,511.60	-145,980,913.50
本期期初	30,904,598.10	-176,885,511.60	-145,980,913.50
本期利润	-23,195,691.77	4,773,491.25	-18,422,200.52
本期基金份额交易产生的变动数	-506,732.70	5,208,009.16	4,701,276.46
其中：基金申购款	88,869.80	-776,742.25	-687,872.45
基金赎回款	-595,602.50	5,984,751.41	5,389,148.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,202,173.63	-166,904,011.19	-159,701,837.56

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	44,850.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,484.75
其他	350.10
合计	48,684.97

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	-24,693,283.00
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	-24,693,283.00

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	1,398,431,085.79
减：卖出股票成本总额	1,421,003,912.74
减：交易费用	2,120,456.05
买卖股票差价收入	-24,693,283.00

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	3,688,710.93
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	3,688,710.93

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	4,773,491.25
股票投资	4,773,491.25
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	4,773,491.25

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	3,350.33
基金转换费收入	69.66
合计	3,419.99

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 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	6,925.84
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	113,794.11

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

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。

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、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）

国元证券	-	-	119,283,146.02	7.66
------	---	---	----------------	------

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 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	112,830.21	7.74	-	-

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。债券及权证交易不计佣金。

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 2025年1月1日至2025年 6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,825,226.16	1,637,713.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	758,156.01	673,018.46
应支付基金管理人的净管理费	1,067,070.15	964,694.75

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1.20%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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	304,204.39	272,952.25

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

$H=E\times \text{年托管费率}/\text{当年天数}$

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

6.4.10.3 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	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	21,294,225.18	44,850.12	16,486,117.40	29,022.16
合计	21,294,225.18	44,850.12	16,486,117.40	29,022.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	限售期锁定	12.80	35.87	80	1,024.00	2,869.60	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	限售期锁定	7.40	20.08	366	2,708.40	7,349.28	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	限售期锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月	6 个月	限售期锁定	12.08	21.50	178	2,150.24	3,827.00	-

		月 21 日		定						
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	限售 期锁 定	28.33	44.97	173	4,901.09	7,779.81	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	限售 期锁 定	41.90	77.86	182	5,447.00	14,170.52	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	限售 期锁 定	39.92	45.20	289	7,944.08	13,062.80	-
301535	浙江华远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	限售 期锁 定	4.92	18.98	734	3,611.28	13,931.32	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	限售 期锁 定	16.50	33.05	190	3,135.00	6,279.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	限售 期锁 定	89.60	152.21	71	6,361.60	10,806.91	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	限售 期锁 定	17.05	35.86	196	3,341.80	7,028.56	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	限售 期锁 定	33.06	53.69	128	4,231.68	6,872.32	-
301658	首航新能	2025 年 3	6 个月	限售 期锁	11.80	28.63	437	5,156.60	12,511.31	-

		月 26 日		定						
301662	宏工 科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	限售 期锁 定	26.60	94.96	143	3,803.80	13,579.28	-
301665	泰禾 股份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	限售 期锁 定	10.27	28.22	393	4,036.11	11,090.46	-
301678	新恒 汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	限售 期锁 定	12.80	54.21	382	4,889.60	20,708.22	-
603049	中策 橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	限售 期锁 定	46.50	42.99	143	6,649.50	6,147.57	-
603120	肯特 催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	限售 期锁 定	15.00	41.30	65	975.00	2,684.50	-
603124	江南 新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	限售 期锁 定	10.54	46.12	88	927.52	4,058.56	-
603202	天有 为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	限售 期锁 定	93.50	92.79	51	4,768.50	4,732.29	-
603210	泰鸿 万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	限售 期锁 定	8.60	19.70	286	2,459.60	5,634.20	-
603257	中国 瑞林	2025 年 3 月 28	6 个月	限售 期锁 定	20.52	47.39	78	1,600.56	3,696.42	-

		日								
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	限售期锁定	19.88	49.62	57	1,133.16	2,828.34	-
688755	汉邦科技	2025年5月9日	6个月	限售期锁定	22.77	44.55	203	4,622.31	9,043.65	-
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	限售期锁定	9.08	26.35	536	4,866.88	14,123.60	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	限售期锁定	47.27	156.28	256	12,101.12	40,007.68	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；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風險主要包括信用風險、流动性風險及市場風險。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風險控制在限定的范围之内，使本基金在風險和收益之间取得最佳的平衡以实现“風險和收益相匹配”的風險收益目标。本基金的基金管理人对于金融工具的風險管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估測各种風險产生的可能損失。从定性分析的角度出发，判断風險損失的严重程度和出现同类風險損失的頻度。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風險量化指标、模型，日常的量化报告，确定風險損失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种風險进行监督、检查和评估，并通过相应决策，將風險控制在可承受的范围內。

6.4.13.2 信用風險

信用風險是指基金在交易过程中因交易对手未履約合約責任，或者基金所投资證券之發行人出現違約、拒絕支付到期本息，導致基金資產損失和收益變化的風險。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的資信狀況进行了充分的评估，通过对投资品种信用等級评估来控制證券發行人的信用風險，且通过分散化投资以分散信用風險。本基金投资于一家公司發行的證券市值不超过基金資產淨值的 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的證券，不得超过该證券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国證券登記結算有限公司完成證券交收和款項清算，因此違約風險發生的可能性很小；基金在进行銀行間同業市場交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用風險。

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 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	21,291,917.68	-	-	2,307.50	21,294,225.18
结算备付金	1,983,054.42	-	-	173.52	1,983,227.94
存出保证金	173,747.30	-	-	15.21	173,762.51
交易性金融资产	-	-	-	-281,376,229.44	281,376,229.44
应收申购款	-	-	-	1,773.65	1,773.65
应收清算款	-	-	-	192,181.28	192,181.28
资产总计	23,448,719.40	-	-	-281,572,680.60	305,021,400.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	456,618.22	456,618.22
应付管理人报酬	-	-	-	290,502.94	290,502.94
应付托管费	-	-	-	48,417.16	48,417.16
应付清算款	-	-	-	1,454,333.07	1,454,333.07
应付利润	-	-	-	428,798.09	428,798.09
应交税费	-	-	-	305,932.19	305,932.19
其他负债	-	-	-	1,050,364.14	1,050,364.14
负债总计	-	-	-	4,034,965.81	4,034,965.81
利率敏感度缺口	23,448,719.40	-	-	-277,537,714.79	300,986,434.19
上年度末 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	18,358,075.97	-	-	2,013.73	18,360,089.70
结算备付金	2,611,026.59	-	-	1,175.00	2,612,201.59
存出保证金	128,169.57	-	-	57.70	128,227.27
交易性金融资产	-	-	-	-308,382,708.89	308,382,708.89
应收申购款	-	-	-	5,739.34	5,739.34
应收清算款	-	-	-	2,377,084.18	2,377,084.18
资产总计	21,097,272.13	-	-	-310,768,778.84	331,866,050.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	353,842.24	353,842.24
应付管理人报酬	-	-	-	334,751.35	334,751.35
应付托管费	-	-	-	55,791.89	55,791.89
应付清算款	-	-	-	741,519.09	741,519.09
应付利润	-	-	-	428,798.09	428,798.09
应交税费	-	-	-	305,932.19	305,932.19
其他负债	-	-	-	1,294,451.38	1,294,451.38

负债总计	-	-	-	3,515,086.23	3,515,086.23
利率敏感度缺口	21,097,272.13	-	-	-307,253,692.61	328,350,964.74

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	281,376,229.44	93.48	308,382,708.89	93.92
合计	281,376,229.44	93.48	308,382,708.89	93.92

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%	27, 296, 498. 84	34, 292, 713. 72
	2. 业绩比较基准下降 5%	-27, 296, 498. 84	-34, 292, 713. 72

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	281, 116, 020. 20	308, 366, 201. 09
第二层次	15, 385. 54	-
第三层次	244, 823. 70	16, 507. 80
合计	281, 376, 229. 44	308, 382, 708. 89

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	281,376,229.44	92.25
	其中：股票	281,376,229.44	92.25
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	23,277,453.12	7.63
8	其他各项资产	367,717.44	0.12
9	合计	305,021,400.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	132,300,396.46	43.96
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	2,869.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	7,746,400.00	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,295,025.56	5.41
J	金融业	123,297,572.60	40.96
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	1,733,965.22	0.58

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	281,376,229.44	93.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	311,900	14,010,548.00	4.65
2	300059	东方财富	513,400	11,874,942.00	3.95
3	600519	贵州茅台	8,300	11,699,016.00	3.89
4	000333	美的集团	159,700	11,530,340.00	3.83
5	000831	中国稀土	290,900	10,507,308.00	3.49
6	000157	中联重科	1,407,600	10,176,948.00	3.38
7	601628	中国人寿	243,500	10,029,765.00	3.33
8	601881	中国银河	560,700	9,616,005.00	3.19
9	601766	中国中车	1,343,590	9,458,873.60	3.14
10	601658	邮储银行	1,706,000	9,331,820.00	3.10
11	601456	国联民生	864,600	8,948,610.00	2.97
12	601009	南京银行	718,400	8,347,808.00	2.77
13	300033	同花顺	29,500	8,053,795.00	2.68
14	002142	宁波银行	283,600	7,759,296.00	2.58
15	601816	京沪高铁	1,347,200	7,746,400.00	2.57
16	300803	指南针	94,600	7,630,436.00	2.54
17	000001	平安银行	623,000	7,519,610.00	2.50
18	600111	北方稀土	275,800	6,867,420.00	2.28
19	688318	财富趋势	57,810	6,643,525.20	2.21
20	601398	工商银行	842,400	6,393,816.00	2.12
21	600908	无锡银行	976,900	6,164,239.00	2.05
22	600155	华创云信	851,600	5,927,136.00	1.97
23	601128	常熟银行	646,580	4,765,294.60	1.58
24	600745	闻泰科技	141,600	4,747,848.00	1.58
25	002966	苏州银行	530,400	4,656,912.00	1.55
26	600446	金证股份	202,900	3,849,013.00	1.28
27	300274	阳光电源	56,100	3,801,897.00	1.26
28	601288	农业银行	539,500	3,172,260.00	1.05
29	688661	和林微纳	79,042	3,143,500.34	1.04

30	601601	中国太保	82,800	3,105,828.00	1.03
31	688008	澜起科技	36,993	3,033,426.00	1.01
32	688536	思瑞浦	21,508	2,983,589.76	0.99
33	002170	芭田股份	270,000	2,767,500.00	0.92
34	300395	菲利华	49,900	2,549,890.00	0.85
35	603989	艾华集团	148,000	2,279,200.00	0.76
36	600460	士兰微	91,300	2,266,066.00	0.75
37	688508	芯朋微	36,680	2,047,477.60	0.68
38	688522	纳睿雷达	38,803	1,987,489.66	0.66
39	603950	长源东谷	79,200	1,982,376.00	0.66
40	603997	继峰股份	146,300	1,907,752.00	0.63
41	300458	全志科技	47,600	1,889,244.00	0.63
42	688372	伟测科技	28,413	1,716,145.20	0.57
43	301031	中熔电气	21,500	1,712,475.00	0.57
44	688629	华丰科技	27,846	1,592,791.20	0.53
45	001389	广合科技	26,558	1,560,813.66	0.52
46	002881	美格智能	33,100	1,535,840.00	0.51
47	002920	德赛西威	14,800	1,511,524.00	0.50
48	300138	晨光生物	124,700	1,511,364.00	0.50
49	600875	东方电气	88,000	1,473,120.00	0.49
50	688636	智明达	38,221	1,291,487.59	0.43
51	603386	骏亚科技	95,600	1,209,340.00	0.40
52	300308	中际旭创	7,400	1,079,364.00	0.36
53	000823	超声电子	69,400	822,390.00	0.27
54	002281	光迅科技	16,600	818,712.00	0.27
55	002977	火箭科技	19,000	806,930.00	0.27
56	600570	恒生电子	23,000	771,420.00	0.26
57	688685	迈信林	13,803	770,897.55	0.26
58	688147	微导纳米	25,223	761,230.14	0.25
59	688288	鸿泉物联	26,110	757,451.10	0.25
60	001380	华纬科技	36,872	755,138.56	0.25
61	002284	亚太股份	68,300	754,715.00	0.25
62	603890	春秋电子	65,000	754,000.00	0.25
63	688286	敏芯股份	10,638	752,000.22	0.25
64	688667	菱电电控	13,966	743,130.86	0.25
65	688123	聚辰股份	9,083	735,632.17	0.24
66	688775	影石创新	2,554	427,082.80	0.14
67	002703	浙江世宝	31,900	418,528.00	0.14
68	300990	同飞股份	8,200	409,180.00	0.14
69	002597	金禾实业	7,200	169,560.00	0.06
70	600499	科达制造	9,500	93,100.00	0.03
71	688717	艾罗能源	1,694	91,188.02	0.03
72	688169	石头科技	367	57,453.85	0.02

73	300502	新易盛	280	35,565.60	0.01
74	301327	华宝新能	560	28,761.60	0.01
75	000059	华锦股份	4,000	21,560.00	0.01
76	301678	新恒汇	382	20,708.22	0.01
77	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
78	301479	弘景光电	182	14,170.52	0.00
79	688757	胜科纳米	536	14,123.60	0.00
80	301535	浙江华远	734	13,931.32	0.00
81	301662	宏工科技	143	13,579.28	0.00
82	301501	恒鑫生活	289	13,062.80	0.00
83	301566	达利凯普	700	12,985.00	0.00
84	301658	首航新能	437	12,511.31	0.00
85	300763	锦浪科技	200	11,478.00	0.00
86	301665	泰禾股份	393	11,090.46	0.00
87	301590	优优绿能	71	10,806.91	0.00
88	688755	汉邦科技	203	9,043.65	0.00
89	301173	毓恬冠佳	173	7,779.81	0.00
90	600703	三安光电	600	7,452.00	0.00
91	001382	新亚电缆	366	7,349.28	0.00
92	301595	太力科技	196	7,028.56	0.00
93	301636	泽润新能	128	6,872.32	0.00
94	301560	众捷汽车	190	6,279.50	0.00
95	603049	中策橡胶	143	6,147.57	0.00
96	603210	泰鸿万立	286	5,634.20	0.00
97	603202	天有为	51	4,732.29	0.00
98	603124	江南新材	88	4,058.56	0.00
99	001390	古麒绒材	178	3,827.00	0.00
100	603257	中国瑞林	78	3,696.42	0.00
101	001335	信凯科技	80	2,869.60	0.00
102	603400	华之杰	57	2,828.34	0.00
103	603120	肯特催化	65	2,684.50	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	601816	京沪高铁	21,918,875.00	6.68
2	600519	贵州茅台	21,863,777.00	6.66
3	601766	中国中车	17,918,782.80	5.46
4	688036	传音控股	17,003,633.76	5.18
5	601985	中国核电	16,152,932.00	4.92
6	600104	上汽集团	15,399,083.00	4.69
7	688169	石头科技	15,000,650.07	4.57
8	600585	海螺水泥	14,954,948.00	4.55

9	002415	海康威视	13,764,195.00	4.19
10	000858	五 粮 液	13,646,440.00	4.16
11	000528	柳 工	13,637,871.00	4.15
12	688981	中芯国际	13,619,141.69	4.15
13	600801	华新水泥	13,107,865.95	3.99
14	601939	建设银行	13,098,634.60	3.99
15	000401	冀东水泥	13,045,702.00	3.97
16	002475	立讯精密	13,016,263.00	3.96
17	000157	中联重科	12,781,673.00	3.89
18	000672	上峰水泥	12,139,599.40	3.70
19	300274	阳光电源	12,129,404.60	3.69
20	688200	华峰测控	12,008,288.10	3.66
21	000568	泸州老窖	11,755,649.00	3.58
22	688172	燕东微	11,694,587.22	3.56
23	688187	时代电气	11,196,517.72	3.41
24	300059	东方财富	11,079,490.00	3.37
25	002236	大华股份	10,881,247.00	3.31
26	601456	国联民生	10,580,158.00	3.22
27	000831	中国稀土	10,104,008.00	3.08
28	600019	宝钢股份	9,988,949.00	3.04
29	601618	中国中冶	9,812,595.00	2.99
30	001979	招商蛇口	9,749,841.00	2.97
31	600584	长电科技	9,661,145.00	2.94
32	601398	工商银行	9,455,876.00	2.88
33	601881	中国银河	9,417,198.00	2.87
34	601658	邮储银行	9,178,666.00	2.80
35	601009	南京银行	9,072,590.00	2.76
36	601628	中国人寿	9,028,992.00	2.75
37	600600	青岛啤酒	9,016,882.00	2.75
38	600048	保利发展	8,999,886.00	2.74
39	000725	京东方 A	8,887,256.00	2.71
40	002008	大族激光	8,885,981.00	2.71
41	600690	海尔智家	8,852,782.00	2.70
42	300443	金雷股份	8,831,895.00	2.69
43	688484	南芯科技	8,809,820.46	2.68
44	600507	方大特钢	8,646,968.00	2.63
45	000596	古井贡酒	8,293,677.12	2.53
46	603218	日月股份	8,216,362.00	2.50
47	601288	农业银行	8,064,957.00	2.46
48	002487	大金重工	8,028,307.00	2.45
49	600132	重庆啤酒	8,005,868.00	2.44
50	600011	华能国际	7,982,510.00	2.43
51	000001	平安银行	7,923,302.00	2.41

52	601857	中国石油	7,890,512.00	2.40
53	688349	三一重能	7,794,406.00	2.37
54	002156	通富微电	7,728,860.00	2.35
55	601668	中国建筑	7,709,967.00	2.35
56	000002	万 科 A	7,656,051.00	2.33
57	600383	金地集团	7,493,260.00	2.28
58	600325	华发股份	7,487,231.00	2.28
59	002142	宁波银行	7,422,489.00	2.26
60	300763	锦浪科技	7,346,115.00	2.24
61	300033	同花顺	7,339,884.00	2.24
62	603989	艾华集团	7,008,691.50	2.13
63	600908	无锡银行	6,959,430.00	2.12
64	600893	航发动力	6,845,995.96	2.08
65	600111	北方稀土	6,799,838.00	2.07
66	000932	华菱钢铁	6,741,488.00	2.05

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	601985	中国核电	26,201,315.00	7.98
2	601816	京沪高铁	25,918,394.00	7.89
3	000725	京东方 A	20,760,821.00	6.32
4	002156	通富微电	20,184,705.00	6.15
5	000921	海信家电	17,479,959.00	5.32
6	688036	传音控股	17,083,615.49	5.20
7	600104	上汽集团	16,123,437.00	4.91
8	688169	石头科技	15,822,490.36	4.82
9	600585	海螺水泥	14,492,271.00	4.41
10	002223	鱼跃医疗	14,315,381.00	4.36
11	002415	海康威视	14,314,692.88	4.36
12	600941	中国移动	13,850,677.01	4.22
13	688981	中芯国际	13,823,188.26	4.21
14	600406	国电南瑞	13,733,825.80	4.18
15	600938	中国海油	13,498,133.00	4.11
16	000858	五 粮 液	13,361,708.88	4.07
17	688200	华峰测控	13,326,022.82	4.06
18	000528	柳 工	12,904,516.00	3.93
19	601939	建设银行	12,840,247.55	3.91
20	000672	上峰水泥	12,816,920.00	3.90
21	002475	立讯精密	12,694,138.00	3.87
22	000401	冀东水泥	12,160,593.00	3.70
23	003816	中国广核	12,156,310.00	3.70
24	301363	美好医疗	11,887,946.00	3.62
25	000568	泸州老窖	11,773,788.00	3.59

26	002236	大华股份	11,627,253.00	3.54
27	600801	华新水泥	11,540,916.35	3.51
28	688187	时代电气	11,327,890.24	3.45
29	688172	燕东微	11,147,579.09	3.40
30	601111	中国国航	11,132,594.00	3.39
31	601398	工商银行	10,481,453.00	3.19
32	600016	民生银行	10,457,568.00	3.18
33	600600	青岛啤酒	10,253,570.00	3.12
34	600584	长电科技	9,611,068.00	2.93
35	600019	宝钢股份	9,241,789.00	2.81
36	601618	中国中冶	9,081,452.00	2.77
37	001979	招商蛇口	8,995,292.00	2.74
38	002487	大金重工	8,983,052.64	2.74
39	002008	大族激光	8,978,270.00	2.73
40	601328	交通银行	8,955,027.00	2.73
41	600519	贵州茅台	8,885,097.00	2.71
42	600690	海尔智家	8,767,641.95	2.67
43	002965	祥鑫科技	8,553,096.00	2.60
44	300274	阳光电源	8,456,022.80	2.58
45	600048	保利发展	8,388,031.00	2.55
46	600845	宝信软件	8,286,474.20	2.52
47	600507	方大特钢	8,088,977.00	2.46
48	688449	联芸科技	8,073,825.72	2.46
49	600132	重庆啤酒	8,003,838.40	2.44
50	688484	南芯科技	7,930,831.48	2.42
51	600011	华能国际	7,921,044.00	2.41
52	000596	古井贡酒	7,836,569.00	2.39
53	601857	中国石油	7,799,668.00	2.38
54	600760	中航沈飞	7,706,625.00	2.35
55	601668	中国建筑	7,669,171.00	2.34
56	601766	中国中车	7,595,309.00	2.31
57	600050	中国联通	7,563,966.00	2.30
58	300443	金雷股份	7,487,003.00	2.28
59	600060	海信视像	7,385,018.00	2.25
60	000002	万科 A	7,247,714.00	2.21
61	600325	华发股份	7,043,663.00	2.15
62	300763	锦浪科技	7,035,043.00	2.14
63	603218	日月股份	6,985,465.00	2.13
64	000063	中兴通讯	6,945,381.00	2.12
65	601169	北京银行	6,891,947.00	2.10
66	603986	兆易创新	6,813,112.00	2.07
67	601088	中国神华	6,805,835.00	2.07
68	000333	美的集团	6,802,985.00	2.07

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	1,389,223,942.04
卖出股票收入（成交）总额	1,398,431,085.79

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

1、中国人寿

根据 2025 年 6 月 13 日中国人民银行银罚决字(2025)7 号，中国人寿保险股份有限公司因违反审慎经营原则、未按规定提交材料违反反洗钱管理规定等原因，被中国人民银行处罚，处罚金额 752.00 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，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	173,762.51
2	应收清算款	192,181.28
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,773.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	367,717.44

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
23,124	19,922.52	17,696,468.02	3.84	442,991,803.73	96.16

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	康婧	3,387,868.00	8.32
2	黄晓峰	709,737.00	1.74
3	方涛	691,838.00	1.70

4	高兆明	577,298.00	1.42
5	陈克明	387,000.00	0.95
6	高德荣	375,500.00	0.92
7	李广华	270,191.00	0.66
8	李萍	244,469.00	0.60
9	王远芳	233,303.00	0.57
10	任结云	200,036.00	0.49

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	128.64	0.0000

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 1 月 5 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	474,331,878.24
本报告期基金总申购份额	2,012,781.24
减：本报告期基金总赎回份额	15,656,387.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	460,688,271.75

§ 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
本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况
本报告期内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

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。
上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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 (%)	
国联民生证券	1	552,302,206.16	19.82	246,272.59	19.82	—
国投证券	2	417,167,586.09	14.97	186,011.35	14.97	—
华源证券	1	355,760,647.96	12.77	158,635.87	12.77	—
兴业证券	1	310,781,640.82	11.15	138,577.52	11.15	—
中金公司	1	309,655,954.16	11.11	138,074.86	11.11	—
中信证券	1	282,534,219.48	10.14	125,979.50	10.14	—
方正证券	1	252,933,872.70	9.08	112,786.22	9.08	—
国海证券	1	205,415,367.35	7.37	91,596.36	7.37	—
中信建投	1	50,164,265.62	1.80	22,368.77	1.80	—
华安证券	1	49,898,628.00	1.79	22,249.94	1.79	—
财通证券	2	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
德邦证券	1	—	—	—	—	—

东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准

- （1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。
- （2）具有较强的研究服务能力、有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。
- （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

- （1）基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- （1）报告期内，本基金新增租用：无。
- （2）报告期内，本基金停止租用：东兴证券 1 个交易单元。

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旗下基金 2024 年第 4 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 1 月 22 日
2	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2024 年第 4 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 1 月 22 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行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 3 月 3 日

4	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
5	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
6	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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
7	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

§ 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、长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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的办公地址和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/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