

长江收益增强债券型证券投资基金

2025 年第四季度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 01 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年01月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年10月01日起至2025年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长江收益增强债券 |
| 基金主代码 | 003336 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 10 月 17 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 124,792,489.34 份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于固定收益类金融工具，适度参与权益类品种投资，在追求本金安全和保持资产流动性的基础上，力争实现资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于固定收益类金融工具，在充分考虑基金资产的安全性基础上，把握相对确定的股票投资机会，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。 |
| 基金管理人 | 长江证券（上海）资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2025 年 10 月 01 日-2025 年 12 月 31 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | 1, 575, 011. 13 |
| 2. 本期利润 | -33, 395. 68 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0. 0003 |
| 4. 期末基金资产净值 | 172, 961, 210. 78 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 3860 |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 0. 01% | 0. 24% | 0. 49% | 0. 10% | -0. 48% | 0. 14% |
| 过去六个月 | 6. 42% | 0. 27% | 1. 32% | 0. 10% | 5. 10% | 0. 17% |
| 过去一年 | 7. 43% | 0. 32% | 2. 34% | 0. 10% | 5. 09% | 0. 22% |
| 过去三年 | 12. 60% | 0. 30% | 14. 53% | 0. 11% | -1. 93% | 0. 19% |
| 过去五年 | 15. 90% | 0. 30% | 20. 11% | 0. 12% | -4. 21% | 0. 18% |
| 自基金合同生效起至今 | 45. 08% | 0. 29% | 43. 26% | 0. 12% | 1. 82% | 0. 17% |

注：（1）本基金的业绩比较基准为中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%；（2）本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 17 日。

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

长江收益增强债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年10月17日-2025年12月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 漆志伟 | 基金经理 | 2016-10-17 | - | 16年 | 国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任东兴证券股份有限公司客服经理、华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理。截至本报告期末任长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江 90 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---------------------|
| | | | | | 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------|

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

（1）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

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

（2）扩展时间窗口下的价差分析

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

（3）基金或组合间模拟溢价金额分析

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年四季度，中国债券市场经历了从剧烈波动到逐步企稳的转变过程，最终在多重因素影响下确立了新的弱势均衡。宏观基本面延续“弱复苏”态势，经济整体运行平稳。通胀方面，CPI 小幅转正，PPI 降幅收窄，物价回升节奏温和，未对债市形成显著压力。央行货币政策延续“适度宽松”基调，但操作风格更加精细化和稳健。四季度央行通过连续加量 MLF 操作、重启国债买卖及买断式逆回购等工具组合，累计投放中期流动性，保持银行体系流动性合理充裕，支持政府债券发行和实体融资需求。资金面整体维持宽松但结构有所分化，短端利率与政策利率利差稳定。具体到资产表现，四季度 10 年期国债收益率在 1.79-1.88% 区间确立弱势均衡。短端利率维持低位稳定，长端利率波动相对较大，10 年期与 1 年期国债利差从季初的约 30BP 扩大至年末的 50BP，30 年期与 10 年期利差从 20BP 升至 42BP，收益率曲线呈现显著陡峭化趋势。

总体来看，2025 年四季度债券市场在“弱现实”与“政策预期”的博弈中震荡前行，最终在央行机制性创新工具支持下形成弱势均衡。期限利差的扩大既反映了市场对经济长期动能修复的谨慎乐观，也体现了对短期流动性宽松的确定性预期。在这一背景下，10 年以内品种因估值优势和政策支持成为四季度核心配置方向，而超长期品种则因供给压力和通胀预期升温承压出现调整。

报告期内，本基金在债券部分保持了一定久期，主要是考虑到利差水平处于近两年的高位，曲线陡峭化加剧，同时也对持有的券种做了相应调整，增持了信用债；在股票部分，进一步加大弹性品种的配置力度，在通信电子等板块加强了布局，同时也密切关注一些处于业绩底部区域的行业；转债方面，按照估值对组合进行了再调整，主要配置低溢价的中性品种，将博取进攻弹性的主要仓位让渡给了股票。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.3860 元。本报告期内，基金份额净值增长率为 0.01%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 29,302,549.38 | 16.07 |
| | 其中：股票 | 29,302,549.38 | 16.07 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 146,729,892.05 | 80.46 |
| | 其中：债券 | 146,729,892.05 | 80.46 |
| | 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 | 2,999,345.75 | 1.64 |
| | 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 | 2,473,700.10 | 1.36 |
| 8 | 其他资产 | 848,306.11 | 0.47 |
| 9 | 合计 | 182,353,793.39 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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 | 1,139,000.00 | 0.66 |
| C | 制造业 | 21,541,394.38 | 12.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — |
| E | 建筑业 | 497,500.00 | 0.29 |
| F | 批发和零售业 | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,527,300.00 | 0.88 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,437,285.00 | 0.83 |
| J | 金融业 | 1,325,550.00 | 0.77 |
| K | 房地产业 | 279,000.00 | 0.16 |
| L | 租赁和商务服务业 | 319,000.00 | 0.18 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 271,920.00 | 0.16 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 361,200.00 | 0.21 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 329,400.00 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 274,000.00 | 0.16 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 29,302,549.38 | 16.94 |

5.2.2 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股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 300308 | 中际旭创 | 1,000 | 610,000.00 | 0.35 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 10,000 | 567,100.00 | 0.33 |
| 3 | 002353 | 杰瑞股份 | 8,000 | 566,640.00 | 0.33 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 8,000 | 547,200.00 | 0.32 |
| 5 | 600039 | 四川路桥 | 50,000 | 497,500.00 | 0.29 |
| 6 | 300855 | 图南股份 | 15,000 | 484,500.00 | 0.28 |
| 7 | 603799 | 华友钴业 | 7,004 | 478,093.04 | 0.28 |
| 8 | 600489 | 中金黄金 | 20,000 | 467,200.00 | 0.27 |
| 9 | 688111 | 金山办公 | 1,500 | 460,605.00 | 0.27 |
| 10 | 600309 | 万华化学 | 6,000 | 460,080.00 | 0.27 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 1 | 国家债券 | 22,177,614.48 | 12.82 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 53,132,638.47 | 30.72 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,123,178.08 | 5.85 |
| 4 | 企业债券 | 15,158,020.54 | 8.76 |
| 5 | 企业短期融资券 | 5,036,360.27 | 2.91 |
| 6 | 中期票据 | 29,337,512.60 | 16.96 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 21,887,745.69 | 12.65 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 146,729,892.05 | 84.83 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 230023 | 23 付息国债 23 | 100,000 | 11,445,285.71 | 6.62 |
| 2 | 230006 | 23 付息国债 06 | 100,000 | 10,732,328.77 | 6.21 |
| 3 | 250304 | 25 进出 04 | 100,000 | 10,123,178.08 | 5.85 |
| 4 | 102480793 | 24 襄阳高新 MTN001 | 50,000 | 5,177,507.67 | 2.99 |
| 5 | 102100040 | 21 荆门城投 MTN001 | 50,000 | 5,169,841.10 | 2.99 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同约定，本基金不得参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本着审慎性原则、在风险可控的前提下，以套期保值策略为目的，适度参与国债期货的投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一中国进出口银行在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局处以罚款。

本基金管理人对上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.11.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 9,321.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 838,984.61 |

| | | |
|---|-------|------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 848,306.11 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|------------|------------------|
| 1 | 113042 | 上银转债 | 635,279.45 | 0.37 |
| 2 | 113056 | 重银转债 | 632,840.96 | 0.37 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 603,676.03 | 0.35 |
| 4 | 127049 | 希望转 2 | 589,702.05 | 0.34 |
| 5 | 127089 | 晶澳转债 | 507,678.47 | 0.29 |
| 6 | 113051 | 节能转债 | 483,661.48 | 0.28 |
| 7 | 123107 | 温氏转债 | 389,210.30 | 0.23 |
| 8 | 113605 | 大参转债 | 375,273.70 | 0.22 |
| 9 | 118034 | 晶能转债 | 360,049.97 | 0.21 |
| 10 | 127027 | 能化转债 | 340,369.32 | 0.20 |
| 11 | 113563 | 柳药转债 | 323,682.74 | 0.19 |
| 12 | 113632 | 鹤 21 转债 | 287,395.07 | 0.17 |
| 13 | 113623 | 凤 21 转债 | 282,494.63 | 0.16 |
| 14 | 110075 | 南航转债 | 275,083.84 | 0.16 |
| 15 | 127050 | 麒麟转债 | 274,762.41 | 0.16 |
| 16 | 127040 | 国泰转债 | 274,604.49 | 0.16 |
| 17 | 127045 | 牧原转债 | 272,047.40 | 0.16 |
| 18 | 113631 | 皖天转债 | 271,186.08 | 0.16 |
| 19 | 127026 | 超声转债 | 268,870.41 | 0.16 |
| 20 | 111000 | 起帆转债 | 268,326.30 | 0.16 |
| 21 | 113043 | 财通转债 | 268,201.10 | 0.16 |
| 22 | 113691 | 和邦转债 | 267,842.47 | 0.15 |
| 23 | 110093 | 神马转债 | 267,480.49 | 0.15 |
| 24 | 113053 | 隆 22 转债 | 266,098.96 | 0.15 |
| 25 | 110098 | 南药转债 | 266,092.27 | 0.15 |
| 26 | 113656 | 嘉诚转债 | 263,062.19 | 0.15 |
| 27 | 127022 | 恒逸转债 | 261,415.07 | 0.15 |
| 28 | 128141 | 旺能转债 | 260,351.51 | 0.15 |
| 29 | 113661 | 福 22 转债 | 260,263.01 | 0.15 |
| 30 | 118024 | 冠宇转债 | 260,213.70 | 0.15 |
| 31 | 113655 | 欧 22 转债 | 259,699.73 | 0.15 |
| 32 | 123119 | 康泰转 2 | 256,241.37 | 0.15 |
| 33 | 111017 | 蓝天转债 | 254,389.32 | 0.15 |
| 34 | 113067 | 燃 23 转债 | 253,234.08 | 0.15 |
| 35 | 113070 | 渝水转债 | 252,492.99 | 0.15 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 36 | 110084 | 贵燃转债 | 250,279.45 | 0.14 |
| 37 | 123216 | 科顺转债 | 249,977.53 | 0.14 |
| 38 | 110067 | 华安转债 | 249,006.30 | 0.14 |
| 39 | 127041 | 弘亚转债 | 247,935.89 | 0.14 |
| 40 | 127102 | 浙建转债 | 245,998.41 | 0.14 |
| 41 | 127030 | 盛虹转债 | 245,788.77 | 0.14 |
| 42 | 127083 | 山路转债 | 244,884.33 | 0.14 |
| 43 | 127056 | 中特转债 | 242,506.58 | 0.14 |
| 44 | 127018 | 本钢转债 | 242,116.71 | 0.14 |
| 45 | 118022 | 锂科转债 | 240,739.18 | 0.14 |
| 46 | 127103 | 东南转债 | 240,655.62 | 0.14 |
| 47 | 113633 | 科沃转债 | 239,252.49 | 0.14 |
| 48 | 113627 | 太平转债 | 238,461.37 | 0.14 |
| 49 | 127085 | 韵达转债 | 238,396.99 | 0.14 |
| 50 | 128121 | 宏川转债 | 235,992.88 | 0.14 |
| 51 | 113033 | 利群转债 | 226,230.96 | 0.13 |
| 52 | 127016 | 鲁泰转债 | 222,020.82 | 0.13 |
| 53 | 110073 | 国投转债 | 220,171.51 | 0.13 |
| 54 | 127025 | 冀东转债 | 211,259.73 | 0.12 |
| 55 | 113045 | 环旭转债 | 161,735.40 | 0.09 |
| 56 | 127082 | 亚科转债 | 157,853.15 | 0.09 |
| 57 | 123146 | 中环转 2 | 147,701.64 | 0.09 |
| 58 | 113058 | 友发转债 | 147,250.68 | 0.09 |
| 59 | 123158 | 宙邦转债 | 146,318.90 | 0.08 |
| 60 | 127095 | 广泰转债 | 141,861.51 | 0.08 |
| 61 | 113653 | 永 22 转债 | 140,196.16 | 0.08 |
| 62 | 113649 | 丰山转债 | 138,848.08 | 0.08 |
| 63 | 127039 | 北港转债 | 138,803.81 | 0.08 |
| 64 | 111019 | 宏柏转债 | 137,127.07 | 0.08 |
| 65 | 113640 | 苏利转债 | 137,058.77 | 0.08 |
| 66 | 118038 | 金宏转债 | 136,438.22 | 0.08 |
| 67 | 127028 | 英特转债 | 136,204.22 | 0.08 |
| 68 | 123178 | 花园转债 | 135,799.73 | 0.08 |
| 69 | 123133 | 佩蒂转债 | 134,423.84 | 0.08 |
| 70 | 111010 | 立昂转债 | 133,937.81 | 0.08 |
| 71 | 111002 | 特纸转债 | 133,084.68 | 0.08 |
| 72 | 113658 | 密卫转债 | 132,541.78 | 0.08 |
| 73 | 128116 | 瑞达转债 | 132,525.34 | 0.08 |
| 74 | 123172 | 漱玉转债 | 131,095.89 | 0.08 |
| 75 | 113688 | 国检转债 | 130,336.63 | 0.08 |
| 76 | 127031 | 洋丰转债 | 129,032.55 | 0.07 |
| 77 | 123091 | 长海转债 | 127,499.45 | 0.07 |
| 78 | 110087 | 天业转债 | 127,091.23 | 0.07 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 79 | 110086 | 精工转债 | 125,985.07 | 0.07 |
| 80 | 118042 | 奥维转债 | 125,262.49 | 0.07 |
| 81 | 113693 | 志邦转债 | 125,050.03 | 0.07 |
| 82 | 113682 | 益丰转债 | 124,802.05 | 0.07 |
| 83 | 113666 | 爱玛转债 | 124,793.84 | 0.07 |
| 84 | 110070 | 凌钢转债 | 123,808.16 | 0.07 |
| 85 | 127024 | 盈峰转债 | 122,844.25 | 0.07 |
| 86 | 123064 | 万孚转债 | 122,774.79 | 0.07 |
| 87 | 127108 | 太能转债 | 122,292.30 | 0.07 |
| 88 | 113048 | 晶科转债 | 120,558.14 | 0.07 |
| 89 | 113059 | 福莱转债 | 120,443.01 | 0.07 |
| 90 | 111009 | 盛泰转债 | 120,110.82 | 0.07 |
| 91 | 113647 | 禾丰转债 | 120,005.07 | 0.07 |
| 92 | 110085 | 通 22 转债 | 119,702.47 | 0.07 |
| 93 | 123117 | 健帆转债 | 118,657.48 | 0.07 |
| 94 | 113584 | 家悦转债 | 117,930.55 | 0.07 |
| 95 | 128134 | 鸿路转债 | 116,488.22 | 0.07 |
| 96 | 128135 | 洽洽转债 | 116,130.00 | 0.07 |
| 97 | 127017 | 万青转债 | 112,848.71 | 0.07 |
| 98 | 123108 | 乐普转 2 | 107,542.82 | 0.06 |

5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 109,217,628.32 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 47,250,985.01 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 31,676,123.99 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 124,792,489.34 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予长江收益增强债券型证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江收益增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、长江收益增强债券型证券投资基金招募说明书
- 4、长江收益增强债券型证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

8.2 存放地点

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

8.3 查阅方式

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

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇二六年一月二十二日