

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金  
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：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。

报告期内，本基金自 2025 年 1 月 24 日起调低基金费率，管理费由 1.8%/年调整为 1.2%/年，托管费率由 0.3%/年调整为 0.2%/年，详情参阅《关于长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金调低基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

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                         | 5         |
| 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人                      | 6         |
| 2.5 信息披露方式                              | 6         |
| 2.6 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>8</b>  |
| 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              | 9         |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布              | 34        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合                      | 34        |
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细       | 35        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                   | 39        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 41        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....    | 41        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... | 41        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 ..... | 41        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....   | 41        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 42        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 43        |
| 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 .....      | 43        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>43</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 43        |
| 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 .....      | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 44        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 44        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 44        |
| 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 .....         | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 44        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 45        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>46</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 .....    | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 47        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 47        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 长盛环球行业混合 (QDII)       |
| 基金主代码      | 080006                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日    | 2010 年 5 月 26 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 | 28,786,151.11 份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                   |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                              |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势，精选景气投资行业，并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标；同时在投资国家或地区配置上，有效实现全球分散化投资，力争充分分散风险，追求基金资产的稳定增值。                                          |
| 投资策略   | 本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用 Black-Litterman 资产配置模型实现行业层面的风险最优配置，在行业内部，运用全球量化选股模型精选个股，投资管理人将两者进行有机结合，构建最优化的投资组合。                                |
| 业绩比较基准 | 摩根斯坦利世界大盘股指数（MSCI World Large Cap Index）                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，风险和收益低于股票型基金，高于货币基金和债券基金。同时，本基金为全球混合型证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外，由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的混合型基金。 |

### 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<br>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 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                           |
|------|----|-----------------------------------|
| 名称   | 英文 | BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED |
|      | 中文 | 中国银行（香港）有限公司                      |
| 注册地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                     |
| 办公地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                     |

## 2.5 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          | 基金管理人的办公地址和基金托管人住所                                                |

## 2.6 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) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -4,327,610.05                       |
| 本期利润          | -730,389.10                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0253                             |
| 本期加权平均净值利润率   | -2.29%                              |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.69%                              |
| 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      | 4,664,175.20                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1620                              |
| 期末基金资产净值      | 33,450,326.31                       |
| 期末基金份额净值      | 1.162                               |
| 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   | 21.79%                              |

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。

### 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      | 5.06%    | 0.67%       | 4.33%      | 0.62%         | 0.73%    | 0.05% |
| 过去三个月      | 9.83%    | 1.83%       | 11.14%     | 1.62%         | -1.31%   | 0.21% |
| 过去六个月      | -1.69%   | 1.51%       | 8.48%      | 1.32%         | -10.17%  | 0.19% |
| 过去一年       | 15.85%   | 1.56%       | 14.41%     | 1.08%         | 1.44%    | 0.48% |
| 过去三年       | -9.01%   | 1.84%       | 61.47%     | 0.93%         | -70.48%  | 0.91% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.79%   | 1.40%       | 294.51%    | 0.99%         | -272.72% | 0.41% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准 = 摩根斯坦利世界大盘股指数 (MSCI World Large Cap Index) × 100%

（以下简称 MSCI 世界指数）。

本基金为混合型基金，主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

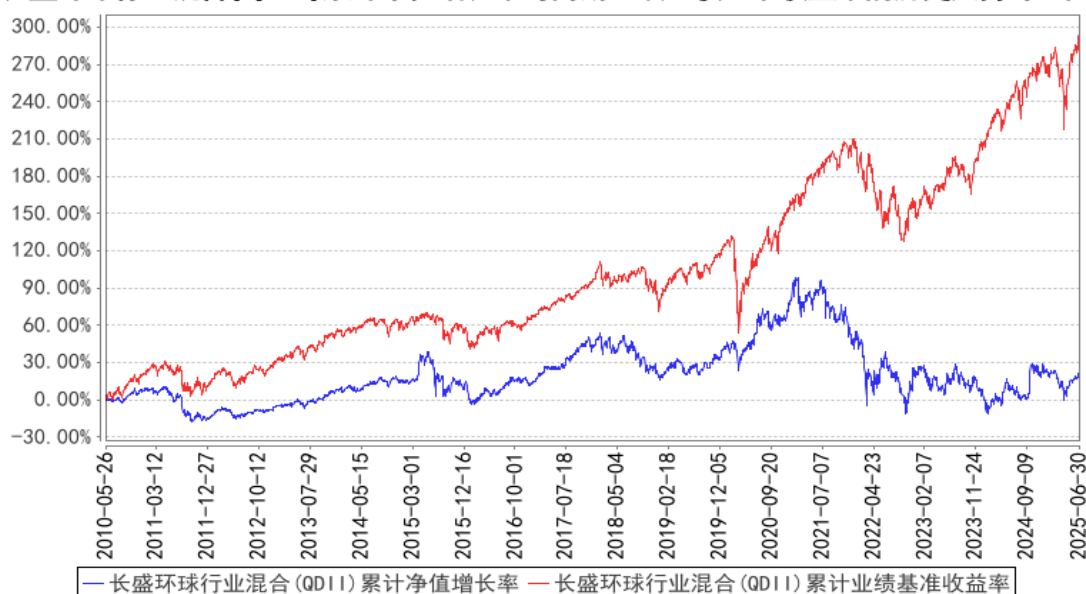
MSCI 世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一，并且由 MSCIBARRA 每日在市场发布。

MSCI 世界指数样本覆盖了与证监会已经签订合作谅解备忘录的主要国家，并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

本基金的股票资产占基金资产的 60%–95%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为 85%，所以，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

### 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

长盛环球行业混合(QDII)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：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。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，长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理，量化投资部总经理助理。 | 2021 年 9 月 23 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

在报告期内，MSCI 发达市场指数早期呈现区间震荡有所回落的走势，MSCI 新兴市场指数走势相对略强，但在一季度末也随美国市场同步走弱。其后两者在经历了二季度初期的关税冲击后迅速修复并连续温和上涨。除了在受到冲击的初期由于流动性弹性的不同，两者的走势有显著差异外，其后相对强弱逐步平衡，暗示着宏观的流动性和情绪的修复对全球股市有着全局性的影响。美国方面，一季度初受到中国 DeepSeek 技术突破的冲击，美股 AI 相关的行业的护城河优势打破以及估值空间被大幅压缩。但其后美股的大型科技龙头公司保持了较高的 AI 业务相关的资本开支和并购活动计划，逐步回到原有的商业节奏，即在更高效的模型框架支持下加大算力投入来进一步尝试突破人工智能的能力上限；在此期间，纳斯达克的 TMT 板块重新领涨其他行业。年初随着美国新一届政府上台，其削减政府开支的政策对美国经济产生了较强的收缩效应的快速冲击。但二季度酝酿的“大而美”法案或将重新打开财政赤字的上限，使得美国的宏观债务率的预期变动左右摇摆。此外美国关税政策看似“极限施压”，但对美国经济和社会本身又形成负反馈，使得美国

政府不得不调整其力度和节奏，全球市场对此开始逐渐脱敏。

报告期内本基金整体结构上重点配置美股大盘蓝筹公司，在市场震荡盘整中对美股 AI 相关龙头进行了减配至均衡水平，并根据美国的关税和财政政策动态调整在美国上市的与全球供应链和关税低相关的本地型消费类公司与美国本土化联系较重的金融机构的权重。此外我们通过 ETF 等工具动态对冲了基金的部分仓位，对高波动的风格进行了敞口的控制。

#### 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 1.162 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.69%，同期业绩比较基准收益率为 8.48%。

#### 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，随着“大而美”法案的推出，美国依然在利用其财政扩表的潜力和美元的国际信用尚未到达边界来支撑其经济增长。如果其国内的科技产业未能及时有效打开新的上行康波周期，包括带动芯片、电力等实体投资的扩张，那么其后续经济和金融市场的波动难以保持目前的低位水平。反之则这一新法案可能是一次值得尝试的宏观政策冒险，即通过推高增长预期和扩大税基来降低美国的总体债务比率。此外，美国政府似乎尝试利用关税收入来部分弥补其财政收入缺口，但由于关税的政策路径十分不明确，其对经济的冲击加剧了研判难度。美联储承认经济不确定性“有所缓和但仍处高位”，凸显政策僵局——既需防范通胀复燃，又面临增长动能衰减的压力；除非未来数月数据明确指向通胀趋缓或衰退风险飙升，否则利率高位盘踞将成新常态。另一方面，中国提出“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。而美国方面需要在明年的中期选举前维护其经济软着陆预期；双方可能在未来的中期窗口形成战略缓冲期，以调整各自的内部结构为优先。如此一来，美元资金可能更倾向于在本土为美债的进一步扩张提供流动性支持，而美股短期面临一定的资金供给不足的压力，但其后可能伴随着资金回流而修复。只要其科技产业的技术优势、利润增速和资本开支的循环尚未被打破，那么美股科技龙头的趋势或许仍将持续。我们将密切关注中国的科技突破进展和内需政策对于美国例外论的挑战，以及相应的国际美元资金的国别配置再平衡的动向。

#### 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

本基金自 2019 年 3 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。自 2024 年 6 月 14 日起，由本基金管理人承担本基金的固定费用。

## § 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”）在长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金（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的真实、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：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

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 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 2,990,020.94           | 9,127,094.28             |
| 结算备付金    |         | -                      | -                        |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 30,599,193.84          | 12,119,283.65            |
| 其中：股票投资  |         | 28,907,591.46          | 12,119,283.65            |
| 基金投资     |         | 1,691,602.38           | -                        |
| 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     |         | 12,562.41              | 38,921.55                |
| 应收申购款    |         | 46,238.59              | 18,172,017.87            |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计     |         | 33,648,015.78          | 39,457,317.35            |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
| 负 债：     |         |                        |                          |
| 短期借款     |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债  |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |

|           |          |               |               |
|-----------|----------|---------------|---------------|
| 卖出回购金融资产款 |          | -             | -             |
| 应付清算款     |          | -             | -             |
| 应付赎回款     |          | 159,523.22    | 23,462.57     |
| 应付管理人报酬   |          | 32,223.56     | 21,979.01     |
| 应付托管费     |          | 5,370.58      | 3,663.19      |
| 应付销售服务费   |          | -             | -             |
| 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  | 572.11        | 5,079.93      |
| 负债合计      |          | 197,689.47    | 54,184.70     |
| 净资产：      |          |               |               |
| 实收基金      | 6.4.7.10 | 28,786,151.11 | 33,348,407.33 |
| 其他综合收益    | 6.4.7.11 | -             | -             |
| 未分配利润     | 6.4.7.12 | 4,664,175.20  | 6,054,725.32  |
| 净资产合计     |          | 33,450,326.31 | 39,403,132.65 |
| 负债和净资产总计  |          | 33,648,015.78 | 39,457,317.35 |

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.162 元，基金份额总额 28,786,151.11 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

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<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入           |          | -488,520.55                              | -1,067,752.74                                 |
| 1. 利息收入           |          | 2,748.51                                 | 2,598.14                                      |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 2,748.51                                 | 2,598.14                                      |
| 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） |          | -3,833,175.58                            | -2,704,771.04                                 |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -3,794,170.16                            | -2,774,087.87                                 |
| 基金投资收益            | 6.4.7.15 | -163,709.28                              | -                                             |
| 债券投资收益            | 6.4.7.16 | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券投资<br>收益    | 6.4.7.17 | -                                        | -                                             |

|                            |            |              |               |
|----------------------------|------------|--------------|---------------|
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.18   | -            | -             |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.19   | -            | -             |
| 股利收益                       | 6.4.7.20   | 124,703.86   | 69,316.83     |
| 其他投资收益                     |            | -            | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.21   | 3,597,220.95 | 1,579,795.82  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -273,277.16  | 50,322.47     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.22   | 17,962.73    | 4,301.87      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 241,868.55   | 155,613.44    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 203,776.86   | 115,409.97    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 33,962.78    | 19,235.00     |
| 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                  | 6.4.7.23   | -            | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | -            | -             |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.24   | 4,128.91     | 20,968.47     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -730,389.10  | -1,223,366.18 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -730,389.10  | -1,223,366.18 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -730,389.10  | -1,223,366.18 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

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                | 33,348,407.33                         | 6,054,725.32  | 39,403,132.65 |
| 二、本期期初净资产                | 33,348,407.33                         | 6,054,725.32  | 39,403,132.65 |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列） | -4,562,256.22                         | -1,390,550.12 | -5,952,806.34 |

|                                          |                                            |               |                |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|---------------|----------------|
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -730,389.10   | -730,389.10    |
| (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)  | -4,562,256.22                              | -660,161.02   | -5,222,417.24  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 6,407,884.75                               | 717,617.04    | 7,125,501.79   |
| 2. 基金赎回款                                 | -10,970,140.97                             | -1,377,778.06 | -12,347,919.03 |
| (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                                | 28,786,151.11                              | 4,664,175.20  | 33,450,326.31  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 17,043,584.73                              | 561,499.78    | 17,605,084.51  |
| 二、本期期初净资产                                | 17,043,584.73                              | 561,499.78    | 17,605,084.51  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | -4,917,930.61                              | -520,144.95   | -5,438,075.56  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -1,223,366.18 | -1,223,366.18  |
| (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)  | -4,917,930.61                              | 703,221.23    | -4,214,709.38  |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 3,306,474.31                               | 28,934.07     | 3,335,408.38   |
| 2. 基金赎回款                                 | -8,224,404.92                              | 674,287.16    | -7,550,117.76  |
| (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                                | 12,125,654.12                              | 41,354.83     | 12,167,008.95  |

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

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金(原名为长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2009]第 1501 号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 339,898,507.52 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 122 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》于 2010 年 5 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 340,041,384.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 142,877.11 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 16 日公告后更名为长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为 60%-95%,其中投资于业绩比较基准内 23 个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的 80%;投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于本报告期末,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有

关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他境内外相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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           | 2,990,020.94           |
| 等于：本金          | 2,989,859.09           |
| 加：应计利息         | 161.85                 |
| 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             | 2,990,020.94           |

## 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            |       | 29,337,192.74          | -    | 28,907,591.46 | -429,601.28 |
| 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            |       | 1,600,712.56           | -    | 1,691,602.38  | 90,889.82   |
| 其他            |       | -                      | -    | -             | -           |
| 合计            |       | 30,937,905.30          | -    | 30,599,193.84 | -338,711.46 |

## 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。

## 6.4.7.6.1 其他权益工具投资

无。

## 6.4.7.7 其他资产

无。

## 6.4.7.8 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       | 572.11                 |
| 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 | -      |
| 合计   | 572.11 |

#### 6.4.7.9 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          | 33,348,407.33                   | 33,348,407.33  |
| 本期申购          | 6,407,884.75                    | 6,407,884.75   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,970,140.97                  | -10,970,140.97 |
| 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           | 28,786,151.11                   | 28,786,151.11  |

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。

#### 6.4.7.10 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

| 目              | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 上年度末           | 17,423,483.44 | -11,368,758.12 | 6,054,725.32  |
| 本期期初           | 17,423,483.44 | -11,368,758.12 | 6,054,725.32  |
| 本期利润           | -4,327,610.05 | 3,597,220.95   | -730,389.10   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,929,484.65 | 1,269,323.63   | -660,161.02   |
| 其中：基金申购款       | 2,796,625.86  | -2,079,008.82  | 717,617.04    |
| 金赎             | -4,726,110.51 | 3,348,332.45   | -1,377,778.06 |

|         |               |               |              |
|---------|---------------|---------------|--------------|
| 回款      |               |               |              |
| 本期已分配利润 | -             | -             | -            |
| 期末      | 11,166,388.74 | -6,502,213.54 | 4,664,175.20 |

#### 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,748.19                              |
| 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 | -                                     |
| 其他        | 0.32                                  |
| 合计        | 2,748.51                              |

#### 6.4.7.13 股票投资收益

##### 6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>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 | -3,794,170.16              |
| 合计               | -3,794,170.16              |

##### 6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 17,285,169.23                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 20,973,553.96                         |
| 减：交易费用     | 105,785.43                            |
| 买卖股票差价收入   | -3,794,170.16                         |

#### 6.4.7.14 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-------------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 1,265,965.13                          |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 1,427,040.54                          |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                                     |
| 减：交易费用            | 2,633.87                              |

|        |             |
|--------|-------------|
| 基金投资收益 | -163,709.28 |
|--------|-------------|

**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。

**6.4.7.17.1 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.18 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 121,452.93                            |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | 3,250.93                              |
| 合计            | 124,703.86                            |

**6.4.7.19 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 3,597,220.95                          |
| 股票投资                   | 3,506,331.13                          |
| 债券投资                   | -                                     |
| 资产支持证券投资               | -                                     |
| 基金投资                   | 90,889.82                             |
| 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                     | 3,597,220.95                          |

**6.4.7.20 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 17,962.73                             |
| 合计      | 17,962.73                             |

6.4.7.21 信用减值损失

无。

6.4.7.22 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    | —                                     |
| 信息披露费   | —                                     |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 银行费用    | 4,128.91                              |
| 合计      | 4,128.91                              |

6.4.7.23 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、注册登记机构、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        |

|                      |         |
|----------------------|---------|
| 中国银行(香港)有限公司(“中银香港”) | 境外资产托管人 |
|----------------------|---------|

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

无。

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 | 上年度可比期间<br>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   | 203,776.86                            | 115,409.97                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 69,060.09                             | 42,633.08                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 134,716.77                            | 72,776.89                                  |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金自 2025 年 1 月 24 日起年管理费率由 1.8%调整为 1.2%。详情参阅《关于长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金调低基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》。基金管理费计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$$

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 33,962.78                             | 19,235.00                                  |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金自 2025 年 1 月 24 日起年托管费率由 0.3%调整为 0.2%。详情参阅《关于长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金调低基金费率并修改基金合同等法律文件的公告》。基金托管费计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$$

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>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  | 1,598,413.50                          | 2,748.19 | 1,199,525.77                               | 2,597.66 |
| 中银香港  | 1,391,607.44                          | -        | 721,921.77                                 | -        |
| 合计    | 2,990,020.94                          | 2,748.19 | 1,921,447.54                               | 2,597.66 |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中，中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息，中银香港保管部分的资金不计息。

## 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

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

###### 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；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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。

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受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                   | 2,989,859.09 | -     | -     | 161.85        | 2,990,020.94  |
| 交易性金融资产                | -            | -     | -     | 30,599,193.84 | 30,599,193.84 |
| 应收股利                   | -            | -     | -     | 12,562.41     | 12,562.41     |
| 应收申购款                  | -            | -     | -     | 46,238.59     | 46,238.59     |
| 资产总计                   | 2,989,859.09 | -     | -     | 30,658,156.69 | 33,648,015.78 |
| 负债                     |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                  | -            | -     | -     | 159,523.22    | 159,523.22    |
| 应付管理人报酬                | -            | -     | -     | 32,223.56     | 32,223.56     |
| 应付托管费                  | -            | -     | -     | 5,370.58      | 5,370.58      |
| 其他负债                   | -            | -     | -     | 572.11        | 572.11        |
| 负债总计                   | -            | -     | -     | 197,689.47    | 197,689.47    |
| 利率敏感度缺口                | 2,989,859.09 | -     | -     | 30,460,467.22 | 33,450,326.31 |

| 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                     | 9,127,074.93 | -     | -     | 19.35         | 9,127,094.28  |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 12,119,283.65 | 12,119,283.65 |
| 应收股利                     | -            | -     | -     | 38,921.55     | 38,921.55     |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 18,172,017.87 | 18,172,017.87 |
| 资产总计                     | 9,127,074.93 | -     | -     | 30,330,242.42 | 39,457,317.35 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 23,462.57     | 23,462.57     |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 21,979.01     | 21,979.01     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 3,663.19      | 3,663.19      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 5,079.93      | 5,079.93      |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 54,184.70     | 54,184.70     |
| 利率敏感度缺口                  | 9,127,074.93 | -     | -     | 30,276,057.72 | 39,403,132.65 |

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |             |               |               |
|----------|------------------------|-------------|---------------|---------------|
|          | 美元<br>折合人民币            | 港币<br>折合人民币 | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产 |                        |             |               |               |
| 货币资金     | 1,391,060.51           | 625.41      | 4.70          | 1,391,690.62  |
| 交易性金融资产  | 30,597,278.74          | 1,915.10    | -             | 30,599,193.84 |

|               |                          |               |           |               |
|---------------|--------------------------|---------------|-----------|---------------|
| 应收股利          | 12,562.41                | -             | -         | 12,562.41     |
| 资产合计          | 32,000,901.66            | 2,540.51      | 4.70      | 32,003,446.87 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |           |               |
| 负债合计          | -                        | -             | -         | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 32,000,901.66            | 2,540.51      | 4.70      | 32,003,446.87 |
| 项目            | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |               |           |               |
|               | 美元折合人民币                  | 港币折合人民币       | 其他币种折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                          |               |           |               |
| 货币资金          | 8,277,045.80             | 763,079.47    | 4.27      | 9,040,129.54  |
| 交易性金融资产       | 542,642.11               | 11,576,641.54 | -         | 12,119,283.65 |
| 应收股利          | -                        | 38,921.55     | -         | 38,921.55     |
| 资产合计          | 8,819,687.91             | 12,378,642.56 | 4.27      | 21,198,334.74 |
| 以外币计价的负债      |                          |               |           |               |
| 负债合计          | -                        | -             | -         | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | 8,819,687.91             | 12,378,642.56 | 4.27      | 21,198,334.74 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                  |                             |                        |
|----|------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
| 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） |
|    | 所有外币相对人民         | 1,600,172.34                | 1,059,916.74           |

|  |                    |                  |                  |
|--|--------------------|------------------|------------------|
|  | 币升值 5%             |                  |                  |
|  | 所有外币相对人民<br>币贬值 5% | -1, 600, 172. 34 | -1, 059, 916. 74 |

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 | 28, 907, 591. 46       | 86. 42           | 12, 119, 283. 65    | 30. 76           |
| 交易性金融资产—基金投资 | 1, 691, 602. 38        | 5. 06            | —                   | —                |
| 合计           | 30, 599, 193. 84       | 91. 48           | 12, 119, 283. 65    | 30. 76           |

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%       | 1, 469, 422. 67             | 1, 314, 546. 87        |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | -1, 469, 422. 67            | -1, 314, 546. 87       |

## 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          | 30,597,278.74          | 12,117,338.97            |
| 第二层次          | —                      | —                        |
| 第三层次          | 1,915.10               | 1,944.68                 |
| 合计            | 30,599,193.84          | 12,119,283.65            |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

对于证券交易所上市的证券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据香港联合交易所有限公司于 2020 年 1 月 24 日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由 2020 年 1 月 30 日起，中国动物保健品有限公司(CHINA ANIMAL HEALTHCARE

LTD)的上市地位已被取消，本基金持有的该公司股权价值为 0.00 元。

根据香港联合交易所有限公司于 2022 年 9 月 7 日发布的《关于桑德国际有限公司取消上市地位》的通告，由 2022 年 9 月 13 日起，桑德国际有限公司(SOUND GLOBAL LTD.)的上市地位已被取消，本基金持有的该公司股权价值为 1,915.10 元。

## § 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              | 28,907,591.46 | 85.91         |
|    | 其中：普通股            | 27,610,510.41 | 82.06         |
|    | 存托凭证              | 1,297,081.05  | 3.85          |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托凭证           | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | 1,691,602.38  | 5.03          |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
|    | 其中：远期             | -             | -             |
|    | 期货                | -             | -             |
|    | 期权                | -             | -             |
|    | 权证                | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 2,990,020.94  | 8.89          |
| 8  | 其他各项资产            | 58,801.00     | 0.17          |
| 9  | 合计                | 33,648,015.78 | 100.00        |

### 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|--------|---------------|---------------|
| 美国     | 28,905,676.36 | 86.41         |
| 中国香港   | 1,915.10      | 0.01          |
| 合计     | 28,907,591.46 | 86.42         |

### 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|--------------|---------------|
| 通信服务 | 4,071,928.72 | 12.17         |

|          |               |       |
|----------|---------------|-------|
| 非日常生活消费品 | 4,181,265.74  | 12.50 |
| 日常消费品    | 1,897,668.48  | 5.67  |
| 能源       | 690,288.76    | 2.06  |
| 金融       | 3,981,455.55  | 11.90 |
| 医疗保健     | 2,378,885.89  | 7.11  |
| 工业       | 464,865.89    | 1.39  |
| 信息技术     | 10,874,660.40 | 32.51 |
| 材料       | 211,596.33    | 0.63  |
| 房地产      | -             | -     |
| 公用事业     | 154,975.70    | 0.46  |
| 合计       | 28,907,591.46 | 86.42 |

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)                   | 公司名称<br>(中文)  | 证券代<br>码 | 所在证<br>券市场      | 所属<br>国家<br>(地区) | 数量<br>(股) | 公允价值         | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
|----|--------------------------------|---------------|----------|-----------------|------------------|-----------|--------------|------------------------------|
| 1  | Microsoft Corp                 | 微软            | MSFT US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 753       | 2,681,251.70 | 8.02                         |
| 2  | Apple Inc                      | 苹果公司          | AAPL US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 1,500     | 2,203,094.94 | 6.59                         |
| 3  | Amazon.com Inc                 | 亚马逊公司         | AMZN US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 1,254     | 1,969,438.67 | 5.89                         |
| 4  | Alphabet Inc                   | Alphabet 公司   | GOOG US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 666       | 845,729.46   | 2.53                         |
|    |                                |               | GOOGL US | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 776       | 978,970.62   | 2.93                         |
| 5  | Meta Platforms Inc             | Meta 平台股份有限公司 | META US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 291       | 1,537,554.10 | 4.60                         |
| 6  | NVIDIA Corp                    | 英伟达           | NVDA US  | 纳斯达克证<br>券交易所   | 美国               | 1,318     | 1,490,641.15 | 4.46                         |
| 7  | Taiwan Semiconductor Manufactu | 台湾积体电路制造股份有限  | TSM US   | 纽约证<br>券交易<br>所 | 美国               | 800       | 1,297,081.05 | 3.88                         |

|    |                              |                   |             |                   |    |       |              |      |
|----|------------------------------|-------------------|-------------|-------------------|----|-------|--------------|------|
|    | ring<br>Company<br>Ltd.      | 公司                |             |                   |    |       |              |      |
| 8  | Broadcom<br>Inc              | 博通股份<br>有限公司      | AVGO US     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 588   | 1,160,281.64 | 3.47 |
| 9  | Tesla In<br>c                | 特斯拉<br>公司         | TSLA US     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 381   | 866,394.33   | 2.59 |
| 10 | Citigroup<br>Inc             | 花旗集<br>团          | C US        | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 1,292 | 787,267.32   | 2.35 |
| 11 | JPMorgan<br>Chase & Co       | 摩根大<br>通          | JPM US      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 378   | 784,482.20   | 2.35 |
| 12 | Berkshire<br>Hathaway<br>Inc | 伯克希<br>尔哈撒<br>韦公司 | BRK_B<br>US | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 175   | 608,550.80   | 1.82 |
| 13 | Eli Lilly<br>& Co            | 礼来                | LLY US      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 107   | 597,096.75   | 1.79 |
| 14 | Visa Inc                     | 维萨公<br>司          | V US        | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 221   | 561,707.07   | 1.68 |
| 15 | Netflix,<br>Inc              | 奈飞公<br>司          | NFLX US     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 56    | 536,832.58   | 1.60 |
| 16 | Carnival<br>Corp             | 嘉年华<br>公司         | CCL US      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 2,327 | 468,424.71   | 1.40 |
| 17 | Exxon<br>Mobil<br>Corp       | 埃克森<br>美孚公<br>司   | XOM US      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 589   | 454,529.58   | 1.36 |
| 18 | Mastercar<br>d Inc           | 万事达<br>卡公司        | MA US       | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 109   | 438,474.70   | 1.31 |
| 19 | Costco<br>Wholesale<br>Corp  | 开市客               | COST US     | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 59    | 418,108.48   | 1.25 |
| 20 | Walmart<br>Inc               | 沃尔玛<br>公司         | WMT US      | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 586   | 410,181.19   | 1.23 |
| 21 | The<br>Procter               | 宝洁公<br>司          | PG US       | 纽约证<br>券交易        | 美国 | 311   | 354,698.04   | 1.06 |

|    |                                    |            |         |           |    |       |            |      |
|----|------------------------------------|------------|---------|-----------|----|-------|------------|------|
|    | & Gamble Company                   |            |         | 所         |    |       |            |      |
| 22 | Johnson & Johnson                  | 强生公司       | JNJ US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 319   | 348,818.89 | 1.04 |
| 23 | Oracle Corporation                 | 甲骨文股份有限公司  | ORCL US | 纽约证券交易所   | 美国 | 220   | 344,318.64 | 1.03 |
| 24 | The Home Depot, Inc                | 家得宝        | HD US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 131   | 343,826.41 | 1.03 |
| 25 | Norwegian Cruise Line Holdings Ltd | 挪威邮轮控股有限公司 | NCLH US | 纽约证券交易所   | 美国 | 2,304 | 334,486.44 | 1.00 |
| 26 | AbbVie Inc                         | 艾伯维股份有限公司  | ABBV US | 纽约证券交易所   | 美国 | 234   | 310,934.36 | 0.93 |
| 27 | Bank of America Corporation        | 美国银行       | BAC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 883   | 299,111.79 | 0.89 |
| 28 | Coca Cola Co                       | 可口可乐公司     | KO US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 543   | 275,013.73 | 0.82 |
| 29 | UnitedHealth Group Inc             | 联合健康集团     | UNH US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 123   | 274,692.02 | 0.82 |
| 30 | Philip Morris International Inc    | 菲利普莫里斯国际公司 | PM US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 206   | 268,581.94 | 0.80 |
| 31 | GE Aerospace Co                    | 通用电气航空航天   | GE US   | 纽约证券交易所   | 美国 | 144   | 265,327.50 | 0.79 |
| 32 | Cisco Systems, Inc                 | 思科系统公司     | CSCO US | 纳斯达克证券交易所 | 美国 | 529   | 262,735.08 | 0.79 |
| 33 | Wells Fargo & Company              | 富国银行       | WFC US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 451   | 258,669.71 | 0.77 |
| 34 | International Business             | 国际商业机器公司   | IBM US  | 纽约证券交易所   | 美国 | 122   | 257,445.88 | 0.77 |

|    |                                          |                        |         |                   |    |     |            |      |
|----|------------------------------------------|------------------------|---------|-------------------|----|-----|------------|------|
|    | Machine<br>s Corp                        |                        |         |                   |    |     |            |      |
| 35 | Salesforc<br>e, Inc                      | 赛富时                    | CRM US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 127 | 247,913.99 | 0.74 |
| 36 | The<br>Goldman<br>Sachs<br>Group,<br>Inc | 高盛集<br>团有限<br>公司       | GS US   | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 48  | 243,191.96 | 0.73 |
| 37 | Chevron<br>Corporati<br>on               | 雪佛龙<br>公司              | CVX US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 230 | 235,759.18 | 0.70 |
| 38 | Abbott<br>Laborator<br>ies               | 雅培<br>Labora<br>tories | ABT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 230 | 223,937.47 | 0.67 |
| 39 | Advanced<br>Micro<br>Devices,<br>Inc     | 超威半<br>导体公<br>司        | AMD US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 214 | 217,382.34 | 0.65 |
| 40 | Linde PLC                                | 林德集<br>团               | LIN US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 63  | 211,596.33 | 0.63 |
| 41 | ServiceNo<br>w, Inc                      | Servic<br>eNow 公<br>司  | NOW US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 27  | 198,709.56 | 0.59 |
| 42 | McDonald'<br>s Corp                      | 麦当劳<br>公司              | MCD US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 95  | 198,695.18 | 0.59 |
| 43 | Merck &<br>Co., Inc                      | 默克                     | MRK US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 336 | 190,402.72 | 0.57 |
| 44 | Intuitive<br>Surgical,<br>Inc            | 直觉外<br>科公司             | ISRG US | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 47  | 182,832.58 | 0.55 |
| 45 | Texas<br>Instrumen<br>ts Inc             | 德州仪<br>器公司             | TXN US  | 纳斯达<br>克证券<br>交易所 | 美国 | 120 | 178,352.22 | 0.53 |
| 46 | Caterpill<br>ar Inc                      | 卡特彼<br>勒公司             | CAT US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 64  | 177,858.57 | 0.53 |
| 47 | Accenture<br>PLC                         | 埃森哲<br>公司              | ACN US  | 纽约证<br>券交易<br>所   | 美国 | 83  | 177,589.62 | 0.53 |

|    |                              |             |          |           |      |         |            |      |
|----|------------------------------|-------------|----------|-----------|------|---------|------------|------|
| 48 | Verizon Communications Inc   | 威瑞森通信公司     | VZ US    | 纽约证券交易所   | 美国   | 558     | 172,841.96 | 0.52 |
| 49 | Pepsico, Inc                 | 百事公司        | PEP US   | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 181     | 171,085.10 | 0.51 |
| 50 | Adobe Inc                    | 奥多比公司       | ADBE US  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 57      | 157,862.59 | 0.47 |
| 51 | NextEra Energy, Inc          | 新纪元能源公司     | NEE US   | 纽约证券交易所   | 美国   | 308     | 153,060.60 | 0.46 |
| 52 | Thermo Fisher Scientific Inc | 赛默飞世尔科技公司   | TMO US   | 纽约证券交易所   | 美国   | 50      | 145,126.30 | 0.43 |
| 53 | Bristol-Myers Squibb Co      | 百时美施贵宝公司    | BMJ US   | 纽约证券交易所   | 美国   | 317     | 105,044.80 | 0.31 |
| 54 | Veralto Corp                 | Veralt o 公司 | VLTO US  | 纽约证券交易所   | 美国   | 30      | 21,679.82  | 0.06 |
| 55 | Sound Global Ltd.            | 桑德国际有限公司    | 00967 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 210,000 | 1,915.10   | 0.01 |
| 56 | China Animal Healthcare Ltd. | 中国动物保健品有限公司 | 00940 HK | 香港联合交易所   | 中国香港 | 100,000 | 0.00       | 0.00 |

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）           | 证券代码     | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------------------|----------|--------------|----------------|
| 1  | Apple Inc          | AAPL US  | 3,011,646.03 | 7.64           |
| 2  | NVIDIA Corp        | NVDA US  | 2,947,724.84 | 7.48           |
| 3  | Microsoft Corp     | MSFT US  | 2,933,046.62 | 7.44           |
| 4  | Amazon.com Inc     | AMZN US  | 2,108,876.45 | 5.35           |
| 5  | Meta Platforms Inc | META US  | 1,482,488.75 | 3.76           |
| 6  | Alphabet Inc       | GOOGL US | 1,367,745.56 | 3.47           |
| 7  | Tesla Inc          | TSLA US  | 1,131,858.01 | 2.87           |
| 8  | Carnival Corp      | CCL US   | 1,020,367.63 | 2.59           |

|    |                                                 |          |            |      |
|----|-------------------------------------------------|----------|------------|------|
| 9  | Broadcom Inc                                    | AVGO US  | 995,275.22 | 2.53 |
| 10 | Citigroup Inc                                   | C US     | 989,173.50 | 2.51 |
| 11 | Taiwan Semiconductor Manufacturing Company Ltd. | TSM US   | 932,456.17 | 2.37 |
| 12 | Alphabet Inc                                    | GOOG US  | 928,709.36 | 2.36 |
| 13 | Norwegian Cruise Line Holdings                  | NCLH US  | 825,714.19 | 2.10 |
| 14 | JPMorgan Chase & Co                             | JPM US   | 695,405.07 | 1.76 |
| 15 | The Goldman Sachs Group, Inc                    | GS US    | 655,212.24 | 1.66 |
| 16 | Eli Lilly & Co                                  | LLY US   | 622,192.98 | 1.58 |
| 17 | Berkshire Hathaway Inc                          | BRK/B US | 601,010.48 | 1.53 |
| 18 | Deckers Outdoor Corp                            | DECK US  | 590,032.27 | 1.50 |
| 19 | Visa Inc                                        | V US     | 527,517.78 | 1.34 |
| 20 | Exxon Mobil Corp                                | XOM US   | 479,311.95 | 1.22 |

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                                              | 证券代码     | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|-------------------------------------------------------|----------|--------------|----------------|
| 1  | NVIDIA Corp                                           | NVDA US  | 1,232,411.29 | 3.13           |
| 2  | Tencent Holdings Limited                              | 00700 HK | 898,336.10   | 2.28           |
| 3  | Alibaba Group Holding Limited                         | 09988 HK | 512,929.24   | 1.30           |
| 3  | Alibaba Group Holding Ltd                             | BABA US  | 218,397.16   | 0.55           |
| 4  | NetEase, Inc.                                         | 09999 HK | 523,884.99   | 1.33           |
| 4  | NetEase Inc                                           | NTES US  | 171,774.29   | 0.44           |
| 5  | Xiaomi Corporation                                    | 01810 HK | 683,744.44   | 1.74           |
| 6  | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 00981 HK | 674,432.54   | 1.71           |
| 7  | Microsoft Corp                                        | MSFT US  | 629,328.74   | 1.60           |
| 8  | Deckers Outdoor Corp                                  | DECK US  | 570,286.82   | 1.45           |
| 9  | JD.com, Inc.                                          | 09618 HK | 478,685.60   | 1.21           |
| 9  | JD.com Inc                                            | JD US    | 61,803.30    | 0.16           |
| 10 | Carnival Corp                                         | CCL US   | 524,293.05   | 1.33           |

|    |                              |          |            |      |
|----|------------------------------|----------|------------|------|
| 11 | Meituan                      | 03690 HK | 483,316.54 | 1.23 |
| 12 | Kuaishou Technology          | 01024 HK | 462,667.37 | 1.17 |
| 13 | Lenovo Group Limited         | 00992 HK | 439,912.89 | 1.12 |
| 14 | Trip.com Group Limited       | 09961 HK | 423,943.23 | 1.08 |
| 15 | Haier Smart Home Co., Ltd.   | 06690 HK | 409,753.90 | 1.04 |
| 16 | Baidu, Inc.                  | 09888 HK | 314,407.13 | 0.80 |
| 16 | Baidu Inc                    | BIDU US  | 86,085.74  | 0.22 |
| 17 | Apple Inc                    | AAPL US  | 400,023.12 | 1.02 |
| 18 | The Goldman Sachs Group, Inc | GS US    | 398,980.10 | 1.01 |
| 19 | Innovent Biologics, Inc.     | 01801 HK | 376,284.08 | 0.95 |
| 20 | Royal Caribbean Cruises Ltd  | RCL US   | 351,384.76 | 0.89 |

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |               |
|------------|---------------|
| 买入成本（成交）总额 | 34,255,530.64 |
| 卖出收入（成交）总额 | 17,285,169.23 |

注：本项中 7.5.1、7.5.2、7.5.3 表中的“买入金额”（或“买入成本（成交）总额”）、“卖出金额”（或“卖出收入（成交）总额”）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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                       | 基金类型       | 运作方式   | 管理人                            | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------------|------------|--------|--------------------------------|--------------|---------------|
| 1  | SPDR S&P 500 ETF           | 开放式 ETF 基金 | 交易型开放式 | SSGA Funds Management Inc      | 1,008,430.55 | 3.01          |
| 2  | Invesco QQQ Trust Series 1 | 开放式 ETF 基金 | 交易型开放式 | Invesco Capital Management LLC | 683,171.83   | 2.04          |

注：本基金本报告期末仅持有上述两只基金。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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  | 12,562.41 |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 46,238.59 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 58,801.00 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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。

### 7.11.6 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) |
| 2,602        | 11,063.09     | 20,563,847.85 | 71.44         | 8,222,303.26 | 28.56         |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 87,910.89 | 0.3053      |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 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(2010年5月26日)基金份额总额 | 340,041,384.63 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 33,348,407.33  |
| 本报告期基金总申购份额               | 6,407,884.75   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 10,970,140.97  |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 28,786,151.11  |

## § 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的重大人事变动情况

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

本报告期无涉及本基金管理人、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容诚会计师事务所（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(%) |    |
| 招商证券 | 1      | 51,540,699.87 | 100.00          | 93,606.87 | 100.00        | -  |
| 国泰海通 | 1      | -             | -               | -         | -             | -  |
| 兴证国际 | 1      | -             | -               | -         | -             | -  |

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |            | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |            | 基金交易 |                 |
|------|------|------------|--------|-------------------|------|------------|------|-----------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例(%) |

|          |   | 比例<br>(%) |   |   |   | 比例<br>(%) |              |        |
|----------|---|-----------|---|---|---|-----------|--------------|--------|
| 招商<br>证券 | - | -         | - | - | - | -         | 4,293,718.23 | 100.00 |
| 国泰<br>海通 | - | -         | - | - | - | -         | -            | -      |
| 兴证<br>国际 | - | -         | - | - | - | -         | -            | -      |

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：无。

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（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 |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 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 |
| 6  | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金 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 |
| 7  | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证                          | 中国证监会基金电子披            | 2025 年 1 月 24 日 |

|    |                                                   |                       |                 |
|----|---------------------------------------------------|-----------------------|-----------------|
|    | 券投资基金托管协议（更新）                                     | 露网站及基金管理人网站           |                 |
| 8  | 关于长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金调低基金费率并修改基金合同等法律文件的公告      | 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 24 日 |
| 9  | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同（更新）                     | 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 24 日 |
| 10 | 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  |
| 11 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金（QDII）节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 4 月 18 日 |
| 14 | 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 |
| 15 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金 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 |
| 16 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）                    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 6 月 7 日  |
| 17 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新                   | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 6 月 7 日  |
| 18 | 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金（QDII）暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 6 月 30 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |          |
|-------|----------------|-------------------------|------|------|------|------------|----------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 (%) |

|                                                                                                                                                        |   |                   |              |              |              |              |       |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|-------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-------|
| 机构                                                                                                                                                     | 1 | 20250101~20250102 | 6,727,502.10 | 0.00         | 6,727,502.10 | 0.00         | 0.00  |
|                                                                                                                                                        | 2 | 20250101~20250630 | 6,727,502.10 | 1,480,541.46 | 0.00         | 8,208,043.56 | 28.51 |
| 产品特有风险                                                                                                                                                 |   |                   |              |              |              |              |       |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。 |   |                   |              |              |              |              |       |

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、长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛环球景气行业大盘精选混合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的办公地址和/或基金托管人住所。

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