

# 长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人于 2024 年 12 月 31 日 0:00 起至 2025 年 2 月 4 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议了《关于持续运作长信汇智量化选股混合型证券投资基金并修改基金合同的议案》。议案于 2025 年 2 月 5 日被表决通过并生效。

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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于 2026 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 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 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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 .....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
4.9 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 .....	19
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	23
7.3 净资产变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	26
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	76
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	77
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	77
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	77
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	77
8.12 投资组合报告附注 .....	77
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
9.3 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 .....	78
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>79</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2 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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	80
11.8 其他重大事件 .....	81
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>84</b>
12.1 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 .....	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信汇智量化选股混合型证券投资基金		
基金简称	长信汇智量化选股混合		
基金主代码	018724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2023 年 11 月 28 日		
基金管理人	长信基金管理有限责任公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	203,042,468.02 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 E
下属分级基金的交易代码	018724	018725	024260
报告期末下属分级基金的份额总额	43,349,033.08 份	38,660,186.91 份	121,033,248.03 份

注：基金管理人决定自 2025 年 5 月 30 日起对长信汇智量化选股混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额、C 类份额，增设 E 类份额，具体事宜可详见基金管理人于 2025 年 5 月 28 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金增设 E 类基金份额及调整管理费率并修改基金合同等相关事项的公告》。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*60%+中债综合指数收益率*30%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
		张姗
		400-61-95555
		zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4007005566	400-61-95555
传真	021-61009800	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	刘元瑞	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区汉口路 99 号 11 楼
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2025 年		2025 年 5 月 30 日(份额增加日)-2025 年 12 月 31 日	2024 年		2023 年 11 月 28 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日		2023 年
	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 E	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合

						E			E
本期已实现收益	6,002,169.45	3,807,203.22	20,867,737.79	-2,075,404.41	-1,113,224.78	-	411,795.37	470,666.27	-
本期利润	7,823,932.93	2,837,233.02	28,063,741.51	-2,497,387.76	-786,046.33	-	538,110.79	517,713.55	-
加权平均基金份额本期利润	0.1842	0.0406	0.2519	-0.1295	-0.0681	-	0.0100	0.0089	-
本期加权平均净值利润率	18.09%	4.13%	23.39%	-14.59%	-7.71%	-	1.00%	0.89%	-
本期基金份额净值增长率	26.93%	26.42%	26.69%	-8.80%	-9.18%	-	1.24%	1.20%	-
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
期末可供分配利润	6,792,288.65	5,682,128.74	18,927,486.78	-1,049,071.59	-591,644.93	-	281,511.18	187,045.43	-
期末可供分配基金份额利润	0.1567	0.1470	0.1564	-0.0767	-0.0809	-	0.0080	0.0076	-
期末基金资产净值	50,798,681.50	44,919,016.26	141,795,781.03	12,636,076.14	6,725,046.14	-	35,472,813.44	24,871,893.01	-

期末基金份额净值	1.1719	1.1619	1.1715	0.9233	0.9191	1.0124	1.0120	-
3.1.3 累计期末指标	2025 年末			2024 年末		2023 年末		
基金份额累计净值增长率	17.19%	16.19%	26.69%	-7.67%	-8.09%	1.24%	1.20%	-

注：1、长信汇智量化选股混合型证券投资基金 E 类份额增加日为 2025 年 5 月 30 日，根据管理人于 2025 年 5 月 28 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金 E 类基金份额净值计算与披露方法的说明》，任何一个工作日 E 类基金份额为零时，本基金将停止计算 E 类基金份额净值，暂停计算期间的 E 类基金份额净值将按照 A 类基金份额净值披露，作为参考份额净值；截至本报告期末，长信汇智量化选股混合型证券投资基金 E 类份额运作时间未满一年；

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、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

4、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信汇智量化选股混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.89%	0.92%	-0.47%	0.69%	1.36%	0.23%
过去六个月	22.75%	0.88%	11.76%	0.64%	10.99%	0.24%

过去一年	26.93%	1.02%	14.48%	0.72%	12.45%	0.30%
自基金合同生效 起至今	17.19%	1.39%	25.75%	0.82%	-8.56%	0.57%

## 长信汇智量化选股混合 C

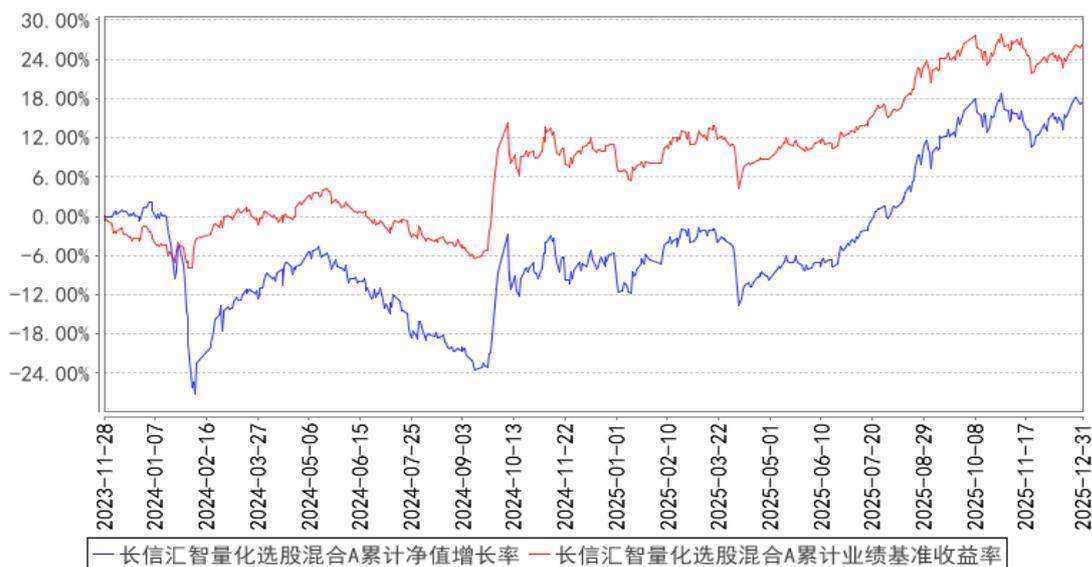
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.78%	0.92%	-0.47%	0.69%	1.25%	0.23%
过去六个月	22.50%	0.87%	11.76%	0.64%	10.74%	0.23%
过去一年	26.42%	1.02%	14.48%	0.72%	11.94%	0.30%
自基金合同生效 起至今	16.19%	1.39%	25.75%	0.82%	-9.56%	0.57%

## 长信汇智量化选股混合 E

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.87%	0.92%	-0.47%	0.69%	1.34%	0.23%
过去六个月	22.72%	0.87%	11.76%	0.64%	10.96%	0.23%
自份额增加日起 至今	26.69%	0.85%	13.66%	0.62%	13.03%	0.23%

### 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

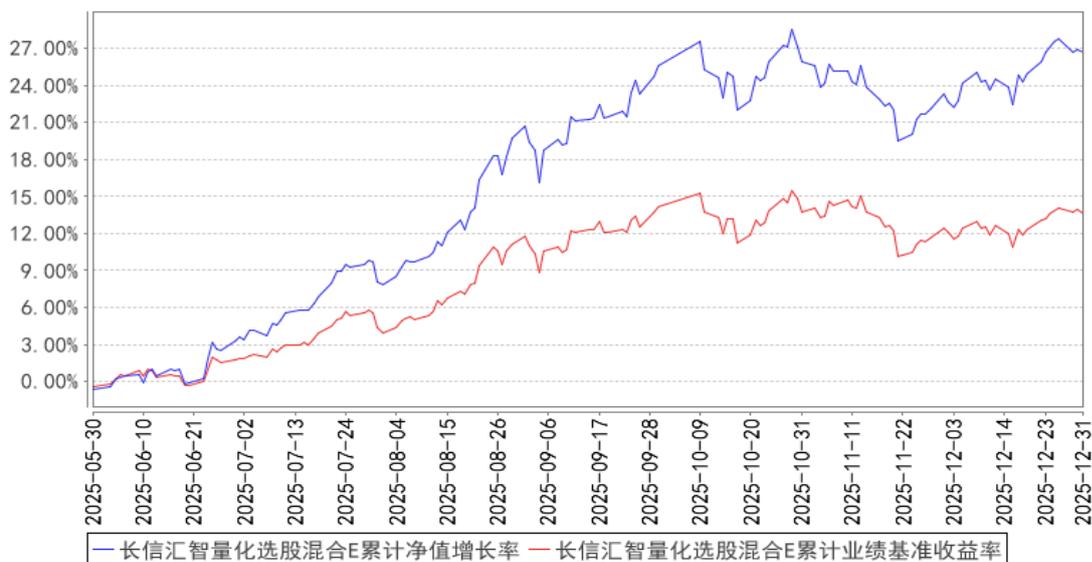
长信汇智能化选股混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信汇智能化选股混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信汇智量化选股混合E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



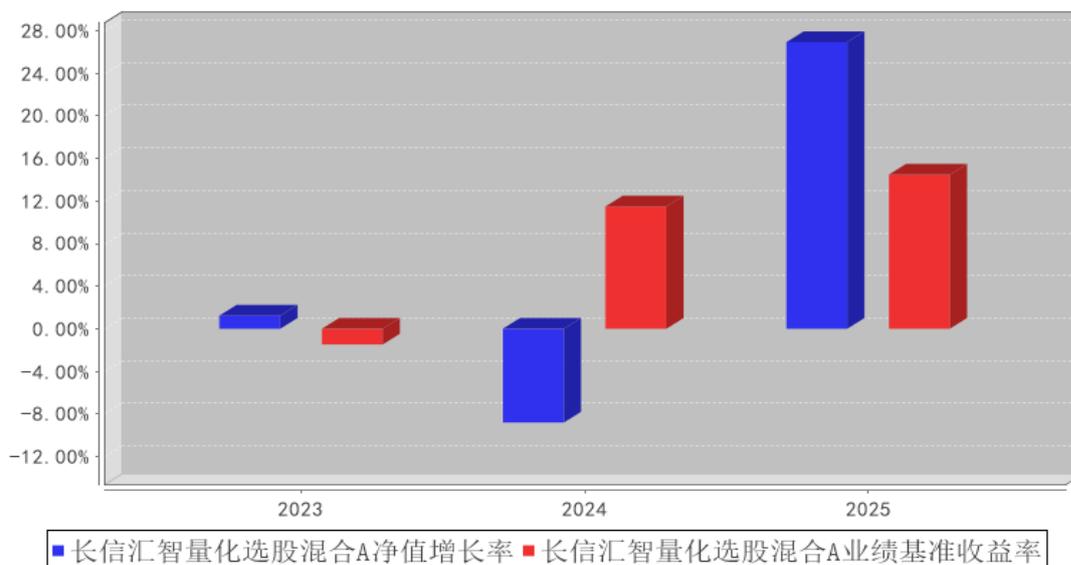
注：1、基金管理人自 2025 年 5 月 30 日起对长信汇智量化选股混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额、C 类份额，增设 E 类份额。

2、长信汇智量化选股混合 A、C 图示日期为 2023 年 11 月 28 日至 2025 年 12 月 31 日，长信汇智量化选股混合 E 图示日期为 2025 年 5 月 30 日（份额增加日）至 2025 年 12 月 31 日。

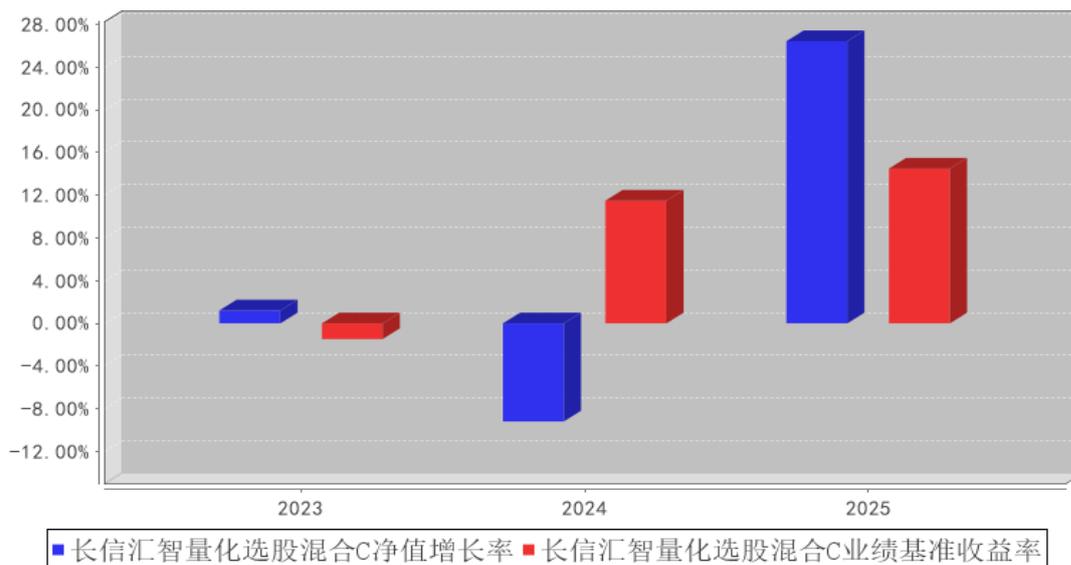
3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

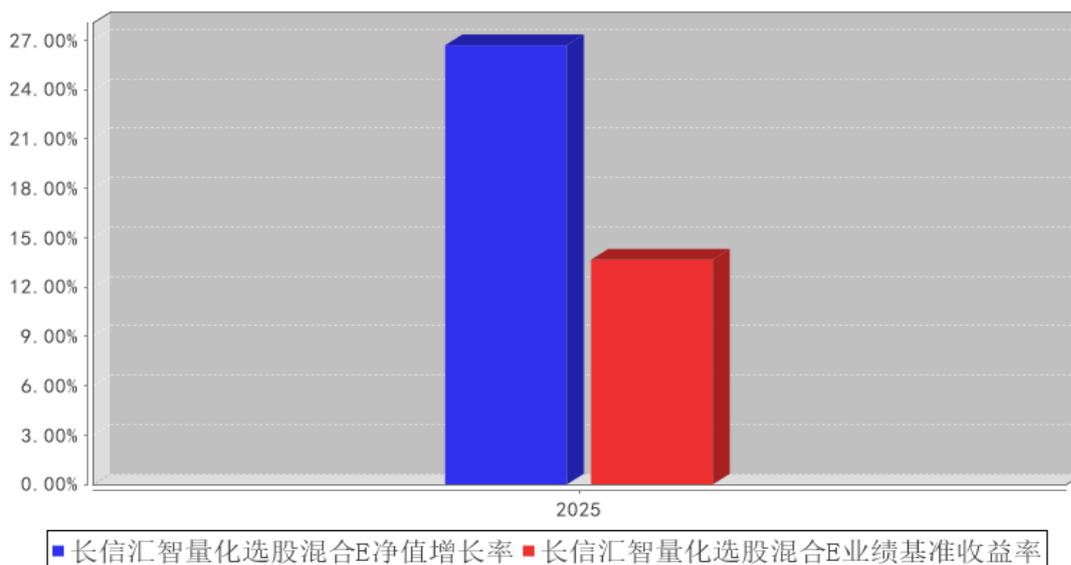
长信汇智量化选股混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信汇智量化选股混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信汇智量化选股混合E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长信汇智量化选股混合 E 图示份额计算期间为自份额增加日 2025 年 5 月 30 日至 2025 年 12 月 31 日，2025 年净值增长率按长信汇智量化选股混合 E 份额实际存续期计算。

长信汇智量化选股混合 A 份额及长信汇智量化选股混合 C 份额合同生效日为 2023 年 11 月 28 日，长信汇智量化选股混合 A 份额及长信汇智量化选股混合 C 份额 2023 年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2023年11月28日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 89 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目

标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策	2023 年 11 月 28 日	-	15 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、总经理助理、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中

	略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金和长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理、量化投资管理中心总经理兼量化投资部总监			证上海改革发展主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信量化优选混合型证券投资基金 (LOF)、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理。现任量化投资管理中心总经理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金和长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、

勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统自动将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合且不同投资经理针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，根据市场情况审核后通过人工分发给不同交易员豁免公平交易。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，系统已强制开启公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年货币政策延续适度宽松基调，保持流动性合理充裕，财政政策更加积极有为，协同发力促进稳增长，宏观经济在复杂严峻的外部环境中实现了预期增长目标，经济总量跃上新台阶，结构调整优化，新动能持续壮大，外贸进出口再创新高，物价总体平稳，企业盈利改善。2025 年的 A 股市场走出“震荡上行、结构分化”的行情，指数层面实现关键突破，上证指数四季度阶段性突破 4000 点，创下十年新高；市场呈现高度结构化的运行特征，有色金属、通信、电子行业领涨，科技与有色板块成为全年市场绝对主线。市场风格维度，以高贝塔、高动量、高成长、小市值为代表的进攻型风格全年占优。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，长信汇智量化选股混合 A 基金份额净值为 1.1719 元，份额累计净值为 1.1719 元，本报告期内长信汇智量化选股混合 A 净值增长率为 26.93%，同期业绩比较基准收益率为 14.48%；长信汇智量化选股混合 C 基金份额净值为 1.1619 元，份额累计净值为 1.1619 元，本报告期内长信汇智量化选股混合 C 净值增长率为 26.42%，同期业绩比较基准收益率为 14.48%；长信汇智量化选股混合 E 基金份额净值为 1.1715 元，份额累计净值为 1.1715 元，本报告期内长信汇智量化选股混合 E 净值增长率为 26.69%，同期业绩比较基准收益率为 13.66%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，随着国内经济逐步企稳，新质生产力和科技创新有望成为推动经济增长和产业升级的新动能。AI、机器人、新能源等重点产业的技术突破、新技术产业化落地将开启新一轮资本开支周期，持续的研发投入将带动相关资产价值重估。从市场结构来看，以半导体、人工智能、高端装备制造、新能源和生物医药等为代表的新兴成长行业，更符合我国经济转型升级方向，在市场交易持续活跃的状态下有望获得市场更多关注，具备相对较好的成长空间。在投资策略上，本基金坚持以基本面为主导，综合考量短期交易情绪、中期行业景气度及长期竞争格局，自下而上精选景气度边际改善、质地优异且被市场低估的优质个股。综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争为投资者获取长期稳健超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险梳理的工作，适时组织召开内部控制委员会会议，对各项监管要求进行解读，并对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨，加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论，防范组合风险事件发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 4 月 2 日至 2025 年 3 月 16 日。本基金管理人已经向上海证监局报告并提出解决方案。基金管理人于 2024 年 12 月 31 日 0:00 起至 2025 年 2 月 4 日 17:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议了《关于持续运作长信汇智量化选股混合型证券投资基金并修改基金合同的议案》，议案于 2025 年 2 月 5 日被表决通过并生效。

### § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2026]第 ZA30205 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	长信汇智量化选股混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了长信汇智量化选股混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信汇智量化选股混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金管理人长信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信汇智量化选股混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信汇智量化选股混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长信汇智量化选股混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长信汇智量化选股混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信汇智量化选股混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴凌志	刘乐君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号四楼	
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信汇智量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	15,136,661.32	1,261,835.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	222,782,141.66	18,201,214.84
其中：股票投资		222,782,141.66	18,201,214.84

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,001,815.25	50.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		242,920,618.23	19,463,100.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,060,167.60	68,168.01
应付管理人报酬		159,260.09	20,774.77
应付托管费		39,815.04	3,462.47
应付销售服务费		19,744.95	2,444.48
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	7.4.7.9	128,151.76	7,128.14
负债合计		5,407,139.44	101,977.87
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	203,042,468.02	21,001,838.80
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	34,471,010.77	-1,640,716.52
净资产合计		237,513,478.79	19,361,122.28
负债和净资产总计		242,920,618.23	19,463,100.15

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，长信汇智量化选股混合 A 份额净值 1.1719 元；长信汇智量化选股混合 C 份额净值 1.1619 元；长信汇智量化选股混合 E 份额净值 1.1715 元；基金份额总额为 203,042,468.02 份，其中长信汇智量化选股混合 A 份额 43,349,033.08 份。长信汇智量化选股混合 C 份额 38,660,186.91 份。长信汇智量化选股混合 E 份额 121,033,248.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信汇智量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		41,172,385.75	-2,851,081.92
1. 利息收入		67,941.26	18,235.04
其中：存款利息收入	7.4.7.13	67,941.26	18,235.04
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）		32,966,520.15	-3,184,639.83
其中：股票投资收益	7.4.7.14	28,784,703.62	-4,022,505.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	4,181,816.53	837,865.81
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	8,047,797.00	-94,804.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	90,127.34	410,127.77
<b>减：二、营业总支出</b>		2,447,478.29	432,352.17

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,642,055.90	326,713.69
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	363,149.05	54,452.34
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	299,963.66	40,484.16
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	142,309.68	10,701.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>38,724,907.46</b>	<b>-3,283,434.09</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>38,724,907.46</b>	<b>-3,283,434.09</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>38,724,907.46</b>	<b>-3,283,434.09</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：长信汇智量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	21,001,838.80	-	-1,640,716.52	19,361,122.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	21,001,838.80	-	-1,640,716.52	19,361,122.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	182,040,629.22	-	36,111,727.29	218,152,356.51
（一）、综合收益总额	-	-	38,724,907.46	38,724,907.46
（二）、本期基金份额交易产生的	182,040,629.22	-	-2,613,180.17	179,427,449.05

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	365,508,758.60	-	-10,928,741.73	354,580,016.87
2. 基金赎 回款	-183,468,129.3 8	-	8,315,561.56	-175,152,567.82
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	203,042,468.02	-	34,471,010.77	237,513,478.79
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	59,616,569.54	-	728,136.91	60,344,706.45
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	59,616,569.54	-	728,136.91	60,344,706.45
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-38,614,730.74	-	-2,368,853.43	-40,983,584.17
(一)、综合收益 总额	-	-	-3,283,434.09	-3,283,434.09
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	-38,614,730.74	-	914,580.66	-37,700,150.08
其中：1. 基金申 购款	35,495,583.40	-	-4,376,229.10	31,119,354.30

2. 基金赎回款	-74,110,314.14	-	5,290,809.76	-68,819,504.38
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	21,001,838.80	-	-1,640,716.52	19,361,122.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

肖剑

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信汇智量化选股混合型证券投资基金(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”)证监许可[2023]1258号《关于准予长信汇智量化选股混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信汇智量化选股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234,192,204.95元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第00288号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同》于2023年11月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为234,224,327.61份基金份额,其中认购资金利息折合32,122.66份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,而不计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

根据基金管理人 2025 年 5 月 28 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金增设 E 类基金份额及调整管理费率并修改基金合同等相关事项的公告》，本基金于 2025 年 5 月 30 日增设基金份额，原有 A 类、C 类基金份额保留，同时增设 E 类基金份额，E 类基金份额的登记机构为长信基金管理有限责任公司。本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类、C 类和 E 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信汇智量化选股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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市股票(包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*30%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)\*10%。

#### 7.4.2 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》、《长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金在符合基金有关分红条件的前提下可进行收益分配,具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类、E类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(3)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定,并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产

生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号《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》及其他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。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	5,469,242.18	210,933.97
等于：本金	5,468,300.33	210,805.75
加：应计利息	941.85	128.22
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	9,667,419.14	1,050,901.34
等于：本金	9,666,434.69	1,050,830.32
加：应计利息	984.45	71.02
减：坏账准备	-	-
合计	15,136,661.32	1,261,835.31

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

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	214,655,786.86	-	222,782,141.66	8,126,354.80
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	214,655,786.86	-	222,782,141.66	8,126,354.80
项目	上年度末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,122,657.04	-	18,201,214.84	78,557.80
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,122,657.04	-	18,201,214.84	78,557.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	18,905.18	128.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	18,835.62	7,000.00
预提信息披露费	90,410.96	-
合计	128,151.76	7,128.14

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信汇智量化选股混合 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,685,147.73	13,685,147.73
本期申购	65,891,501.81	65,891,501.81
本期赎回（以“-”号填列）	-36,227,616.46	-36,227,616.46
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	43,349,033.08	43,349,033.08

## 长信汇智量化选股混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,316,691.07	7,316,691.07
本期申购	178,481,023.94	178,481,023.94
本期赎回（以“-”号填列）	-147,137,528.10	-147,137,528.10
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	38,660,186.91	38,660,186.91

## 长信汇智量化选股混合 E

项目	本期 2025 年 5 月 30 日（基金份额增加日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金份额增加日	-	-
本期申购	121,136,232.85	121,136,232.85
本期赎回（以“-”号填列）	-102,984.82	-102,984.82
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	121,033,248.03	121,033,248.03

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据基金管理人于 2025 年 5 月 28 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金增设 E 类基金份额及调整管理费率并修改基金合同等相关事项的公告》，自 2025 年 5 月 30 日起，本基金增加 E 类份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 长信汇智量化选股混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-576,169.85	-472,901.74	-1,049,071.59
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-576,169.85	-472,901.74	-1,049,071.59
本期利润	6,002,169.45	1,821,763.48	7,823,932.93
本期基金份额交易产生的变动数	1,366,289.05	-691,501.97	674,787.08
其中：基金申购款	2,175,760.76	-962,852.73	1,212,908.03
基金赎回款	-809,471.71	271,350.76	-538,120.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,792,288.65	657,359.77	7,449,648.42

## 长信汇智量化选股混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-339,651.38	-251,993.55	-591,644.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-339,651.38	-251,993.55	-591,644.93
本期利润	3,807,203.22	-969,970.20	2,837,233.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,214,576.90	1,798,664.36	4,013,241.26
其中：基金申购款	231,235.99	-5,080,179.34	-4,848,943.35
基金赎回款	1,983,340.91	6,878,843.70	8,862,184.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,682,128.74	576,700.61	6,258,829.35

## 长信汇智量化选股混合 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金份额增加日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	20,867,737.79	7,196,003.72	28,063,741.51
本期基金份额交易产生的变动数	-1,940,251.01	-5,360,957.50	-7,301,208.51
其中：基金申购款	-1,934,397.12	-5,358,309.29	-7,292,706.41
基金赎回款	-5,853.89	-2,648.21	-8,502.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,927,486.78	1,835,046.22	20,762,533.00

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日

活期存款利息收入	37,069.14	12,656.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	24,188.04	5,576.87
结算备付金利息收入	-	-
其他	6,684.08	1.20
合计	67,941.26	18,235.04

注：1、其他为申购款利息收入。

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

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
卖出股票成交总额	985,184,410.54	216,523,418.68
减：卖出股票成本总额	954,840,449.23	220,225,139.64
减：交易费用	1,559,257.69	320,784.68
买卖股票差价收入	28,784,703.62	-4,022,505.64

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利收益	4,181,816.53	837,865.81
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,181,816.53	837,865.81

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	8,047,797.00	-94,804.90
股票投资	8,047,797.00	-94,804.90
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	8,047,797.00	-94,804.90

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	90,105.22	410,127.71
基金转换费收入	22.12	0.06
合计	90,127.34	410,127.77

注：对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，其 75% 计入基金财产；对于持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 50% 计入基金财产；对于持有期不少于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，其 25% 计入基金财产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	18,835.62	7,000.00
信息披露费	90,410.96	-
证券出借违约金	-	-
其他费用	32,945.10	3,684.45
存托服务费	118.00	17.53
合计	142,309.68	10,701.98

注：1、其他费用为银行手续费、持有人大会费、律师费等。

2、自 2024 年 6 月 21 日起至 2025 年 3 月 31 日，本基金迷你期间的相关固定费用由基金管理人承担。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司(以下简称“海欣集团”)	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司(以下简称“武钢有限”)	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤胜投资”)	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤骏投资”)	基金管理人的股东

上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司(以下简称“长江期货”)	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,642,055.90	326,713.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	225,141.45	151,551.04
应支付基金管理人的净管理费	1,416,914.45	175,162.65

注：根据《长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金增设 E 类基金份额及调整管理费率并修改基金合同等相关事项的公告》，自 2025 年 5 月 30 日起，本基金的年管理费率由 1.20% 调整为 0.80%。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	363,149.05	54,452.34

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 E	合计
招商银行	-	7,713.97	-	7,713.97
长江证券	-	38.16	-	38.16
长信基金	-	78,733.47	18,223.27	96,956.74
合计	-	86,485.60	18,223.27	104,708.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 E	合计
招商银行	-	13,687.47	-	13,687.47
长江证券	-	-	-	-
长信基金	-	-	-	-
合计	-	13,687.47	-	13,687.47

注：1、本基金于 2025 年 5 月 30 日进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，C 类份额，增设 E 类份额。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类、E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	5,469,242.18	37,069.14	210,933.97	12,656.97

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001221	悍高集团	2025年7月23日	6个月	新股锁定	15.43	56.94	152	2,345.36	8,654.88	-
001233	海安集团	2025年11月18日	6个月	新股锁定	48.00	51.88	148	7,104.00	7,678.24	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	6个月	新股锁定	17.89	45.36	911	16,297.79	41,322.96	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股锁定	42.28	56.08	53	2,240.84	2,972.24	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新股锁定	6.85	12.89	392	2,685.20	5,052.88	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股锁定	13.75	18.53	580	7,975.00	10,747.40	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股锁定	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-

301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股锁定	28.91	55.11	182	5,261.62	10,030.02	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股锁定	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股锁定	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股锁定	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股锁定	6.56	23.68	558	3,660.48	13,213.44	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股锁定	5.69	14.21	887	5,047.03	12,604.27	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股锁定	12.48	25.46	1,294	16,149.12	32,945.24	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	54.39	189	4,144.77	10,279.71	-
600930	华电新能	2025年7月9日	6个月	新股锁定	3.18	6.24	34,765	110,552.70	216,933.60	-

601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股锁定	5.98	14.28	449	2,685.02	6,411.72	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股锁定	46.68	55.66	59	2,754.12	3,283.94	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股锁定	17.08	48.56	127	2,169.16	6,167.12	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定	10.10	16.30	215	2,171.50	3,504.50	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定	24.49	32.82	86	2,106.14	2,822.52	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股锁定	18.60	46.35	77	1,432.20	3,568.95	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股锁定	23.60	40.16	95	2,242.00	3,815.20	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股锁定	46.36	59.06	52	2,410.72	3,071.12	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定	14.99	34.87	348	5,216.52	12,134.76	-

688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股锁定	8.45	24.28	962	8,128.90	23,357.36	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股锁定	17.78	25.11	181	3,218.18	4,544.91	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	新股锁定	8.62	18.36	447	3,853.14	8,206.92	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股锁定	114.28	416.02	837	95,652.36	348,208.74	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股锁定	26.68	42.25	226	6,029.68	9,548.50	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股锁定	104.66	399.40	666	69,703.56	266,000.40	-
688805	健信超导	2025年12月17日	6个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新股锁定	51.66	135.56	98	5,062.68	13,284.88	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股锁定	85.09	203.31	72	6,126.48	14,638.32	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025年12	重大事项	78.81	2026年1	86.69	28,600	2,302,642.08	2,253,966.00	-

		月 30 日	停牌		月 15 日				
--	--	-----------	----	--	-----------	--	--	--	--

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

##### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	15,136,661.32	-	-	-	-	15,136,661.32
交易性金融资产	-	-	-	-	222,782,141.66	222,782,141.66
应收申购款	5,000,000.00	-	-	-	1,815.25	5,001,815.25
资产总计	20,136,661.32	-	-	-	222,783,956.91	242,920,618.23
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	5,060,167.60	5,060,167.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	159,260.09	159,260.09
应付托管费	-	-	-	-	39,815.04	39,815.04
应付销售服务费	-	-	-	-	19,744.95	19,744.95
其他负债	-	-	-	-	128,151.76	128,151.76
负债总计	-	-	-	-	5,407,139.44	5,407,139.44
利率敏感度缺口	20,136,661.32	-	-	-	-217,376,817.47	237,513,478.79
上年度末 2024年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,261,835.31	-	-	-	-	1,261,835.31
交易性金融资产	-	-	-	-	18,201,214.84	18,201,214.84
应收申购款	-	-	-	-	50.00	50.00
资产总计	1,261,835.31	-	-	-	18,201,264.84	19,463,100.15
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	68,168.01	68,168.01

应付管理人报酬	-	-	-	-	20,774.77	20,774.77
应付托管费	-	-	-	-	3,462.47	3,462.47
应付销售服务费	-	-	-	-	2,444.48	2,444.48
其他负债	-	-	-	-	7,128.14	7,128.14
负债总计	-	-	-	-	101,977.87	101,977.87
利率敏感度缺口	1,261,835.31	-	-	-	18,099,286.97	19,361,122.28

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 12 月 31 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	222,782,141.66	93.80	18,201,214.84	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产 —权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	222,782,141.66	93.80	18,201,214.84	94.01

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 4.23% (2024 年 12 月 31 日 VaR 值为 4.24%)	-10,037,118.70	-820,770.52

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2024 年的分析同样基于该假设。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	219,340,634.49	18,201,214.84
第二层次	2,253,966.00	-
第三层次	1,187,541.17	-
合计	222,782,141.66	18,201,214.84

## 7.4.14.2.2 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的当年年初为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	477,843.33	477,843.33
转出第三层次	-	120,238.68	120,238.68
当期利得或损失总额	-	829,936.52	829,936.52
其中：计入损益的利得或损失	-	829,936.52	829,936.52
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,187,541.17	1,187,541.17
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	750,820.42	750,820.42
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益	-	-	-

的利得或损失			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,187,541.17	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售期内的估价的预期年化波动率	0.00%-303.23%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	222,782,141.66	91.71

	其中：股票	222,782,141.66	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,136,661.32	6.23
8	其他各项资产	5,001,815.25	2.06
9	合计	242,920,618.23	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,153,754.96	4.28
C	制造业	140,432,821.18	59.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,032,975.60	1.28
E	建筑业	2,425,413.00	1.02
F	批发和零售业	26,694.44	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,996,724.00	0.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,160,252.87	8.07
J	金融业	37,167,676.00	15.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,599,850.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	5,784,341.61	2.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,638.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	222,782,141.66	93.80

### 8.2.2 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通过港股通交易机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	29,300	10,760,718.00	4.53
2	601318	中国平安	133,600	9,138,240.00	3.85
3	601899	紫金矿业	224,400	7,735,068.00	3.26
4	000333	美的集团	72,900	5,697,135.00	2.40
5	600519	贵州茅台	3,400	4,682,412.00	1.97
6	600276	恒瑞医药	77,400	4,610,718.00	1.94
7	600030	中信证券	154,500	4,435,695.00	1.87
8	603259	药明康德	46,300	4,196,632.00	1.77
9	688041	海光信息	18,320	4,111,191.20	1.73
10	603986	兆易创新	16,300	3,492,275.00	1.47
11	600150	中国船舶	102,100	3,395,846.00	1.43
12	603799	华友钴业	49,600	3,385,696.00	1.43
13	000100	TCL 科技	737,700	3,349,158.00	1.41
14	600031	三一重工	158,100	3,340,653.00	1.41
15	601166	兴业银行	153,900	3,241,134.00	1.36
16	300308	中际旭创	5,176	3,157,360.00	1.33
17	002415	海康威视	105,600	3,151,104.00	1.33
18	600660	福耀玻璃	48,400	3,134,868.00	1.32
19	600690	海尔智家	119,300	3,112,537.00	1.31
20	002414	高德红外	209,500	3,073,365.00	1.29
21	600549	厦门钨业	74,200	3,046,652.00	1.28
22	601628	中国人寿	66,900	3,043,950.00	1.28
23	601728	中国电信	478,200	3,012,660.00	1.27
24	600941	中国移动	29,400	2,970,870.00	1.25
25	002558	巨人网络	68,000	2,943,720.00	1.24
26	600989	宝丰能源	148,700	2,918,981.00	1.23
27	601988	中国银行	502,600	2,879,898.00	1.21
28	600050	中国联通	560,300	2,863,133.00	1.21
29	000725	京东方 A	676,500	2,848,065.00	1.20
30	601328	交通银行	387,200	2,807,200.00	1.18
31	300033	同花顺	8,700	2,802,966.00	1.18
32	688111	金山办公	8,980	2,757,488.60	1.16
33	002074	国轩高科	69,800	2,729,878.00	1.15
34	601127	赛力斯	22,501	2,721,720.96	1.15
35	601658	邮储银行	489,300	2,666,685.00	1.12
36	002156	通富微电	70,000	2,639,000.00	1.11
37	600415	小商品城	163,000	2,599,850.00	1.09

38	601633	长城汽车	111,200	2,516,456.00	1.06
39	002517	恺英网络	114,200	2,497,554.00	1.05
40	002916	深南电路	10,600	2,462,274.00	1.04
41	600166	福田汽车	840,000	2,452,800.00	1.03
42	601117	中国化学	322,100	2,425,413.00	1.02
43	601319	中国人保	270,000	2,416,500.00	1.02
44	300207	欣旺达	91,600	2,395,340.00	1.01
45	002841	视源股份	60,400	2,393,652.00	1.01
46	600988	赤峰黄金	76,100	2,377,364.00	1.00
47	600011	华能国际	318,400	2,375,264.00	1.00
48	002008	大族激光	57,500	2,368,425.00	1.00
49	600482	中国动力	109,800	2,272,860.00	0.96
50	601288	农业银行	294,600	2,262,528.00	0.95
51	601636	旗滨集团	380,700	2,257,551.00	0.95
52	002049	紫光国微	28,600	2,253,966.00	0.95
53	002281	光迅科技	31,500	2,203,425.00	0.93
54	603486	科沃斯	22,300	1,799,164.00	0.76
55	688200	华峰测控	9,300	1,768,860.00	0.74
56	601138	工业富联	27,300	1,693,965.00	0.71
57	301283	聚胶股份	35,400	1,691,412.00	0.71
58	605499	东鹏饮料	6,300	1,684,557.00	0.71
59	002993	奥海科技	36,600	1,599,786.00	0.67
60	689009	九号公司	28,700	1,595,433.00	0.67
61	688612	威迈斯	48,292	1,592,187.24	0.67
62	603102	百合股份	37,000	1,589,890.00	0.67
63	301606	绿联科技	26,800	1,574,232.00	0.66
64	603444	吉比特	3,700	1,568,245.00	0.66
65	600233	圆通速递	95,500	1,568,110.00	0.66
66	002056	横店东磁	80,400	1,567,800.00	0.66
67	688772	珠海冠宇	72,500	1,560,925.00	0.66
68	301080	百普赛斯	28,800	1,555,200.00	0.65
69	300206	理邦仪器	121,100	1,548,869.00	0.65
70	001218	丽臣实业	67,000	1,526,260.00	0.64
71	688049	炬芯科技	28,791	1,514,406.60	0.64
72	300224	正海磁材	97,100	1,501,166.00	0.63
73	601963	重庆银行	136,000	1,472,880.00	0.62
74	600496	精工钢构	344,100	1,428,015.00	0.60
75	002614	奥佳华	192,900	1,410,099.00	0.59
76	600210	紫江企业	191,600	1,408,260.00	0.59
77	300502	新易盛	3,100	1,335,728.00	0.56
78	301607	富特科技	30,500	1,223,355.00	0.52
79	603019	中科曙光	10,100	864,964.00	0.36
80	601877	正泰电器	26,300	733,507.00	0.31

81	603381	永臻股份	33,300	661,338.00	0.28
82	688347	华虹公司	5,400	582,498.00	0.25
83	002602	世纪华通	31,300	533,978.00	0.22
84	600900	长江电力	16,200	440,478.00	0.19
85	002468	申通快递	31,900	428,098.00	0.18
86	300389	艾比森	25,400	412,242.00	0.17
87	600262	北方股份	15,800	411,274.00	0.17
88	688795	摩尔线程	837	348,208.74	0.15
89	688008	澜起科技	2,296	270,468.80	0.11
90	688802	沐曦股份	666	266,000.40	0.11
91	600930	华电新能	34,765	216,933.60	0.09
92	001280	中国铀业	911	41,322.96	0.02
93	301656	联合动力	1,294	32,945.24	0.01
94	688729	屹唐股份	962	23,357.36	0.01
95	301678	新恒汇	324	20,807.28	0.01
96	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
97	688809	强一股份	72	14,638.32	0.01
98	688807	优迅股份	98	13,284.88	0.01
99	301632	广东建科	558	13,213.44	0.01
100	301638	南网数字	887	12,604.27	0.01
101	688727	恒坤新材	348	12,134.76	0.01
102	301584	建发致新	447	11,988.54	0.01
103	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
104	001386	马可波罗	580	10,747.40	0.00
105	301687	新广益	189	10,279.71	0.00
106	301491	汉桑科技	182	10,030.02	0.00
107	301595	太力科技	196	9,613.80	0.00
108	688796	百奥赛图	226	9,548.50	0.00
109	301590	优优绿能	49	8,687.70	0.00
110	001221	悍高集团	152	8,654.88	0.00
111	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
112	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
113	688783	西安奕材	447	8,206.92	0.00
114	688755	汉邦科技	203	8,036.77	0.00
115	001233	海安集团	148	7,678.24	0.00
116	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
117	601026	道生天合	449	6,411.72	0.00
118	301636	泽润新能	128	6,259.20	0.00
119	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
120	603175	超颖电子	127	6,167.12	0.00
121	603049	中策橡胶	97	5,427.15	0.00
122	001369	双欣环保	392	5,052.88	0.00
123	688759	必贝特	181	4,544.91	0.00

124	603014	威高血净	114	4,517.82	0.00
125	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
126	001390	古麒绒材	178	4,353.88	0.00
127	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
128	603406	天富龙	95	3,815.20	0.00
129	600038	中直股份	100	3,613.00	0.00
130	603370	华新精科	77	3,568.95	0.00
131	603248	锡华科技	215	3,504.50	0.00
132	603382	海阳科技	105	3,385.20	0.00
133	603092	德力佳	59	3,283.94	0.00
134	603418	友升股份	52	3,071.12	0.00
135	603400	华之杰	57	2,980.53	0.00
136	001285	瑞立科密	53	2,972.24	0.00
137	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
138	000999	华润三九	100	2,846.00	0.00
139	603334	丰倍生物	86	2,822.52	0.00
140	603948	建业股份	100	2,730.00	0.00
141	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
142	000534	万泽股份	100	2,200.00	0.00
143	600737	中粮糖业	100	1,721.00	0.00
144	300251	光线传媒	100	1,638.00	0.00
145	002687	乔治白	168	809.76	0.00
146	002302	西部建设	100	612.00	0.00
147	601006	大秦铁路	100	516.00	0.00
148	600008	首创环保	100	300.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	18,046,683.00	93.21
2	600519	贵州茅台	14,883,400.00	76.87
3	601398	工商银行	13,729,875.00	70.91
4	002202	金风科技	13,231,093.50	68.34
5	688041	海光信息	12,713,740.25	65.67
6	688111	金山办公	12,434,192.89	64.22
7	600030	中信证券	11,995,230.00	61.96
8	600031	三一重工	11,583,509.00	59.83
9	601601	中国太保	11,024,499.00	56.94
10	688256	寒武纪	10,518,736.95	54.33
11	603799	华友钴业	10,504,120.00	54.25
12	300750	宁德时代	10,492,143.00	54.19
13	300573	兴齐眼药	10,037,825.20	51.85
14	300033	同花顺	9,929,371.00	51.29

15	601628	中国人寿	9,734,453.06	50.28
16	601899	紫金矿业	9,656,234.00	49.87
17	600000	浦发银行	8,961,386.10	46.29
18	601166	兴业银行	8,899,308.00	45.96
19	601633	长城汽车	8,681,144.00	44.84
20	000858	五粮液	8,643,965.08	44.65
21	601728	中国电信	8,639,273.00	44.62
22	300454	深信服	8,546,517.00	44.14
23	600050	中国联通	8,454,857.00	43.67
24	601857	中国石油	8,340,374.00	43.08
25	601288	农业银行	8,295,574.00	42.85
26	300207	欣旺达	8,272,940.00	42.73
27	600690	海尔智家	8,120,266.00	41.94
28	601658	邮储银行	8,063,961.00	41.65
29	600276	恒瑞医药	7,744,457.00	40.00
30	688772	珠海冠宇	7,679,582.38	39.66
31	600919	江苏银行	7,538,553.00	38.94
32	600150	中国船舶	7,477,621.55	38.62
33	002352	顺丰控股	7,354,860.00	37.99
34	002281	光迅科技	7,280,022.00	37.60
35	601988	中国银行	7,267,198.00	37.54
36	002938	鹏鼎控股	7,258,403.00	37.49
37	000333	美的集团	7,215,134.00	37.27
38	002594	比亚迪	7,146,969.00	36.91
39	300014	亿纬锂能	7,096,618.00	36.65
40	002714	牧原股份	7,016,900.00	36.24
41	600482	中国动力	6,508,186.00	33.61
42	688049	炬芯科技	6,299,003.44	32.53
43	002475	立讯精密	6,284,008.00	32.46
44	002517	恺英网络	6,004,411.00	31.01
45	600166	福田汽车	5,973,499.00	30.85
46	002920	德赛西威	5,948,143.00	30.72
47	600219	南山铝业	5,859,494.00	30.26
48	600196	复星医药	5,841,046.00	30.17
49	300274	阳光电源	5,797,091.40	29.94
50	300054	鼎龙股份	5,786,817.00	29.89
51	601328	交通银行	5,744,449.00	29.67
52	600660	福耀玻璃	5,715,141.00	29.52
53	688608	恒玄科技	5,669,270.19	29.28
54	603259	药明康德	5,626,763.00	29.06
55	603486	科沃斯	5,619,191.00	29.02
56	688019	安集科技	5,613,052.23	28.99
57	002415	海康威视	5,470,375.00	28.25

58	002230	科大讯飞	5,417,195.00	27.98
59	000725	京东方 A	5,385,957.00	27.82
60	002185	华天科技	5,384,006.00	27.81
61	600160	巨化股份	5,284,430.10	27.29
62	688696	极米科技	5,278,911.76	27.27
63	603444	吉比特	5,260,140.41	27.17
64	601319	中国人保	5,211,166.00	26.92
65	600988	赤峰黄金	5,152,712.00	26.61
66	601939	建设银行	5,119,468.00	26.44
67	300206	理邦仪器	5,066,485.00	26.17
68	000932	华菱钢铁	5,015,646.00	25.91
69	600176	中国巨石	4,997,023.00	25.81
70	002803	吉宏股份	4,983,547.00	25.74
71	300224	正海磁材	4,770,226.25	24.64
72	000651	格力电器	4,680,439.00	24.17
73	002396	星网锐捷	4,624,053.00	23.88
74	002258	利尔化学	4,536,843.00	23.43
75	689009	九号公司	4,504,959.59	23.27
76	000338	潍柴动力	4,455,672.00	23.01
77	600183	生益科技	4,451,634.00	22.99
78	603588	高能环境	4,447,192.00	22.97
79	600027	华电国际	4,424,249.00	22.85
80	300433	蓝思科技	4,421,238.00	22.84
81	600498	烽火通信	4,387,319.00	22.66
82	600941	中国移动	4,371,427.00	22.58
83	300251	光线传媒	4,363,276.00	22.54
84	000100	TCL 科技	4,340,824.00	22.42
85	601766	中国中车	4,304,632.00	22.23
86	688120	华海清科	4,301,498.16	22.22
87	002558	巨人网络	4,291,181.00	22.16
88	300408	三环集团	4,259,580.00	22.00
89	002463	沪电股份	4,182,882.00	21.60
90	002648	卫星化学	4,182,103.00	21.60
91	300124	汇川技术	4,174,824.00	21.56
92	600233	圆通速递	4,151,506.00	21.44
93	002056	横店东磁	4,121,859.00	21.29
94	600938	中国海油	4,036,264.00	20.85
95	600011	华能国际	3,999,411.00	20.66
96	002001	新 和 成	3,995,580.82	20.64
97	002821	凯莱英	3,995,110.00	20.63
98	000528	柳工	3,897,873.00	20.13
99	601111	中国国航	3,883,075.00	20.06
100	002008	大族激光	3,866,479.00	19.97

101	688200	华峰测控	3,842,671.49	19.85
102	600089	特变电工	3,819,897.40	19.73
103	688015	交控科技	3,805,765.95	19.66
104	300002	神州泰岳	3,751,606.00	19.38
105	601966	玲珑轮胎	3,694,917.00	19.08
106	600378	昊华科技	3,680,200.00	19.01
107	300308	中际旭创	3,637,251.88	18.79
108	002080	中材科技	3,630,002.02	18.75
109	603993	洛阳钼业	3,623,237.00	18.71
110	300496	中科创达	3,547,592.00	18.32
111	000625	长安汽车	3,543,664.00	18.30
112	300138	晨光生物	3,519,826.00	18.18
113	002468	申通快递	3,515,785.00	18.16
114	000600	建投能源	3,480,431.00	17.98
115	000708	中信特钢	3,470,420.00	17.92
116	603296	华勤技术	3,429,659.00	17.71
117	603501	豪威集团	3,351,663.00	17.31
118	600547	山东黄金	3,348,332.00	17.29
119	603986	兆易创新	3,309,761.00	17.09
120	603893	瑞芯微	3,305,603.00	17.07
121	601668	中国建筑	3,287,096.00	16.98
122	000001	平安银行	3,217,115.00	16.62
123	603529	爱玛科技	3,190,995.00	16.48
124	002074	国轩高科	3,187,780.00	16.46
125	000039	中集集团	3,163,581.00	16.34
126	601138	工业富联	3,163,400.77	16.34
127	600415	小商品城	3,161,803.00	16.33
128	600782	新钢股份	3,160,287.00	16.32
129	601127	赛力斯	3,144,955.32	16.24
130	002138	顺络电子	3,135,305.00	16.19
131	600060	海信视像	3,133,146.00	16.18
132	600016	民生银行	3,131,870.00	16.18
133	688372	伟测科技	3,119,380.44	16.11
134	601168	西部矿业	3,047,658.00	15.74
135	002156	通富微电	3,034,853.00	15.67
136	300662	科锐国际	3,009,365.00	15.54
137	301109	军信股份	3,003,214.00	15.51
138	000063	中兴通讯	3,002,434.00	15.51
139	605499	东鹏饮料	2,994,694.00	15.47
140	300476	胜宏科技	2,959,381.00	15.29
141	600406	国电南瑞	2,949,783.00	15.24
142	002414	高德红外	2,928,481.00	15.13
143	600111	北方稀土	2,915,298.00	15.06

144	002049	紫光国微	2,874,277.00	14.85
145	601179	中国西电	2,857,128.00	14.76
146	603102	百合股份	2,852,646.00	14.73
147	601298	青岛港	2,849,294.00	14.72
148	002384	东山精密	2,814,848.00	14.54
149	688012	中微公司	2,804,368.01	14.48
150	603288	海天味业	2,769,201.00	14.30
151	000938	紫光股份	2,766,018.00	14.29
152	603341	龙旗科技	2,765,740.00	14.29
153	601636	旗滨集团	2,765,719.00	14.28
154	600989	宝丰能源	2,752,897.00	14.22
155	603113	金能科技	2,748,463.00	14.20
156	002410	广联达	2,682,356.00	13.85
157	300627	华测导航	2,673,915.00	13.81
158	601963	重庆银行	2,672,822.00	13.81
159	601233	桐昆股份	2,661,896.00	13.75
160	600549	厦门钨业	2,636,454.00	13.62
161	300866	安克创新	2,617,949.75	13.52
162	300003	乐普医疗	2,587,466.00	13.36
163	002967	广电计量	2,576,395.00	13.31
164	300347	泰格医药	2,554,709.00	13.20
165	603518	锦泓集团	2,553,605.00	13.19
166	601688	华泰证券	2,540,520.00	13.12
167	000988	华工科技	2,533,746.00	13.09
168	601117	中国化学	2,531,659.00	13.08
169	000661	长春高新	2,518,745.20	13.01
170	603659	璞泰来	2,492,866.00	12.88
171	301283	聚胶股份	2,487,436.00	12.85
172	002916	深南电路	2,477,618.86	12.80
173	601989	中国重工	2,475,431.00	12.79
174	002250	联化科技	2,448,266.00	12.65
175	601609	金田股份	2,444,477.00	12.63
176	002028	思源电气	2,429,776.00	12.55
177	688002	睿创微纳	2,421,475.28	12.51
178	600961	株冶集团	2,419,994.00	12.50
179	600039	四川路桥	2,392,951.00	12.36
180	002845	同兴达	2,385,279.00	12.32
181	000975	山金国际	2,345,227.00	12.11
182	002841	视源股份	2,341,085.00	12.09
183	002555	三七互娱	2,301,318.00	11.89
184	603979	金诚信	2,280,879.00	11.78
185	688095	福昕软件	2,278,608.19	11.77
186	300389	艾比森	2,274,333.00	11.75

187	688063	派能科技	2,258,759.45	11.67
188	600718	东软集团	2,212,778.00	11.43
189	600699	均胜电子	2,198,467.00	11.36
190	002385	大北农	2,189,376.00	11.31
191	600885	宏发股份	2,186,203.00	11.29
192	002171	楚江新材	2,174,251.00	11.23
193	688162	巨一科技	2,161,771.12	11.17
194	002180	纳思达	2,119,518.00	10.95
195	603678	火炬电子	2,108,121.00	10.89
196	605117	德业股份	2,106,954.00	10.88
197	300604	长川科技	2,105,184.00	10.87
198	000893	亚钾国际	2,099,709.00	10.84
199	300502	新易盛	2,090,394.00	10.80
200	600703	三安光电	2,064,002.00	10.66
201	002334	英威腾	2,059,119.00	10.64
202	601579	会稽山	2,056,977.00	10.62
203	300705	九典制药	2,019,634.00	10.43
204	603408	建霖家居	2,019,553.00	10.43
205	002212	天融信	2,006,164.00	10.36
206	601155	新城控股	1,994,257.00	10.30
207	600216	浙江医药	1,980,763.00	10.23
208	600269	赣粤高速	1,966,366.00	10.16
209	601567	三星医疗	1,938,911.00	10.01
210	603995	甬金股份	1,933,474.00	9.99
211	300059	东方财富	1,916,376.00	9.90
212	688313	仕佳光子	1,915,048.21	9.89
213	000977	浪潮信息	1,911,879.00	9.87
214	600143	金发科技	1,909,933.00	9.86
215	300772	运达股份	1,877,127.00	9.70
216	300973	立高食品	1,856,177.00	9.59
217	600866	星湖科技	1,849,670.00	9.55
218	688410	山外山	1,783,796.30	9.21
219	600496	精工钢构	1,782,018.00	9.20
220	002588	史丹利	1,760,461.00	9.09
221	300395	菲利华	1,759,130.00	9.09
222	002241	歌尔股份	1,694,314.00	8.75
223	603129	春风动力	1,690,573.00	8.73
224	600900	长江电力	1,687,020.00	8.71
225	600998	九州通	1,677,991.00	8.67
226	301606	绿联科技	1,668,842.44	8.62
227	601208	东材科技	1,662,898.00	8.59
228	000800	一汽解放	1,657,878.00	8.56
229	601333	广深铁路	1,643,154.00	8.49

230	000778	新兴铸管	1,635,231.00	8.45
231	002993	奥海科技	1,631,248.00	8.43
232	002997	瑞鹄模具	1,614,861.00	8.34
233	688232	新点软件	1,604,917.56	8.29
234	000915	华特达因	1,602,635.00	8.28
235	301080	百普赛斯	1,599,585.00	8.26
236	300602	飞荣达	1,599,367.00	8.26
237	000534	万泽股份	1,597,103.00	8.25
238	603267	鸿远电子	1,594,624.00	8.24
239	688080	映翰通	1,588,806.86	8.21
240	600970	中材国际	1,587,415.00	8.20
241	000415	渤海租赁	1,576,750.00	8.14
242	688612	威迈斯	1,575,678.37	8.14
243	601229	上海银行	1,571,045.54	8.11
244	603236	移远通信	1,567,392.00	8.10
245	603833	欧派家居	1,561,095.00	8.06
246	688700	东威科技	1,543,098.22	7.97
247	688122	西部超导	1,533,308.90	7.92
248	688270	臻镭科技	1,530,313.15	7.90
249	001218	丽臣实业	1,526,755.00	7.89
250	002142	宁波银行	1,521,996.00	7.86
251	301607	富特科技	1,508,912.00	7.79
252	603160	汇顶科技	1,505,546.00	7.78
253	688146	中船特气	1,503,068.23	7.76
254	600395	盘江股份	1,495,061.00	7.72
255	002010	传化智联	1,492,039.00	7.71
256	000921	海信家电	1,491,838.00	7.71
257	603876	鼎胜新材	1,491,251.60	7.70
258	000676	智度股份	1,490,650.00	7.70
259	301381	赛维时代	1,487,125.00	7.68
260	002511	中顺洁柔	1,485,184.00	7.67
261	000990	诚志股份	1,482,260.00	7.66
262	688403	汇成股份	1,471,030.74	7.60
263	000050	深天马 A	1,469,804.00	7.59
264	600887	伊利股份	1,468,638.00	7.59
265	000877	天山股份	1,468,415.00	7.58
266	601098	中南传媒	1,462,375.00	7.55
267	600282	南钢股份	1,458,599.00	7.53
268	601211	国泰海通	1,447,911.00	7.48
269	603766	隆鑫通用	1,447,018.00	7.47
270	603898	好莱客	1,437,778.00	7.43
271	601077	渝农商行	1,436,769.00	7.42
272	603103	横店影视	1,433,209.00	7.40

273	600685	中船防务	1,430,232.00	7.39
274	000902	新洋丰	1,416,857.00	7.32
275	002614	奥佳华	1,414,070.00	7.30
276	600210	紫江企业	1,410,699.00	7.29
277	603713	密尔克卫	1,403,016.00	7.25
278	688008	澜起科技	1,400,259.15	7.23
279	300953	震裕科技	1,396,060.75	7.21
280	600141	兴发集团	1,388,325.00	7.17
281	688526	科前生物	1,384,985.95	7.15
282	601665	齐鲁银行	1,375,041.00	7.10
283	002487	大金重工	1,372,250.00	7.09
284	600578	京能电力	1,362,724.00	7.04
285	605589	圣泉集团	1,350,961.00	6.98
286	688378	奥来德	1,348,335.05	6.96
287	600298	安琪酵母	1,298,950.00	6.71
288	300972	万辰集团	1,289,796.00	6.66
289	000657	中钨高新	1,281,797.00	6.62
290	688385	复旦微电	1,255,243.11	6.48
291	688291	金橙子	1,253,969.46	6.48
292	002050	三花智控	1,252,796.00	6.47
293	000400	许继电气	1,246,491.00	6.44
294	688005	容百科技	1,245,374.29	6.43
295	600028	中国石化	1,216,271.00	6.28
296	002850	科达利	1,206,779.00	6.23
297	688099	晶晨股份	1,196,892.91	6.18
298	605138	盛泰集团	1,181,816.00	6.10
299	002299	圣农发展	1,152,351.00	5.95
300	000729	燕京啤酒	1,151,272.00	5.95
301	002345	潮宏基	1,070,562.00	5.53
302	300048	合康新能	1,063,233.00	5.49
303	600872	中炬高新	967,553.00	5.00
304	603379	三美股份	958,763.00	4.95
305	002266	浙富控股	928,109.00	4.79
306	301018	申菱环境	927,347.00	4.79
307	002912	中新赛克	916,488.00	4.73
308	002906	华阳集团	910,120.00	4.70
309	600963	岳阳林纸	898,963.00	4.64
310	601880	辽港股份	873,942.00	4.51
311	603019	中科曙光	863,878.00	4.46
312	688617	惠泰医疗	801,698.14	4.14
313	300409	道氏技术	759,180.00	3.92
314	601877	正泰电器	732,315.00	3.78
315	300888	稳健医疗	704,034.51	3.64

316	600879	航天电子	691,583.00	3.57
317	603381	永臻股份	662,616.00	3.42
318	600489	中金黄金	655,786.00	3.39
319	002991	甘源食品	632,202.00	3.27
320	688600	皖仪科技	623,153.81	3.22
321	688123	聚辰股份	619,983.25	3.20
322	688072	拓荆科技	603,013.77	3.11
323	600258	首旅酒店	585,699.00	3.03
324	688347	华虹公司	585,347.81	3.02
325	002602	世纪华通	536,362.00	2.77
326	688981	中芯国际	530,430.32	2.74
327	000959	首钢股份	496,272.00	2.56
328	000425	徐工机械	471,850.00	2.44
329	002322	理工能科	466,088.00	2.41
330	603167	渤海轮渡	421,489.00	2.18
331	600262	北方股份	395,032.00	2.04

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002202	金风科技	14,900,166.47	76.96
2	601398	工商银行	14,212,990.00	73.41
3	601318	中国平安	11,147,845.60	57.58
4	601601	中国太保	11,112,169.00	57.39
5	300573	兴齐眼药	10,973,074.52	56.68
6	688256	寒武纪	10,724,875.35	55.39
7	603799	华友钴业	9,680,715.00	50.00
8	688041	海光信息	9,407,975.21	48.59
9	688111	金山办公	9,347,780.96	48.28
10	300454	深信服	9,079,766.00	46.90
11	600000	浦发银行	8,998,679.86	46.48
12	600519	贵州茅台	8,903,421.00	45.99
13	600031	三一重工	8,704,037.00	44.96
14	000858	五粮液	8,480,635.02	43.80
15	601857	中国石油	8,440,670.00	43.60
16	600030	中信证券	8,077,578.00	41.72
17	002938	鹏鼎控股	7,870,988.00	40.65
18	002714	牧原股份	7,623,235.00	39.37
19	002352	顺丰控股	7,115,988.50	36.75
20	600919	江苏银行	7,080,876.00	36.57
21	300014	亿纬锂能	7,072,799.00	36.53
22	002920	德赛西威	6,992,861.00	36.12
23	601628	中国人寿	6,719,633.00	34.71

24	002475	立讯精密	6,626,308.00	34.22
25	601288	农业银行	6,504,460.00	33.60
26	300054	鼎龙股份	6,401,247.00	33.06
27	300033	同花顺	6,322,758.00	32.66
28	002594	比亚迪	6,294,208.00	32.51
29	688019	安集科技	6,266,924.92	32.37
30	300274	阳光电源	6,152,570.40	31.78
31	300207	欣旺达	6,070,556.49	31.35
32	600160	巨化股份	6,068,656.00	31.34
33	688772	珠海冠宇	5,894,541.28	30.45
34	601899	紫金矿业	5,880,011.00	30.37
35	600183	生益科技	5,864,901.00	30.29
36	600196	复星医药	5,831,388.00	30.12
37	600219	南山铝业	5,744,641.00	29.67
38	600176	中国巨石	5,722,547.00	29.56
39	002281	光迅科技	5,680,476.00	29.34
40	601166	兴业银行	5,630,118.00	29.08
41	688608	恒玄科技	5,614,086.80	29.00
42	002230	科大讯飞	5,582,683.00	28.83
43	601633	长城汽车	5,563,719.00	28.74
44	601658	邮储银行	5,481,938.00	28.31
45	688120	华海清科	5,429,568.76	28.04
46	601939	建设银行	5,401,970.00	27.90
47	688696	极米科技	5,251,284.75	27.12
48	600050	中国联通	5,215,391.00	26.94
49	000932	华菱钢铁	5,144,088.00	26.57
50	002396	星网锐捷	5,074,081.00	26.21
51	002185	华天科技	5,010,974.00	25.88
52	601728	中国电信	5,004,726.00	25.85
53	002803	吉宏股份	4,956,578.00	25.60
54	688049	炬芯科技	4,873,093.61	25.17
55	000651	格力电器	4,823,800.00	24.91
56	601988	中国银行	4,752,175.00	24.54
57	002258	利尔化学	4,725,472.00	24.41
58	300251	光线传媒	4,647,796.00	24.01
59	600690	海尔智家	4,585,029.00	23.68
60	601766	中国中车	4,532,283.00	23.41
61	603588	高能环境	4,529,618.00	23.40
62	002001	新和成	4,495,353.49	23.22
63	600027	华电国际	4,470,210.00	23.09
64	600498	烽火通信	4,425,758.00	22.86
65	002463	沪电股份	4,391,549.00	22.68
66	600089	特变电工	4,286,133.00	22.14

67	002821	凯莱英	4,272,809.00	22.07
68	000528	柳工	4,255,871.00	21.98
69	300124	汇川技术	4,173,882.00	21.56
70	000338	潍柴动力	4,121,484.00	21.29
71	600938	中国海油	4,115,054.00	21.25
72	002080	中材科技	4,096,908.00	21.16
73	600482	中国动力	4,069,398.00	21.02
74	601111	中国国航	4,054,992.00	20.94
75	603486	科沃斯	4,046,840.25	20.90
76	600150	中国船舶	4,041,836.39	20.88
77	688015	交控科技	4,015,682.69	20.74
78	002517	恺英网络	4,012,218.00	20.72
79	300433	蓝思科技	3,984,089.00	20.58
80	601609	金田股份	3,924,118.94	20.27
81	603993	洛阳钼业	3,910,172.00	20.20
82	603444	吉比特	3,900,493.00	20.15
83	600166	福田汽车	3,873,154.00	20.00
84	600547	山东黄金	3,859,723.00	19.94
85	300408	三环集团	3,835,942.00	19.81
86	002648	卫星化学	3,817,190.00	19.72
87	300496	中科创达	3,814,719.00	19.70
88	688372	伟测科技	3,785,072.86	19.55
89	600378	昊华科技	3,759,145.00	19.42
90	000988	华工科技	3,757,750.00	19.41
91	603296	华勤技术	3,726,272.00	19.25
92	000600	建投能源	3,692,746.00	19.07
93	300138	晨光生物	3,652,931.00	18.87
94	300206	理邦仪器	3,579,522.00	18.49
95	000625	长安汽车	3,562,112.00	18.40
96	000001	平安银行	3,511,690.00	18.14
97	000708	中信特钢	3,423,138.00	17.68
98	002138	顺络电子	3,304,960.00	17.07
99	300750	宁德时代	3,255,177.00	16.81
100	002967	广电计量	3,245,122.00	16.76
101	600111	北方稀土	3,232,044.74	16.69
102	601668	中国建筑	3,229,794.00	16.68
103	603893	瑞芯微	3,225,752.00	16.66
104	300002	神州泰岳	3,214,034.00	16.60
105	300224	正海磁材	3,187,676.00	16.46
106	300476	胜宏科技	3,183,723.00	16.44
107	600782	新钢股份	3,150,945.00	16.27
108	600060	海信视像	3,145,105.00	16.24
109	603659	璞泰来	3,143,851.00	16.24

110	600406	国电南瑞	3,120,551.00	16.12
111	601319	中国人保	3,105,321.00	16.04
112	000063	中兴通讯	3,098,529.43	16.00
113	600016	民生银行	3,046,439.00	15.73
114	601966	玲珑轮胎	3,033,870.00	15.67
115	601179	中国西电	3,025,644.00	15.63
116	603501	豪威集团	3,021,210.00	15.60
117	689009	九号公司	3,009,755.52	15.55
118	600276	恒瑞医药	2,997,294.00	15.48
119	002384	东山精密	2,991,567.00	15.45
120	603529	爱玛科技	2,987,219.00	15.43
121	301109	军信股份	2,968,683.80	15.33
122	002468	申通快递	2,964,696.00	15.31
123	603341	龙旗科技	2,963,341.68	15.31
124	000039	中集集团	2,961,229.00	15.29
125	603259	药明康德	2,952,115.00	15.25
126	600988	赤峰黄金	2,932,285.00	15.15
127	601233	桐昆股份	2,929,527.00	15.13
128	603113	金能科技	2,925,468.00	15.11
129	688012	中微公司	2,923,662.79	15.10
130	300662	科锐国际	2,908,884.00	15.02
131	600660	福耀玻璃	2,886,326.00	14.91
132	601328	交通银行	2,885,252.00	14.90
133	002028	思源电气	2,881,069.00	14.88
134	601298	青岛港	2,845,139.00	14.70
135	601168	西部矿业	2,833,690.35	14.64
136	002410	广联达	2,821,454.00	14.57
137	000893	亚钾国际	2,762,847.00	14.27
138	000975	山金国际	2,696,901.16	13.93
139	002555	三七互娱	2,682,455.00	13.85
140	600233	圆通速递	2,668,226.00	13.78
141	688002	睿创微纳	2,656,112.08	13.72
142	600961	株冶集团	2,641,390.00	13.64
143	601989	中国重工	2,638,204.44	13.63
144	000725	京东方 A	2,591,912.00	13.39
145	603288	海天味业	2,566,983.36	13.26
146	000938	紫光股份	2,539,058.00	13.11
147	688095	福昕软件	2,511,631.41	12.97
148	300627	华测导航	2,505,824.00	12.94
149	688200	华峰测控	2,443,405.75	12.62
150	300347	泰格医药	2,416,076.00	12.48
151	601579	会稽山	2,399,389.00	12.39
152	300003	乐普医疗	2,388,408.00	12.34

153	002415	海康威视	2,384,536.00	12.32
154	600699	均胜电子	2,352,151.00	12.15
155	300866	安克创新	2,345,657.00	12.12
156	600143	金发科技	2,343,601.00	12.10
157	688313	仕佳光子	2,331,712.40	12.04
158	688063	派能科技	2,327,523.67	12.02
159	603518	锦泓集团	2,324,641.00	12.01
160	605117	德业股份	2,320,130.60	11.98
161	600718	东软集团	2,301,200.00	11.89
162	600039	四川路桥	2,298,290.00	11.87
163	002180	纳思达	2,298,103.00	11.87
164	601688	华泰证券	2,296,648.00	11.86
165	300604	长川科技	2,285,646.00	11.81
166	603979	金诚信	2,283,636.00	11.79
167	688162	巨一科技	2,264,545.00	11.70
168	600885	宏发股份	2,260,819.00	11.68
169	002250	联化科技	2,257,963.00	11.66
170	002845	同兴达	2,218,529.00	11.46
171	600216	浙江医药	2,198,364.00	11.35
172	000977	浪潮信息	2,162,496.00	11.17
173	300059	东方财富	2,157,385.00	11.14
174	000661	长春高新	2,112,831.00	10.91
175	002385	大北农	2,111,923.00	10.91
176	600866	星湖科技	2,089,021.00	10.79
177	601567	三星医疗	2,070,386.00	10.69
178	600703	三安光电	2,067,516.00	10.68
179	002056	横店东磁	2,061,976.00	10.65
180	002171	楚江新材	2,060,962.00	10.64
181	603678	火炬电子	1,995,922.00	10.31
182	603408	建霖家居	1,985,472.00	10.25
183	603995	甬金股份	1,978,552.00	10.22
184	300705	九典制药	1,953,772.00	10.09
185	002212	天融信	1,922,731.00	9.93
186	600269	赣粤高速	1,919,165.00	9.91
187	601155	新城控股	1,911,374.00	9.87
188	300772	运达股份	1,904,683.00	9.84
189	601208	东材科技	1,899,769.00	9.81
190	300395	菲利华	1,894,242.00	9.78
191	688122	西部超导	1,891,243.46	9.77
192	002588	史丹利	1,886,695.00	9.74
193	688291	金橙子	1,850,407.58	9.56
194	000333	美的集团	1,782,939.00	9.21
195	002334	英威腾	1,775,914.00	9.17

196	688410	山外山	1,764,114.00	9.11
197	002050	三花智控	1,756,127.00	9.07
198	002008	大族激光	1,751,729.00	9.05
199	000534	万泽股份	1,743,583.00	9.01
200	002010	传化智联	1,726,294.87	8.92
201	000877	天山股份	1,720,801.00	8.89
202	688146	中船特气	1,699,051.30	8.78
203	300389	艾比森	1,692,994.00	8.74
204	600998	九州通	1,686,212.00	8.71
205	600011	华能国际	1,682,633.00	8.69
206	002997	瑞鹄模具	1,674,135.00	8.65
207	600970	中材国际	1,669,169.00	8.62
208	000800	一汽解放	1,663,122.00	8.59
209	603236	移远通信	1,655,247.00	8.55
210	688700	东威科技	1,652,166.57	8.53
211	002558	巨人网络	1,641,202.00	8.48
212	603833	欧派家居	1,639,653.00	8.47
213	603103	横店影视	1,635,170.00	8.45
214	600141	兴发集团	1,634,155.67	8.44
215	603129	春风动力	1,625,600.00	8.40
216	000415	渤海租赁	1,622,731.00	8.38
217	601211	国泰海通	1,615,188.00	8.34
218	300973	立高食品	1,603,818.00	8.28
219	000050	深天马 A	1,595,109.00	8.24
220	603876	鼎胜新材	1,575,556.09	8.14
221	603267	鸿远电子	1,558,856.00	8.05
222	603898	好莱客	1,551,519.00	8.01
223	000915	华特达因	1,546,885.00	7.99
224	002487	大金重工	1,543,657.00	7.97
225	688008	澜起科技	1,540,286.04	7.96
226	688270	臻镭科技	1,539,523.51	7.95
227	603160	汇顶科技	1,534,762.00	7.93
228	688526	科前生物	1,528,768.37	7.90
229	000778	新兴铸管	1,526,734.00	7.89
230	600282	南钢股份	1,517,248.00	7.84
231	300602	飞荣达	1,514,001.00	7.82
232	002511	中顺洁柔	1,511,521.00	7.81
233	601333	广深铁路	1,510,510.00	7.80
234	002241	歌尔股份	1,490,478.00	7.70
235	301381	赛维时代	1,489,527.00	7.69
236	600395	盘江股份	1,485,648.00	7.67
237	688080	映翰通	1,484,749.82	7.67
238	002142	宁波银行	1,482,515.00	7.66

239	603713	密尔克卫	1,466,896.00	7.58
240	600887	伊利股份	1,454,584.00	7.51
241	688378	奥来德	1,449,048.29	7.48
242	601098	中南传媒	1,437,347.00	7.42
243	000990	诚志股份	1,436,885.00	7.42
244	688232	新点软件	1,434,849.20	7.41
245	600685	中船防务	1,432,079.00	7.40
246	000902	新洋丰	1,422,929.00	7.35
247	601077	渝农商行	1,412,921.00	7.30
248	300953	震裕科技	1,408,634.00	7.28
249	603766	隆鑫通用	1,404,651.00	7.26
250	600578	京能电力	1,393,465.00	7.20
251	000921	海信家电	1,375,305.00	7.10
252	000676	智度股份	1,373,839.00	7.10
253	605138	盛泰集团	1,371,741.00	7.09
254	600298	安琪酵母	1,354,953.00	7.00
255	000100	TCL 科技	1,349,247.00	6.97
256	002850	科达利	1,337,838.00	6.91
257	000657	中钨高新	1,335,439.00	6.90
258	601229	上海银行	1,327,443.00	6.86
259	601138	工业富联	1,326,273.00	6.85
260	688403	汇成股份	1,324,365.09	6.84
261	300972	万辰集团	1,316,367.00	6.80
262	605589	圣泉集团	1,311,452.00	6.77
263	688099	晶晨股份	1,305,318.40	6.74
264	688385	复旦微电	1,301,941.34	6.72
265	601665	齐鲁银行	1,293,586.00	6.68
266	000400	许继电气	1,284,413.00	6.63
267	603102	百合股份	1,281,672.00	6.62
268	002299	圣农发展	1,218,032.00	6.29
269	601963	重庆银行	1,206,276.00	6.23
270	600941	中国移动	1,184,381.00	6.12
271	688005	容百科技	1,175,236.64	6.07
272	600028	中国石化	1,169,339.00	6.04
273	300048	合康新能	1,168,355.00	6.03
274	300308	中际旭创	1,158,763.00	5.98
275	605499	东鹏饮料	1,153,263.00	5.96
276	600900	长江电力	1,147,238.00	5.93
277	002345	潮宏基	1,145,710.00	5.92
278	000729	燕京啤酒	1,134,053.00	5.86
279	603379	三美股份	1,003,867.00	5.18
280	002266	浙富控股	980,735.00	5.07
281	301283	聚胶股份	959,430.00	4.96

282	600963	岳阳林纸	953,931.00	4.93
283	002906	华阳集团	951,889.00	4.92
284	601880	辽港股份	933,590.00	4.82
285	600872	中炬高新	931,446.00	4.81
286	002912	中新赛克	845,355.00	4.37
287	301018	申菱环境	828,252.00	4.28
288	600489	中金黄金	825,411.00	4.26
289	688617	惠泰医疗	804,591.65	4.16
290	300409	道氏技术	788,619.00	4.07
291	300502	新易盛	755,207.00	3.90
292	688072	拓荆科技	695,142.13	3.59
293	002991	甘源食品	678,397.00	3.50
294	300888	稳健医疗	659,295.00	3.41
295	688123	聚辰股份	634,609.00	3.28
296	600879	航天电子	634,398.00	3.28
297	688252	天德钰	600,179.90	3.10
298	600258	首旅酒店	599,459.00	3.10
299	688600	皖仪科技	598,603.34	3.09
300	002049	紫光国微	560,167.00	2.89
301	688981	中芯国际	521,939.81	2.70
302	000959	首钢股份	515,642.00	2.66
303	000425	徐工机械	503,545.00	2.60
304	002322	理工能科	486,718.00	2.51
305	300761	立华股份	431,088.00	2.23
306	603167	渤海轮渡	423,171.00	2.19
307	601127	赛力斯	421,407.00	2.18
308	002376	新北洋	409,620.00	2.12
309	600496	精工钢构	408,028.00	2.11
310	601636	旗滨集团	387,725.00	2.00

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,151,373,579.05
卖出股票收入（成交）总额	985,184,410.54

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

**8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,001,815.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,001,815.25

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
长信汇智量化选股混合 A	135	321,103.95	40,572,809.73	93.60	2,776,223.35	6.40
长信汇智量化选股混合 C	142	272,254.84	36,631,971.94	94.75	2,028,214.97	5.25
长信汇智量化选股混合 E	23	5,262,315.13	121,001,816.87	99.97	31,431.16	0.03
合计	300	676,808.23	198,206,598.54	97.62	4,835,869.48	2.38

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信汇智量化选股混合 A	68,531.38	0.16
	长信汇智量化选股混合 C	0.00	0.00
	长信汇智量化选股混合 E	0.00	0.00
	合计	68,531.38	0.03

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信汇智量化选股混合 A	0~10
	长信汇智量化选股混合 C	0
	长信汇智量化选股混合 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长信汇智量化选股混合 A	0~10
	长信汇智量化选股混合 C	0
	长信汇智量化选股混合 E	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信汇智量化选股混合 A	长信汇智量化选股混合 C	长信汇智量化选股混合 E
基金合同生效日（2023 年 11 月 28 日）基金份额总额	98,729,354.51	135,494,973.10	-
本报告期期初基金份额总额	13,685,147.73	7,316,691.07	-
本报告期基金总申购份额	65,891,501.81	178,481,023.94	121,136,232.85
减：本报告期基金总赎回份额	36,227,616.46	147,137,528.10	102,984.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	43,349,033.08	38,660,186.91	121,033,248.03

注：长信汇智量化选股混合型证券投资基金 E 类份额增加日为 2025 年 5 月 30 日。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人于 2024 年 12 月 31 日 0:00 起至 2025 年 2 月 4 日 17:00 期间以通讯方式召开了长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于持续运作长信汇智量化选股混合型证券投资基金并修改基金合同的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计 11,623,274.90 份，占权益登记日该基金总份额的 55.34%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的 99.02%，本次会议议案于 2025 年 2 月 5 日获得通过，基

金管理人已于 2025 年 2 月 7 日在规定信息披露媒介及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

## 11.2 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

### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2025 年 1 月 24 日起，邓挺先生不再担任公司副总经理。

自 2025 年 4 月 18 日起，沈伟担任公司首席信息官。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 25,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 2 年。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受监管部门调查或处罚的情形。

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例 (%)		(%)	
国信证券	2	2,133,574,809.28	100.00	930,167.55	100.00	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告（2024）3号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

### （1）选择标准：

- 1) 财务状况良好；
- 2) 经营行为规范；
- 3) 合规风控能力较强；
- 4) 交易能力较强；
- 5) 研究能力较强。

### （2）选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自2024年7月1日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

## 11.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	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比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 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	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-4
2	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子	2025-1-10

		披露网站、公司网站	
3	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
5	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-25
6	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-2-7
7	长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-2-7
8	长信汇智量化选股混合型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-2-7
9	长信汇智量化选股混合型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-2-7
10	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-2-7
11	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-18
12	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-21
13	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-24
14	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金 C 类基金份额销售费率优惠活动结束的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-26
15	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
16	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
17	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-31
18	长信基金管理有限责任公司关于基金行	上证报、中国证监会电子披	2025-4-19

	业高级管理人员变更公告	露网站、公司网站	
19	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
20	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加招商银行费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-26
22	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金增设 E 类基金份额及调整管理费率并修改基金合同等相关事项的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
23	长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
24	长信汇智量化选股混合型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
25	长信汇智量化选股混合型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
26	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
27	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金 E 类基金份额净值计算与披露方法的说明	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
28	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-28
29	长信基金管理有限责任公司关于长信汇智量化选股混合型证券投资基金费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-30
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-6-6
31	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-7-21
32	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-7-21
33	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-8-29
34	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-8-29
35	长信基金管理有限责任公司关于旗下基	上证报、中国证监会电子披	2025-9-5

	金持有的停牌股票调整估值方法的公告	露网站、公司网站	
36	长信汇智量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-10-28
37	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-10-28
38	长信基金管理有限责任公司关于增加中原证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-11-20
39	长信汇智量化选股混合型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-11-28
40	长信基金管理有限责任公司关于增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-12-1

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	2025 年 3 月 18 日至 2025 年 6 月 18 日; 2025 年 7 月 21 日至 2025 年 11 月 25 日	0.00	51,459,681.56	21,000,000.00	30,459,681.56	15.00

#### 产品特有风险

##### 1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

##### 2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

##### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信汇智量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信汇智量化选股混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信汇智量化选股混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2026年3月30日