

景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF） 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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
§ 5 托管人报告	12
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 盈利投资者数量占比	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	47
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	景顺长城鼎益混合（LOF）	
场内简称	景顺鼎益 LOF	
基金主代码	162605	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2005 年 3 月 16 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
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	3,601,296,405.30 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2005 年 5 月 25 日	
下属分级基金的基金简称	景顺长城鼎益混合（LOF）A	景顺长城鼎益混合（LOF）C
下属分级基金的场内简称	景顺鼎益 LOF	—
下属分级基金的交易代码	162605	018600
报告期末下属分级基金的份额总额	3,408,527,043.95 份	192,769,361.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。
投资策略	本基金依据以宏观经济分析模型 MEM 为基础的资产配置模型决定基金的资产配置，并运用景顺长城股票研究数据库（SRD）及 GVI 等选股模型作为行业配置和个股选择的依据。与此同时，本基金运用多因素模型等分析工具，结合基金管理人的主观判断，根据风险收益最优化的原则进行投资组合的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+银行同业存款利率×20%
风险收益特征	本基金严格控制证券市场中的非系统性风险，是风险程度适中的投资品种。

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	景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨皦阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		叶才	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	景顺长城鼎益混合（LOF）A	景顺长城鼎益混合（LOF）C
本期已实现收益	-3,679,878,270.21	-7,111,008.18
本期利润	976,417,027.75	32,272,459.03
加权平均基金份额本期利润	0.2559	1.4268
本期加权平均净值利润率	14.80%	79.22%
本期基金份额净值增长率	16.50%	16.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	景顺长城鼎益混合（LOF）A	景顺长城鼎益混合（LOF）C
期末可供分配利润	-2,520,249,467.32	-145,388,277.20
期末可供分配基金份额利润	-0.7394	-0.7542
期末基金资产净值	7,077,371,634.06	392,808,776.60
期末基金份额净值	2.076	2.038

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1,492.38%	-10.42%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、上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。

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

景顺长城鼎益混合（LOF）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	26.28%	1.94%	9.51%	1.01%	16.77%	0.93%
过去六个月	16.50%	1.62%	6.16%	0.90%	10.34%	0.72%
过去一年	18.43%	1.28%	21.03%	0.81%	-2.60%	0.47%
过去三年	-4.64%	1.39%	24.19%	0.89%	-28.83%	0.50%
过去五年	-39.26%	1.48%	-2.24%	0.89%	-37.02%	0.59%
过去七年	34.45%	1.54%	26.51%	0.93%	7.94%	0.61%
过去十年	166.57%	1.49%	52.81%	0.92%	113.76%	0.57%
自基金合同生效起 至今	1,492.38%	1.59%	256.47%	1.25%	1,235.91%	0.34%

景顺长城鼎益混合（LOF）C

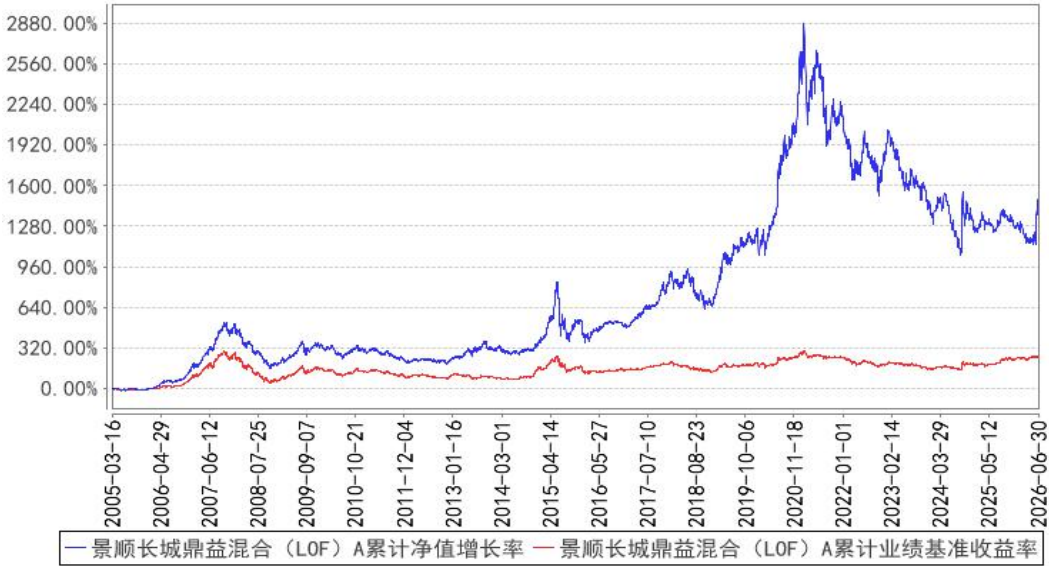
阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	26.11%	1.95%	9.51%	1.01%	16.60%	0.94%
过去六个月	16.19%	1.63%	6.16%	0.90%	10.03%	0.73%

过去一年	17.80%	1.28%	21.03%	0.81%	-3.23%	0.47%
过去三年	-6.30%	1.39%	24.19%	0.89%	-30.49%	0.50%
自基金合同生效起 至今	-10.42%	1.39%	23.65%	0.89%	-34.07%	0.50%

注：本基金于 2023 年 06 月 14 日增设 C 类基金份额，并于 2023 年 06 月 15 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城鼎益混合（LOF）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



景顺长城鼎益混合（LOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的资产配置比例为：对于股票的投资不少于基金财产的 60%，持有现金和到期日在一

年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。按照本基金基金合同的规定，本基金自 2005 年 3 月 16 日合同生效日起至 2005 年 6 月 15 日为建仓期。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。自 2017 年 9 月 6 日起，本基金业绩比较基准由“富时中国 A200 指数×80%+同业存款利率×20%”调整为“沪深 300 指数×80%+银行同业存款利率×20%”。本基金自 2023 年 6 月 14 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003] 76 号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
刘彦春	本基金的基金经理	2015 年 7 月 10 日	-	23 年	管理学硕士。曾任汉唐证券研究部研究员，香港中信投资研究有限公司研究员，博时基金研究员、基金经理助理、基金经理。2015 年 1 月加入本公司，自 2015 年 4 月起担任股票投资部基金经理，并曾任研究部总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理、股票投资部基金经理。具有 23 年证券、基金行业从业经验。
柯海	本基金的	2026 年 5	-	16 年	管理学硕士。曾任中投证券研究总部食品

东	基金经理	月 9 日			饮料分析师，国泰君安证券股份有限公司研究所食品饮料分析师，前海开源基金管理有限公司投资部基金经理，国联基金管理有限公司权益投资部资深基金经理。2025 年 9 月加入本公司，自 2026 年 5 月起担任股票投资部基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。
---	------	-------	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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%的交易共有 10 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年沪深 300 指数上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，科创板综指上涨 53.99%，反映出上半年市场处于上涨趋势中，但科技成长股表现更为活跃。上半年 A 股走势先抑后扬，3 月初美伊冲突导致能源价格高企、市场风险偏好下降使得全球资本市场都遭遇大幅调整，但随后美伊冲突开始逐步缓和，以及 AI 科技革命带来的全球 AI 基建热潮，又使得包括 A 股、美股在内的全球主要股指得到修复，推动二季度 A 股市场迎来大涨。

本基金在 5 月 9 日开始进入双基金经理共管模式后，为了增加投资组合收益来源的多样性，进行了持仓结构的调整，重点布局了以下的投资方向：

第一，AI 基建产业链，包括受益于半导体扩产大周期的半导体材料与设备行业，以及盈利处于高速增长阶段的光通信产业链。

第二，战略资源品及部分出海的资本品，包括钽、钨、锡等战略金属，以及燃机、船舶制造等出海的资本品。

第三，适应国内内需变革、格局改善的消费品，如量贩零食；有望走向全球的品牌消费品，如建材、汽车等细分领域龙头公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 16.50%，业绩比较基准收益率为 6.16%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 16.19%，业绩比较基准收益率为 6.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年二季度国内 GDP 同比增长 4.3%，相较一季度 5% 的增速出现回落，从结构上看，上半年出口是中国经济增长的核心动能，消费、投资表现较为逊色。展望未来，出口韧性或大概率持续，预计财政工具在下半年或会加速落地，内外需的分化可能会有所收敛，但我们认为符合高质量发展导向的科技产业可能仍是财政关注的重点方向。海外市场展望来看，美伊冲突导致的能源价格剧烈波动，以及新任美联储主席的改革方案使得联储的货币政策走势仍具备较高的不确定性，需保持密切跟踪。我们持续关注以下投资机会：

第一，AI 驱动的科技产业变革。上半年 coding 渗透率快速提升，驱动头部模型厂家 ARR 快速增长后，市场开始担忧除 coding 外 AI 缺乏新的应用场景，使得全球 AI 硬件资产在经历大幅上涨后开始出现高位震荡。全球头部模型厂家仍笃信 scaling law，持续加码训练以提升模型的能力，而随着大模型能力的提升，我们认为新的应用场景的拓展、渗透率的提升只是时间问题，对此我们保持紧密跟踪。在新场景打开前，国内大模型技术快速追赶世界顶尖水平，并已经取得

阶段性成效，而国内的算力投资则明显滞后于海外，我们认为国产算力链条值得重视，尤其是国内的半导体产业，既受益于全球的存储及先进逻辑龙头公司的扩产周期，同时又是我国在大国博弈的战略环境下解决国内算力问题的瓶颈环节，值得重点跟踪挖掘投资机会。海外算力方面，在短期需求叙事无法强化的背景下，我们更关注业绩的确定性，以及受益于技术升级的新方向。

第二，看好战略资源品及部分出海的资本品。尤其是部分战略金属，受全球资源民族主义趋势影响，具备供给刚性特征，同时需求端深度受益于 AI 产业爆发，有望带来长期的投资机会。而部分资本品、能源设备受益于资源品、能源价格高企、全球资本开支上行，叠加中资企业全球化扩张，也具备长期成长机会。

第三，看好部分具有长期成长性的全球化的消费品，及适应国内内需变革、格局改善的消费品。预计内需延续 K 型趋势，看好量贩零食、保健品等顺应当前消费趋势的品种。新兴市场的城镇化，以及欧美市场对质价比的追求为中国品牌出海带来机遇，如建材、汽车等细分领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

§ 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”）在景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的

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的复核，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）、投资组合报告等财务数据真实、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：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	158,058,425.12	237,957,604.30
结算备付金		45,061,691.27	-
存出保证金		1,838,257.80	271,860.13
交易性金融资产	6.4.7.2	7,245,661,630.23	7,321,332,919.71
其中：股票投资		6,855,098,470.85	7,069,130,810.12
基金投资		-	-
债券投资		390,563,159.38	252,202,109.59
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		64,482,172.17	116,536.10
应收股利		-	-
应收申购款		21,510,774.63	2,178,687.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		7,536,612,951.22	7,561,857,607.30
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		52,061,043.00	20,092,795.09
应付管理人报酬		6,406,507.22	7,851,334.24
应付托管费		1,067,751.23	1,308,555.70
应付销售服务费		61,440.33	10,600.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,537.24	8,092.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,825,261.54	418,402.50
负债合计		66,432,540.56	29,689,781.26
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	3,601,296,405.30	4,226,342,015.34
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	3,868,884,005.36	3,305,825,810.70
净资产合计		7,470,180,410.66	7,532,167,826.04
负债和净资产总计		7,536,612,951.22	7,561,857,607.30

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,601,296,405.30 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 2.076 元，基金份额 3,408,527,043.95 份；本基金 C 类份额净值人民币 2.038 元，基金份额 192,769,361.35 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,055,202,258.98	-413,409,847.61

1. 利息收入		403,437.60	433,763.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	403,437.60	433,763.09
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）		-3,641,484,110.25	-208,727,892.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,681,332,864.15	-396,419,677.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,934,912.49	2,377,794.51
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	37,913,841.41	185,313,990.02
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）	6.4.7.20	4,695,678,765.17	-205,482,240.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	604,166.46	366,521.97
减：二、营业总支出		46,512,772.20	65,174,770.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	39,640,139.53	55,715,708.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,606,689.97	9,285,951.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	118,333.19	32,244.65
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,449.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,449.43	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		657.40	-
8. 其他费用	6.4.7.23	140,502.68	140,865.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,008,689,486.78	-478,584,618.44
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 008, 689, 486. 78	-478, 584, 618. 44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 008, 689, 486. 78	-478, 584, 618. 44

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 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	4, 226, 342, 015. 34	-	3, 305, 825, 810. 70	7, 532, 167, 826. 04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4, 226, 342, 015. 34	-	3, 305, 825, 810. 70	7, 532, 167, 826. 04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-625, 045, 610. 04	-	563, 058, 194. 66	-61, 987, 415. 38
（一）、综合收益总额	-	-	1, 008, 689, 486. 78	1, 008, 689, 486. 78
（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）	-625, 045, 610. 04	-	-445, 631, 292. 12	-1, 070, 676, 902. 16
其中：1. 基金申购款	367, 245, 123. 88	-	297, 093, 826. 99	664, 338, 950. 87
2. 基金赎回款	-992, 290, 733. 92	-	-742, 725, 119. 11	-1, 735, 015, 853. 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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3, 601, 296, 405. 30	-	3, 868, 884, 005. 36	7, 470, 180, 410. 66
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	5,428,006,748.30	-	4,597,803,415.56	10,025,810,163.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	5,428,006,748.30	-	4,597,803,415.56	10,025,810,163.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-521,241,935.42	-	-904,248,198.88	-1,425,490,134.30
（一）、综合收益总额	-	-	-478,584,618.44	-478,584,618.44
（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）	-521,241,935.42	-	-425,663,580.44	-946,905,515.86
其中：1. 基金申购款	134,111,846.18	-	109,241,335.40	243,353,181.58
2. 基金赎回款	-655,353,781.60	-	-534,904,915.84	-1,190,258,697.44
（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	4,906,764,812.88	-	3,693,555,216.68	8,600,320,029.56

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），原名景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF），系根据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[2005]7 号文《关于同意景顺长城鼎益股票型开放式证券投资基金募集的批复》，由景顺长城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《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2005 年 3 月 16 日正式生效，首次设立募集

规模为 445,627,301.07 份基金份额。本基金为契约型上市开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》（证监会令第 104 号）第三十条第一项的规定，股票基金的股票资产投资比例下限由 60%上调至 80%，景顺长城基金管理有限公司经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 7 日起将景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）变更为本基金。

本基金自 2023 年 6 月 14 日起增设 C 类基金份额，原份额转为 A 类基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票（含存托凭证）和债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。通过主动的基本面选股和最优化风险收益配比获取超额收益，力求基金财产长期稳定的回报。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2026 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部 国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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[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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	158,058,425.12
等于：本金	158,048,528.10
加：应计利息	9,897.02
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 个月（含）-3 个月	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	158,058,425.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5, 432, 437, 667. 16	—	6, 855, 098, 470. 85	1, 422, 660, 803. 69
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	57, 569, 167. 00	350, 748. 97	57, 927, 268. 97	7, 353. 00
	银行间市场	331, 248, 960. 00	1, 291, 890. 41	332, 635, 890. 41	95, 040. 00
	合计	388, 818, 127. 00	1, 642, 639. 38	390, 563, 159. 38	102, 393. 00
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		5, 821, 255, 794. 16	1, 642, 639. 38	7, 245, 661, 630. 23	1, 422, 763, 196. 69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	112,480.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,601,822.62
其中：交易所市场	6,600,097.62
银行间市场	1,725.00
应付利息	-
预提费用	110,958.65
合计	6,825,261.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城鼎益混合（LOF）A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,214,315,584.60	4,214,315,584.60
本期申购	172,055,784.16	172,055,784.16
本期赎回（以“-”号填列）	-977,844,324.81	-977,844,324.81
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	3,408,527,043.95	3,408,527,043.95

景顺长城鼎益混合（LOF）C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,026,430.74	12,026,430.74
本期申购	195,189,339.72	195,189,339.72
本期赎回（以“-”号填列）	-14,446,409.11	-14,446,409.11
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	192,769,361.35	192,769,361.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城鼎益混合（LOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,023,998,092.17	2,272,757,921.70	3,296,756,013.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,023,998,092.17	2,272,757,921.70	3,296,756,013.87
本期利润	-3,679,878,270.21	4,656,295,297.96	976,417,027.75
本期基金份额交易产生的变动数	135,630,710.72	-739,959,162.23	-604,328,451.51
其中：基金申购款	-19,400,073.67	146,816,940.77	127,416,867.10
基金赎回款	155,030,784.39	-886,776,103.00	-731,745,318.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,520,249,467.32	6,189,094,057.43	3,668,844,590.11

景顺长城鼎益混合（LOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,593,013.99	6,476,782.84	9,069,796.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,593,013.99	6,476,782.84	9,069,796.83
本期利润	-7,111,008.18	39,383,467.21	32,272,459.03
本期基金份额交易产生的变动数	-140,870,283.01	299,567,442.40	158,697,159.39
其中：基金申购款	-148,719,091.12	318,396,051.01	169,676,959.89
基金赎回款	7,848,808.11	-18,828,608.61	-10,979,800.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-145,388,277.20	345,427,692.45	200,039,415.25

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	391,876.60
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	10,304.18
其他	1,256.82
合计	403,437.60

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,681,332,864.15
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,681,332,864.15

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	8,309,598,595.31
减：卖出股票成本总额	11,978,793,871.81
减：交易费用	12,137,587.65
买卖股票差价收入	-3,681,332,864.15

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,818,137.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	116,775.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,934,912.49

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	253,712,684.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	249,881,500.00

减：应计利息总额	3,712,684.93
减：交易费用	1,725.00
买卖债券差价收入	116,775.00

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	37,913,841.41
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	37,913,841.41

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,695,678,765.17
股票投资	4,695,584,872.17
债券投资	93,893.00
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—

其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,695,678,765.17

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	602,763.92
基金转换费收入	1,402.54
合计	604,166.46

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	42,151.28
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,600.00
银行划款手续费	20,244.03
合计	140,502.68

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
--------------------	-----------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	1,134,435,271.20	7.38	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	516,168.04	7.38	516,134.50	7.82
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，被动股票型基金不得通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	39,640,139.53	55,715,708.97
其中：应支付销售机构的客户维护	16,015,064.87	21,276,101.30

费		
应支付基金管理人的净管理费	23,625,074.66	34,439,607.67

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,606,689.97	9,285,951.56

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城鼎益混合 (LOF) A	景顺长城鼎益混合 (LOF) C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	3,173.13	3,173.13
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	3,173.13	3,173.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城鼎益混合 (LOF) A	景顺长城鼎益混合 (LOF) C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	7.82	7.82
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	7.82	7.82

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/当年天数。

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

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金的基金管理人于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。

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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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-活期	158,058,425.12	391,876.60	507,307,668.35	432,950.61

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026年6月24日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	7,270	727,000.00	727,012.75	-

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026年6月	重大事项停牌	832.00	2026年7月13	890.99	476,347	242,004,916.10	396,320,704.00	-

		29			日					
		日								

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 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参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进

行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还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，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.01%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 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。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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组合持仓集中度指标、流通受限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的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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该比例限制）。

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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日

可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	158,058,425.12	-	-	-	-	-	158,058,425.12
结算备付金	45,061,691.27	-	-	-	-	-	45,061,691.27
存出保证金	1,838,257.80	-	-	-	-	-	1,838,257.80
交易性金融资产	-	-	389,836,146.63	-	727,012.75	6,855,098,470.85	7,245,661,630.23
应收申购款	-	-	-	-	-	21,510,774.63	21,510,774.63
应收清算款	-	-	-	-	-	64,482,172.17	64,482,172.17
资产总计	204,958,374.19	-	389,836,146.63	-	727,012.75	6,941,091,417.65	7,536,612,951.22

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	52,061,043.00	52,061,043.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,406,507.22	6,406,507.22
应付托管费	-	-	-	-	-	1,067,751.23	1,067,751.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	61,440.33	61,440.33
应交税费	-	-	-	-	-	10,537.24	10,537.24
其他负债	-	-	-	-	-	6,825,261.54	6,825,261.54
负债总计	-	-	-	-	-	66,432,540.56	66,432,540.56
利率敏感度缺口	204,958,374.19	-	-389,836,146.63	-	-727,012.75	-	-
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	237,957,604.30	-	-	-	-	-	237,957,604.30
存出保证金	271,860.13	-	-	-	-	-	271,860.13
交易性金融资产	-	-	-252,202,109.59	-	-	-7,069,130,810.12	7,321,332,919.71
应收申购款	-	-	-	-	-	2,178,687.06	2,178,687.06
应收清算款	-	-	-	-	-	116,536.10	116,536.10
资产总计	238,229,464.43	-	-252,202,109.59	-	-	-7,071,426,033.28	7,561,857,607.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,092,795.09	20,092,795.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,851,334.24	7,851,334.24
应付托管费	-	-	-	-	-	1,308,555.70	1,308,555.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,600.93	10,600.93
应交税费	-	-	-	-	-	8,092.80	8,092.80
其他负债	-	-	-	-	-	418,402.50	418,402.50
负债总计	-	-	-	-	-	29,689,781.26	29,689,781.26
利率敏感度缺口	238,229,464.43	-	-252,202,109.59	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）

	市场利率上升 25 个基点	-720, 753. 32	-253, 720. 86
	市场利率下降 25 个基点	723, 443. 21	254, 250. 65

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

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

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，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。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	6, 855, 098, 470. 85	91. 77	7, 069, 130, 810. 12	93. 85
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	6, 855, 098, 470. 85	91. 77	7, 069, 130, 810. 12	93. 85

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月

			31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	440,374,130.28	165,207,245.74
	沪深 300 指数下降 5%	-440,374,130.28	-165,207,245.74

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	6,458,403,799.75	7,068,830,624.37
第二层次	786,883,863.38	252,202,109.59
第三层次	373,967.10	300,185.75
合计	7,245,661,630.23	7,321,332,919.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	6,855,098,470.85	90.96
	其中：股票	6,855,098,470.85	90.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	390,563,159.38	5.18
	其中：债券	390,563,159.38	5.18
	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	203,120,116.39	2.70
8	其他各项资产	87,831,204.60	1.17
9	合计	7,536,612,951.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	19,845,169.92	0.27
B	采矿业	18,432,792.00	0.25
C	制造业	6,202,637,783.24	83.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	194,644,227.91	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,354,228.42	2.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	88,961,610.00	1.19

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	82,226,404.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	34,064,101.36	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	52,932,154.00	0.71
	合计	6,855,098,470.85	91.77

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300666	江丰电子	1,833,026	675,653,383.60	9.04
2	300308	中际旭创	487,400	618,998,000.00	8.29
3	000962	东方钨业	6,822,900	618,154,740.00	8.27
4	688072	拓荆科技	476,347	396,320,704.00	5.31
5	002353	杰瑞股份	1,997,500	304,618,750.00	4.08
6	300750	宁德时代	746,100	293,224,761.00	3.93
7	000510	新金路	8,194,100	203,541,444.00	2.72
8	300972	万辰集团	1,122,451	194,644,227.91	2.61
9	000657	中钨高新	2,027,900	194,110,588.00	2.60
10	688630	芯碁微装	352,858	193,856,656.62	2.60
11	300502	新易盛	285,998	173,600,786.00	2.32
12	688233	神工股份	788,934	169,163,228.28	2.26
13	688521	芯原股份	434,753	161,354,228.42	2.16
14	002436	兴森科技	3,086,600	157,262,270.00	2.11
15	000534	万泽股份	5,582,100	152,726,256.00	2.04
16	002409	雅克科技	633,000	142,108,500.00	1.90
17	600499	科达制造	10,141,500	139,952,700.00	1.87
18	600519	贵州茅台	105,250	124,772,822.50	1.67
19	688200	华峰测控	194,601	102,184,985.10	1.37
20	603678	火炬电子	1,231,000	102,173,000.00	1.37
21	300054	鼎龙股份	856,700	90,784,499.00	1.22
22	600246	万通发展	4,682,190	88,961,610.00	1.19
23	301511	德福科技	599,100	86,180,535.00	1.15
24	603306	华懋科技	821,900	85,222,811.00	1.14
25	688008	澜起科技	271,334	84,086,406.60	1.13
26	002203	海亮股份	3,648,529	83,368,887.65	1.12

27	603259	药明康德	660,400	82,226,404.00	1.10
28	600482	中国动力	2,202,700	72,248,560.00	0.97
29	301150	中一科技	1,117,348	70,515,832.28	0.94
30	600166	福田汽车	24,054,500	69,998,595.00	0.94
31	603268	松发股份	471,300	65,642,664.00	0.88
32	688808	联讯仪器	28,090	65,234,249.70	0.87
33	688720	艾森股份	606,036	61,209,636.00	0.82
34	600673	东阳光	1,576,300	52,932,154.00	0.71
35	688545	兴福电子	379,160	50,451,029.60	0.68
36	603115	海星股份	404,300	49,514,621.00	0.66
37	603067	振华股份	1,063,000	49,206,270.00	0.66
38	600105	永鼎股份	707,003	47,708,562.44	0.64
39	300236	上海新阳	354,746	46,649,099.00	0.62
40	300835	龙磁科技	196,900	45,186,581.00	0.60
41	002371	北方华创	47,900	42,370,424.00	0.57
42	688396	华润微	429,959	41,942,500.45	0.56
43	002080	中材科技	461,300	41,517,000.00	0.56
44	688981	中芯国际	252,579	40,114,596.78	0.54
45	002956	西麦食品	1,924,361	39,949,734.36	0.53
46	688480	赛恩斯	388,904	34,064,101.36	0.46
47	002008	大族激光	220,600	33,114,266.00	0.44
48	301548	崇德科技	218,200	19,369,614.00	0.26
49	600549	厦门钨业	219,500	18,701,400.00	0.25
50	600301	华锡有色	300,600	18,432,792.00	0.25
51	300285	国瓷材料	149,551	15,430,672.18	0.21
52	603766	隆鑫通用	1,292,400	15,418,332.00	0.21
53	300970	华绿生物	819,780	14,985,578.40	0.20
54	603078	江化微	176,100	8,702,862.00	0.12
55	002157	正邦科技	1,729,392	4,859,591.52	0.07
56	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
57	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
58	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
59	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
60	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
61	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
62	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
63	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
64	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
65	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
66	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
67	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
68	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
69	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00

70	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
71	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	466,054,359.00	6.19
2	300666	江丰电子	401,512,949.29	5.33
3	000962	东方钨业	385,942,718.12	5.12
4	300750	宁德时代	337,118,361.55	4.48
5	688072	拓荆科技	308,038,035.61	4.09
6	002353	杰瑞股份	286,733,886.49	3.81
7	000338	潍柴动力	271,595,714.20	3.61
8	300972	万辰集团	226,647,201.80	3.01
9	002475	立讯精密	207,437,937.87	2.75
10	000534	万泽股份	195,567,092.00	2.60
11	000657	中钨高新	186,536,442.07	2.48
12	600499	科达制造	177,964,698.06	2.36
13	000510	新金路	169,565,893.99	2.25
14	600105	永鼎股份	147,131,650.84	1.95
15	688521	芯原股份	138,504,978.01	1.84
16	603296	华勤技术	134,375,481.10	1.78
17	300502	新易盛	130,296,522.53	1.73
18	688126	沪硅产业	125,386,036.07	1.66
19	688233	神工股份	110,855,889.41	1.47
20	002436	兴森科技	110,762,251.00	1.47

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002311	海大集团	625,015,459.36	8.30
2	600519	贵州茅台	602,428,626.60	8.00
3	300760	迈瑞医疗	525,308,044.17	6.97
4	002415	海康威视	510,997,498.21	6.78
5	000333	美的集团	498,550,987.45	6.62
6	600809	山西汾酒	495,927,585.71	6.58
7	601888	中国中免	433,999,403.11	5.76
8	603259	药明康德	429,876,480.41	5.71
9	000858	五粮液	370,558,437.38	4.92
10	603899	晨光股份	339,021,513.55	4.50
11	000568	泸州老窖	305,048,958.31	4.05
12	000596	古井贡酒	273,515,884.95	3.63

13	000338	潍柴动力	266,621,149.56	3.54
14	002475	立讯精密	188,356,795.18	2.50
15	300015	爱尔眼科	187,795,364.91	2.49
16	600887	伊利股份	183,654,007.00	2.44
17	688126	沪硅产业	155,214,857.05	2.06
18	600105	永鼎股份	133,342,790.00	1.77
19	603296	华勤技术	128,238,640.29	1.70
20	600660	福耀玻璃	118,913,502.88	1.58

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,069,176,660.37
卖出股票收入（成交）总额	8,309,598,595.31

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	57,200,256.22	0.77
2	央行票据	—	—
3	金融债券	332,635,890.41	4.45
	其中：政策性金融债	332,635,890.41	4.45
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	727,012.75	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	390,563,159.38	5.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	09240202	24 国开清发 02	2,300,000	232,227,219.18	3.11
2	260411	26 农发 11	500,000	50,242,876.71	0.67
3	250202	25 国开 02	500,000	50,165,794.52	0.67
4	019827	26 国债 01	488,000	49,116,317.59	0.66
5	019792	25 国债 19	80,000	8,083,938.63	0.11

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局地方分局、中国人民银行处罚。

中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,838,257.80
2	应收清算款	64,482,172.17
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	21,510,774.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	87,831,204.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净值 比例（%）	流通受限情况说 明
1	688072	拓荆科技	396,320,704.00	5.31	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 （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 （%）
景顺长城 鼎益混合 （LOF）A	549,854	6,198.97	64,563,158.85	1.89	3,343,963,885.10	98.11
景顺长城 鼎益混合 （LOF）C	1,599	120,556.20	183,800,177.88	95.35	8,969,183.47	4.65
合计	551,453	6,530.56	248,363,336.73	6.90	3,352,933,068.57	93.10

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	91.60

8.3 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	景顺长城鼎益混合（LOF）A	382,510.31	0.011222

理人所有从业人员持有本基金	景顺长城鼎益混合（LOF）C	16, 225. 71	0. 008417
	合计	398, 736. 02	0. 011072

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	景顺长城鼎益混合（LOF）A	0~10
	景顺长城鼎益混合（LOF）C	—
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城鼎益混合（LOF）A	10~50
	景顺长城鼎益混合（LOF）C	—
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城鼎益混合（LOF）A	景顺长城鼎益混合（LOF）C
基金合同生效日（2005 年 3 月 16 日）基金份额总额	445, 627, 301. 07	—
本报告期期初基金份额总额	4, 214, 315, 584. 60	12, 026, 430. 74
本报告期基金总申购份额	172, 055, 784. 16	195, 189, 339. 72
减：本报告期基金总赎回份额	977, 844, 324. 81	14, 446, 409. 11
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	3, 408, 527, 043. 95	192, 769, 361. 35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，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

基金管理人重大人事变动：
报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
广发证券股份 有限公司	2	3,902,827,643.51	25.38	1,775,788.15	25.38	未变更
中信建投证 券股份有限 公司	2	3,718,823,122.17	24.18	1,692,064.39	24.18	未变更
中国银河证 券股份有限 公司	1	1,733,110,980.00	11.27	788,566.26	11.27	未变更
华泰证券股	1	1,297,478,881.97	8.44	590,352.88	8.44	未变更

份有限公司						
长城证券股份有限公司	3	1,134,435,271.20	7.38	516,168.04	7.38	未变更
东吴证券股份有限公司	1	799,184,446.81	5.20	363,629.85	5.20	未变更
中泰证券股份有限公司	1	638,256,885.16	4.15	290,406.00	4.15	未变更
国盛证券股份有限公司	1	632,971,360.15	4.12	288,001.99	4.12	未变更
华福证券股份有限公司	1	549,037,269.27	3.57	249,811.98	3.57	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	231,565,287.75	1.51	105,361.51	1.51	未变更
东方证券股份有限公司	2	227,858,238.35	1.48	103,676.67	1.48	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	171,139,668.84	1.11	77,867.23	1.11	未变更
华西证券股份有限公司	1	117,056,787.40	0.76	53,261.59	0.76	未变更
浙商证券股份有限公司	1	113,184,770.13	0.74	51,500.36	0.74	未变更
招商证券股份有限公司	2	58,161,260.68	0.38	26,463.70	0.38	未变更
中信证券股份有限公司	4	43,385,583.24	0.28	19,740.44	0.28	未变更
平安证券股份有限公司	1	9,469,947.00	0.06	4,308.83	0.06	未变更
德邦证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
东兴证券股份有限公司	1	—	—	—	—	未变更
信达证券股份有限公司	—	—	—	—	—	本期报告退租 1 个

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	56,842,167.00	100.00	84,919,000.00	100.00	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
7	关于景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）新增阳光人寿为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 18 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2026 年 3 月 27 日

	基金 2025 年年度报告提示性公告	网站	
10	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
11	景顺长城基金管理有限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(2025 年度)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
14	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
17	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 9 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 12 日
20	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
22	景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）2026 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
28	关于景顺长城基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报刊及	2026 年 6 月 22 日

	部分基金新增排排网销售为销售机构的公告	网站	
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城鼎益股票型证券投资基金（LOF）募集注册的文件；
- 2、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司
2026 年 8 月 28 日