

长城上证科创板综合指数型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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 08 月 28 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	67
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	67
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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城上证科创板综合指数型证券投资基金	
基金简称	长城上证科创板综合指数	
基金主代码	023934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 28 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	270,299,536.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
下属分级基金的交易代码	023934	023935
报告期末下属分级基金的份额总额	208,064,404.08 份	62,235,132.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪上证科创板综合指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。在条件允许的情况下，本基金也可以适当参与上证科创板综合指数所包含指数成份股以外的其他个股（非标的指数成份股及备选成份股），以更好地跟踪指数。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）组合复制策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>（2）替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股等进行替代。</p>

	<p>(3) 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券投资。</p> <p>3、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳健收益。</p> <p>5、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照境内上市交易的股票投资策略执行。</p>
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	任航
	联系电话	0755-29279006	010-66060069
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95599
传真		0755-29279000	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层、38层、39层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518046	100031

法定代表人	王军	谷澍
-------	----	----

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.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、38 层、39 层

§ 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 8 月 28 日(基金合同生效日) - 2025 年 12 月 31 日	
	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
本期已实现收益	1,730,732.26	433,148.49
本期利润	4,200,406.21	680,256.31
加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0086
本期加权平均净值利润率	1.38%	0.86%
本期基金份额净值增长率	0.26%	0.17%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	535,208.70	104,130.44
期末可供分配基金份额利润	0.0026	0.0017
期末基金资产净值	208,599,612.78	62,339,262.66
期末基金份额净值	1.0026	1.0017
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	0.26%	0.17%

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

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法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。

④本基金合同于 2025 年 8 月 28 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城上证科创板综合指数 A

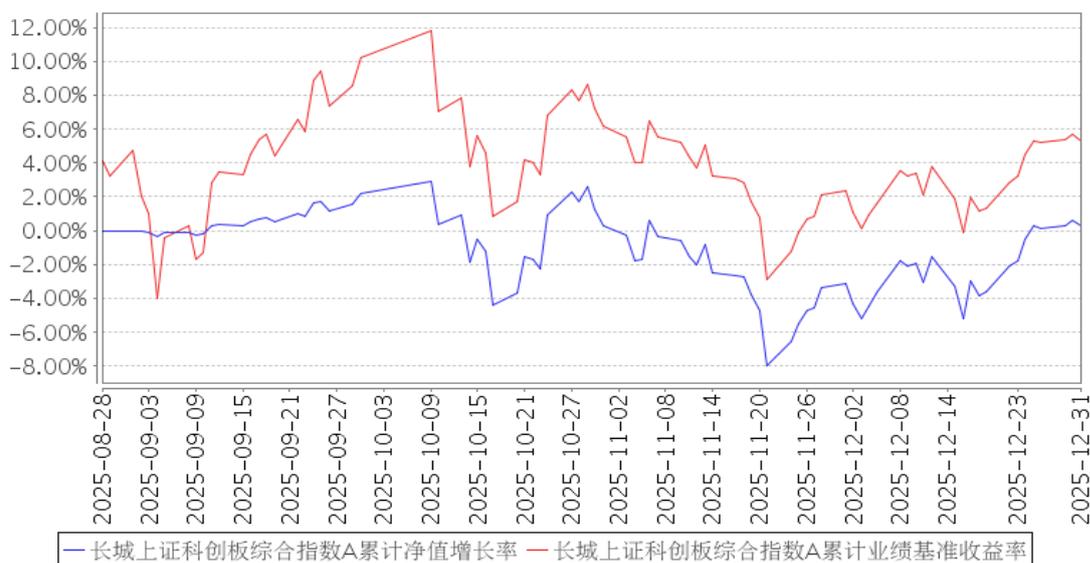
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.91%	1.38%	-4.41%	1.54%	2.50%	-0.16%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.26%	1.18%	5.33%	1.74%	-5.07%	-0.56%

长城上证科创板综合指数 C

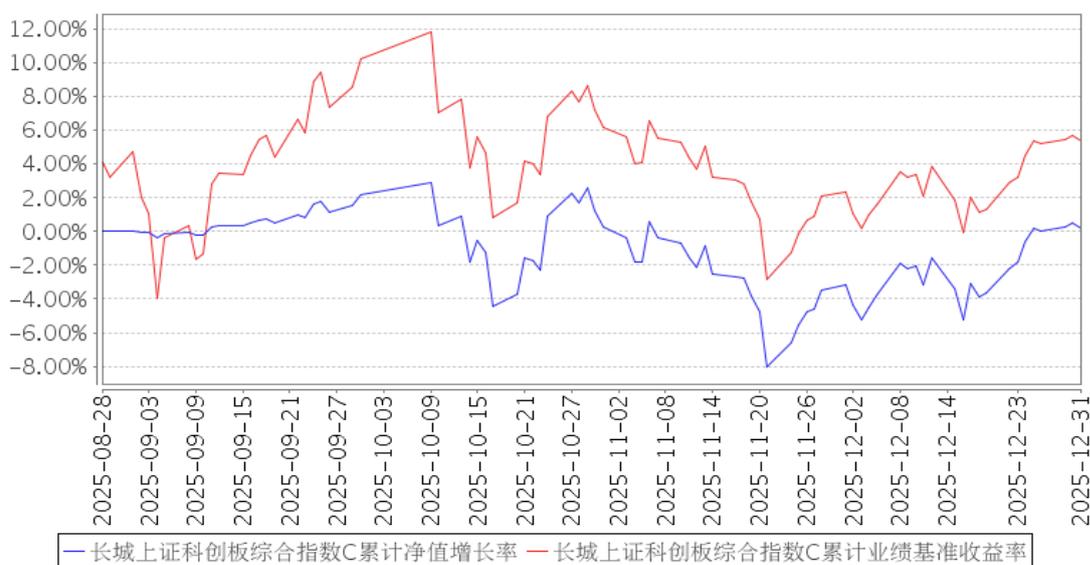
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.97%	1.39%	-4.41%	1.54%	2.44%	-0.15%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.17%	1.18%	5.33%	1.74%	-5.16%	-0.56%

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

长城上证科创板综合指数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



长城上证科创板综合指数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



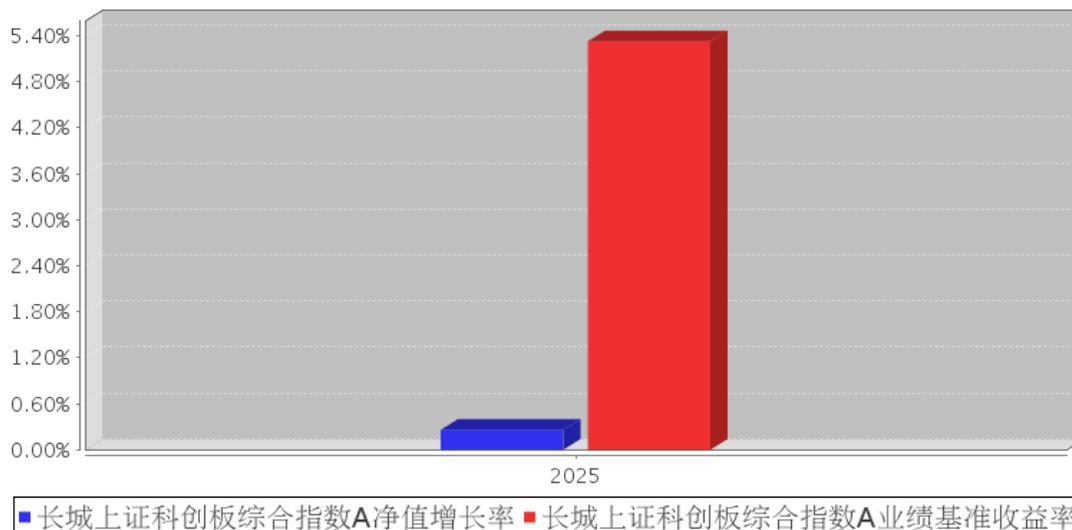
注：①本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

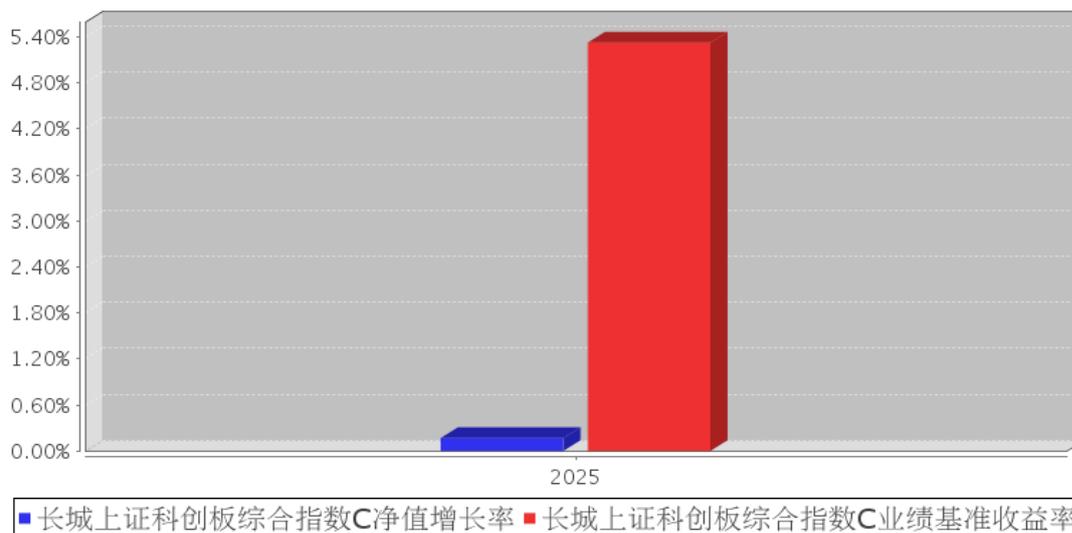
③本基金合同于 2025 年 8 月 28 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城上证科创板综合指数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



长城上证科创板综合指数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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：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

长城基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批

准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2025 年 12 月 31 日，公司旗下共管理 120 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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		
陶曙斌	本基金的基金经理	2025 年 8 月 28 日	-	17 年	男，中国籍，硕士。曾就职于德勤会计师事务所（2005 年 7 月-2008 年 4 月）、南方基金管理股份有限公司（2008 年 4 月-2015 年 12 月）、前海开源基金管理有限公司（2016 年 1 月-2020 年 12 月）、光大保德信基金管理有限公司（2021 年 1 月-2024 年 6 月）。2024 年 6 月加入长城基金管理有限公司。自 2025 年 1 月至今任“长城中证 A500 指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至今任“长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金”基金经理，自 2025 年 8 月至今任“长城国证自由现金流指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 8 月至今任“长城上证科创板综合指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 12 月至今任“长城沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3日内、5日内、7日内、9日内、11日内、13日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。

本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

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

本报告期内，市场延续 24 年 9 月底以来的预期。整体风格表现分化较大，新兴科技相关资产更优。本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，本基金结合申购赎回情况、标的指数成份股调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪，以为持有人提供与之相近的收益，并通过参与新股申购、转债套利等方式追求超额收益。本报告期内完成建仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城上证科创板综合指数 A 基金份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%；长城上证科创板综合指数 C 基金份额净值增长率为 0.17%，同期业绩比较基准收益率为 5.33%。

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 2026 年，A 股“9.24”以来的震荡上行行情仍有望延续。国际秩序重构与国内产业创新共振仍将继续支持中国资产表现。节奏上，市场走势或将前升后稳，牛市正进入中期，整体震荡上行但波动可能加大，驱动力从估值修复转向企业盈利增长。2026 年国内经济整体平稳回暖，经济新旧动能转换，产业结构持续优化。作为新质生产力的代表宽基指数，科创综指在 2026 年预期会有较好的表现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规和公司相关制度的规定，坚持持有人利益至上原则，勤勉尽责，持续完善公司内控制度流程，持续对公司及公司工作人员的经营管理和执业行为情况实施审查、监督和检查，强化合规风险、操作风险、洗钱风险等各类风险的发现、识别、监控、预警和干预，有效保障了本基金投资运作合规及平稳运行。主要监察稽核工作情况如下：

(1) 持续践行中国特色金融文化理念，以“诚实守信、以义取利、稳健审慎、守正创新、依法合规”为核心导向，打造多维度文化培育矩阵，开展职业道德培训、党风廉政建设教育、廉洁从业警示教育及投资研究和基金销售等核心业务合规培训，同时将践行情况纳入员工考核评价体系，引导全体从业人员树立正确价值观，深化对金融文化内涵的思想认同，切实做到珍惜职业声

誉、严守合规底线，将文化理念转化为稳健经营、服务投资者的实际行动。

(2) 持续深化内控制度及流程建设。紧密结合行业法律法规动态更新、典型案例警示教育及自身业务开展实际，建立常态化制度修订与新增机制；针对法规政策变化，及时梳理制度适配要点，及时更新合规管理、风险控制等相关条款；依托行业案例复盘，查找风险隐患点，补充完善业务操作流程、内控监督机制等内容；立足业务创新与发展需求，同步优化岗位职责及流程节点，确保制度体系与业务发展契合。同时通过流程落地检查、执行效果评估等手段，推动内控制度落地实施，为基金稳健运营提供坚实保障。

(3) 持续对基金管理人及其工作人员的经营管理和执业行为情况实施审查、监督和检查。一方面通过常态化的合规审核机制，将审核嵌入业务前端，事前校验公司规章制度制定、重大事项决策、新产品新业务方案、重要合同、宣传推介材料、披露信息等内容的合规性，对不合规内容提出修改建议并监督整改；另一方面依托“投资管理系统+风控系统”实时监测投资管理业务，拦截违规投资、预警超标与异常交易行为，再辅以人工深度分析强化监督。事后定期对投研交、销售、中后台运营等重大业务开展合规检查，排查风险点、提出改进建议，跟踪整改情况至问题消除。最终确保业务合规及信息披露的完整、及时和准确，推动基金业务合规稳健运作。

报告期内，本基金投资运作合法合规。本基金管理人将始终恪守诚实守信、谨慎勤勉的原则，规范管理和运用基金资产，持续完善监察稽核体系，提高监察稽核工作的精准度和有效性，着力防范和化解重大风险，切实保障基金份额持有人的合法权益。

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，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关基金经理及研究员、基金会计等岗位资深人员组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理

的估值区间。 基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长城基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，本托管人未发现有损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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	德师报(审)字(26)第 P03613 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	长城上证科创板综合指数型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了长城上证科创板综合指数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,自 2025 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的长城上证科创板综合指数型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了长城上证科创板综合指数型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 8 月 28 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间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,我们独立于长城上证科创板综合指数型证券投资基金,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	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长城上证科创板综合指数型证券投资基金年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长城上证科创板综合指数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城上证科创板综合指数型证券投资基金、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城上证科创板综合指数型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>(1) 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>(2) 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>(3) 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>(4) 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，就可能对导致对长城上证科创板综合指数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城上证科创板综合指数型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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</p>

	别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈晓莹	麦嘉颖
会计师事务所的地址	中国上海	
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

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
资产：		
货币资金	7.4.7.1	14,078,400.87
结算备付金		50,402.69
存出保证金		167,874.09
交易性金融资产	7.4.7.2	260,368,600.22
其中：股票投资		254,214,324.38
基金投资		-
债券投资		6,154,275.84
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		2,148,981.02
应收股利		-
应收申购款		8,000.74
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		276,822,259.63
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		5,634,804.10
应付管理人报酬		121,851.59
应付托管费		24,370.31
应付销售服务费		13,685.27
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	88,672.92
负债合计		5,883,384.19
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	270,299,536.30
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	639,339.14
净资产合计		270,938,875.44
负债和净资产总计		276,822,259.63

注：(1)报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 270,299,536.30 份，其中，下属 A 类基金份额净值人民币 1.0026 元，基金份额总额 208,064,404.08 份；下属 C 类基金份额净值人民币 1.0017 元，基金份额总额 62,235,132.22 份。

(2)本基金基金合同于 2025 年 8 月 28 日生效，本财务报表实际编制期间为 2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		5,825,793.22
1. 利息收入		338,841.26
其中：存款利息收入	7.4.7.13	181,713.39
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		157,127.87
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,769,349.55
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,624,011.35
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	17,787.11
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
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	127,551.09
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	2,716,781.77
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	820.64
减：二、营业总支出		945,130.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	661,221.51
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	132,244.30
3. 销售服务费		68,323.31
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	83,341.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,880,662.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,880,662.52
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,880,662.52

7.3 净资产变动表

会计主体：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

本报告期：2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	564,131,282.18	-	-	564,131,282.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	639,339.14	-293,192,406.74
（一）、综合收益总额	-	-	4,880,662.52	4,880,662.52
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-4,241,323.38	-298,073,069.26
其中：1. 基金申购款	7,066,496.74	-	-39,202.00	7,027,294.74
2. 基金赎回款	-	-	-4,202,121.38	-305,100,364.00
（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	270,299,536.30	-	639,339.14	270,938,875.44

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：

祝函

刘沛

李志朋

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

长城上证科创板综合指数型证券投资基金(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[2025]573号《关于准予长城上证科创板综合指数型证券投资基金注册的批复》准予注册,由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《长城上证科创板综合指数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564,046,531.52元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第70015735_H07号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》于2025年8月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为564,131,282.18份,其中认购资金利息折合84,750.66份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《长城上证科创板综合指数型证券投资基金招募说明书》,本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城上证科创板综合指数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,包括上证科创板综合指数的成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)、其他股票(含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率 \times 95%+活期存款利率（税后） \times 5%

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特

征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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金额。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业

有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

（3）个人所得税

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

个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）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（如适用）

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 号文《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 号文《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。

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
活期存款	14,078,400.87
等于：本金	14,077,013.80
加：应计利息	1,387.07
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,078,400.87

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	251,524,395.45	-	254,214,324.38	2,689,928.93	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	6,068,640.36	58,782.64	6,154,275.84	26,852.84
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,068,640.36	58,782.64	6,154,275.84	26,852.84
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	257,593,035.81	58,782.64	260,368,600.22	2,716,781.77	

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

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

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

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	50,672.92
其中：交易所市场	50,672.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	38,000.00
合计	88,672.92

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城上证科创板综合指数 A

项目	本期 2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	459,476,443.77	459,476,443.77
本期申购	2,306,591.70	2,306,591.70
本期赎回（以“-”号填列）	-253,718,631.39	-253,718,631.39
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	208,064,404.08	208,064,404.08

长城上证科创板综合指数 C

项目	本期 2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	104,654,838.41	104,654,838.41
本期申购	4,759,905.04	4,759,905.04
本期赎回（以“-”号填列）	-47,179,611.23	-47,179,611.23
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	62,235,132.22	62,235,132.22

注：（1）本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

（2）本基金合同于 2025 年 8 月 28 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 564,046,531.52 元，折合 564,046,531.52 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 84,750.66 元，折合 84,750.66 份基金份额。其中 A 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 459,407,054.48 元，折合 459,407,054.48 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 69,389.29 元，折合 69,389.29 份基金份额。C 类份额已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 104,639,477.04 元，折合 104,639,477.04 份基金份额，有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 15,361.37 元，折合 15,361.37 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 564,131,282.18 元，折合 564,131,282.18 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城上证科创板综合指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,730,732.26	2,469,673.95	4,200,406.21
本期基金份额交易产生的变动数	-202,585.97	-3,462,611.54	-3,665,197.51
其中：基金申购款	7,417.59	-23,648.70	-16,231.11
基金赎回款	-210,003.56	-3,438,962.84	-3,648,966.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,528,146.29	-992,937.59	535,208.70

长城上证科创板综合指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	433,148.49	247,107.82	680,256.31
本期基金份额交易产生的变动数	-31,582.71	-544,543.16	-576,125.87
其中：基金申购款	8,507.36	-31,478.25	-22,970.89
基金赎回款	-40,090.07	-513,064.91	-553,154.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	401,565.78	-297,435.34	104,130.44

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	180,614.29
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	987.14
其他	111.96
合计	181,713.39

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025年8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,624,011.35
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	2,624,011.35

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	95,405,789.42
减：卖出股票成本总额	92,620,020.58
减：交易费用	161,757.49
买卖股票差价收入	2,624,011.35

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	18,639.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-852.64
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	17,787.11

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,058,882.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,000,749.64

减：应计利息总额	58,985.05
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-852.64

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	127,551.09
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	127,551.09

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 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,716,781.77
股票投资	2,689,928.93
债券投资	26,852.84
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	2,716,781.77

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	820.64
合计	820.64

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00

信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	5,283.00
存托服务费	58.58
合计	83,341.58

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准日，本基金无需作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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司（“中原信托”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

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

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	661,221.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	325,371.97
应支付基金管理人的净管理费	335,849.54

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	132,244.30

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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8月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	长城上证科创板综合 指数 A	长城上证科创板综合 指数 C	合计
长城基金管理有限公司	-	8.56	8.56
中国农业银行	-	62,127.29	62,127.29
合计	-	62,135.85	62,135.85

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。销售服务费按该类基金份额前一日资产净值的销售服务费年费率计提。计算公式如下：

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

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

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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 8 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	14,078,400.87	180,614.29

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况, 请参阅本财务报表

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

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
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股锁定	46.68	55.66	94	4,387.92	5,232.04	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
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	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定	14.99	34.87	484	7,255.16	16,877.08	-

688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股锁定	17.78	25.11	2,218	39,436.04	55,693.98	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	6个月	新股锁定	83.06	117.19	194	16,113.64	22,734.86	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股锁定	114.28	416.02	1,083	123,765.24	450,549.66	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股锁定	26.68	42.25	271	7,230.28	11,449.75	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股锁定	104.66	399.40	799	83,623.34	319,120.60	-
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	121	6,250.86	16,402.76	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股锁定	85.09	203.31	89	7,573.01	18,094.59	-
7.4.12.1.2 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
118063	金05转债	2025年12月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	500	50,000.00	50,000.77	-

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
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	283.75	2026年1月5日	278.00	18,638	4,844,118.78	5,288,532.50	-

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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金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为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金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为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

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。本基金均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%。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除在附注“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

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孰早者进行了分类。

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	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	14,078,400.87	-	-	-	-	-	14,078,400.87
结算备付金	50,402.69	-	-	-	-	-	50,402.69
存出保证金	167,874.09	-	-	-	-	-	167,874.09
交易性金融资产	-	-6,060,578.63	-	-93,697.21	254,214,324.38	-	260,368,600.22
应收申购款	-	-	-	-	-	8,000.74	8,000.74
应收清算款	-	-	-	-	-	2,148,981.02	2,148,981.02
资产总计	14,296,677.65	-6,060,578.63	-	-93,697.21	256,371,306.14	-	276,822,259.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,634,804.10	5,634,804.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	121,851.59	121,851.59
应付托管费	-	-	-	-	-	24,370.31	24,370.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,685.27	13,685.27
其他负债	-	-	-	-	-	88,672.92	88,672.92
负债总计	-	-	-	-	-	5,883,384.19	5,883,384.19
利率敏感度缺口	14,296,677.65	-6,060,578.63	-	-93,697.21	-	-	-

7.4.13.4.1.2 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（2025年12月31日）
	市场利率下降 25个基点	4,344.95
	市场利率上升 25个基点	-4,338.73

	个基点	
--	-----	--

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。

本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	254,214,324.38	93.83
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	6,154,275.84	2.27
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	260,368,600.22	96.10

7.4.13.4.3.2 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
	对资产负债表日基金资产净值的

	相关风险变量的变动	影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	19,968,535.18
	沪深 300 指数下降 5%	-19,968,535.18

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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
第一层次	248,034,719.48
第二层次	11,399,111.90
第三层次	934,768.84
合计	260,368,600.22

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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8月28日（基金合同生效日）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	-	306,733.36	306,733.36
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	628,035.48	628,035.48
其中：计入损益的利得或损失	-	628,035.48	628,035.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	934,768.84	934,768.84
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	-	628,035.48	628,035.48

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
流通受限股票	934,768.84	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.8285-2.8666	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	254,214,324.38	91.83
	其中：股票	254,214,324.38	91.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,154,275.84	2.22
	其中：债券	6,154,275.84	2.22
	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	14,128,803.56	5.10
8	其他各项资产	2,324,855.85	0.84
9	合计	276,822,259.63	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	199,755,147.69	73.73
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	-	-
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	48,685,717.95	17.97
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,038,211.30	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	800,478.60	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	253,279,555.54	93.48

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	923,319.09	0.34
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,449.75	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	934,768.84	0.35

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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

8.3.1 期末指数投资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	688256	寒武纪	11,179	15,153,693.45	5.59
2	688041	海光信息	59,605	13,375,958.05	4.94
3	688981	中芯国际	51,325	6,304,249.75	2.33
4	688012	中微公司	18,638	5,288,532.50	1.95
5	688111	金山办公	12,307	3,779,110.49	1.39
6	688506	百利天恒	10,938	3,534,067.80	1.30
7	688008	澜起科技	29,384	3,461,435.20	1.28
8	688271	联影医疗	21,110	2,649,305.00	0.98
9	688072	拓荆科技	7,759	2,560,470.00	0.95
10	688775	影石创新	10,611	2,492,523.90	0.92
11	688082	盛美上海	12,757	2,245,869.85	0.83
12	688183	生益电子	21,278	2,036,091.82	0.75
13	688036	传音控股	29,519	1,952,977.04	0.72
14	688521	芯原股份	13,791	1,888,953.27	0.70
15	688396	华润微	34,055	1,800,147.30	0.66
16	688249	晶合集成	51,504	1,709,417.76	0.63
17	688126	沪硅产业	77,537	1,677,900.68	0.62
18	688498	源杰科技	2,546	1,634,506.54	0.60
19	688027	国盾量子	3,137	1,580,389.23	0.58
20	688110	东芯股份	11,739	1,541,917.65	0.57
21	688702	盛科通信	10,880	1,541,587.20	0.57
22	688303	大全能源	55,149	1,479,096.18	0.55
23	688361	中科飞测	9,445	1,444,990.55	0.53
24	688120	华海清科	9,549	1,433,113.92	0.53
25	688525	佰维存储	12,395	1,422,822.05	0.53
26	688375	国博电子	15,164	1,411,920.04	0.52
27	688047	龙芯中科	10,630	1,404,329.30	0.52
28	688223	晶科能源	243,239	1,371,867.96	0.51
29	688585	上纬新材	10,694	1,362,094.78	0.50
30	688469	芯联集成	203,462	1,361,160.78	0.50

31	688472	阿特斯	89,429	1,333,386.39	0.49
32	688578	艾力斯	11,962	1,245,842.30	0.46
33	688122	西部超导	16,606	1,238,475.48	0.46
34	688002	睿创微纳	12,214	1,231,171.20	0.45
35	688629	华丰科技	12,251	1,225,835.06	0.45
36	688568	中科星图	20,677	1,219,943.00	0.45
37	688347	华虹公司	10,818	1,166,937.66	0.43
38	688009	中国通号	209,256	1,144,630.32	0.42
39	688187	时代电气	22,271	1,142,279.59	0.42
40	688676	金盘科技	12,177	1,100,070.18	0.41
41	688608	恒玄科技	4,818	1,093,396.92	0.40
42	688169	石头科技	7,137	1,085,252.22	0.40
43	688188	柏楚电子	7,968	1,082,771.52	0.40
44	688313	仕佳光子	12,153	1,078,943.34	0.40
45	688387	信科移动	83,200	1,073,280.00	0.40
46	688172	燕东微	36,613	1,059,580.22	0.39
47	688019	安集科技	4,814	1,049,066.88	0.39
48	688778	厦钨新能	13,442	1,040,007.54	0.38
49	688385	复旦微电	14,111	1,039,980.70	0.38
50	689009	九号公司	18,361	1,020,687.99	0.38
51	688234	天岳先进	11,398	1,013,054.24	0.37
52	688213	思特威	10,646	1,012,328.14	0.37
53	688777	中控技术	20,255	999,381.70	0.37
54	688617	惠泰医疗	4,060	987,676.20	0.36
55	688099	晶晨股份	11,172	974,533.56	0.36
56	688017	绿的谐波	5,021	964,534.10	0.36
57	688322	奥比中光	10,619	952,205.73	0.35
58	688235	百济神州	3,519	945,203.40	0.35
59	688728	格科微	63,109	942,848.46	0.35
60	688336	三生国健	15,730	937,036.10	0.35
61	688318	财富趋势	7,045	932,194.40	0.34
62	688599	天合光能	56,029	927,279.95	0.34
63	688065	凯赛生物	18,475	920,055.00	0.34
64	688220	翱捷科技	11,080	915,318.80	0.34
65	688278	特宝生物	10,821	905,501.28	0.33
66	688615	合合信息	3,975	904,630.50	0.33
67	688692	达梦数据	3,415	892,237.05	0.33
68	688538	和辉光电	334,643	890,150.38	0.33
69	688333	铂力特	7,574	844,576.74	0.31
70	688297	中无人机	17,244	828,056.88	0.31
71	688819	天能股份	24,882	826,580.04	0.31
72	688037	芯源微	5,521	819,923.71	0.30
73	688018	乐鑫科技	4,769	810,730.00	0.30

74	688349	三一重能	31,472	795,612.16	0.29
75	688200	华峰测控	4,111	781,912.20	0.29
76	688147	微导纳米	12,234	768,172.86	0.28
77	688102	斯瑞新材	19,782	766,354.68	0.28
78	688295	中复神鹰	23,079	757,221.99	0.28
79	688709	成都华微	16,280	748,717.20	0.28
80	688331	荣昌生物	9,597	746,550.63	0.28
81	688343	云天励飞	9,680	736,454.40	0.27
82	688433	华曙高科	11,015	728,862.55	0.27
83	688270	臻镭科技	5,871	716,672.97	0.26
84	688192	迪哲医药	12,240	705,024.00	0.26
85	688582	芯动联科	10,644	703,674.84	0.26
86	688563	航材股份	11,964	699,295.80	0.26
87	688266	泽璟制药	7,294	676,153.80	0.25
88	688180	君实生物	19,642	670,970.72	0.25
89	688114	华大智造	11,035	670,486.60	0.25
90	688195	腾景科技	3,921	664,805.55	0.25
91	688248	南网科技	14,832	663,583.68	0.24
92	688708	佳驰科技	10,629	661,655.25	0.24
93	688425	铁建重工	129,530	656,717.10	0.24
94	688005	容百科技	18,387	650,899.80	0.24
95	688052	纳芯微	4,090	646,956.20	0.24
96	688536	思瑞浦	3,970	634,723.60	0.23
97	688208	道通科技	17,084	628,691.20	0.23
98	688772	珠海冠宇	29,081	626,113.93	0.23
99	688205	德科立	4,512	620,309.76	0.23
100	688561	奇安信	17,434	620,301.72	0.23
101	688627	精智达	2,757	616,437.63	0.23
102	688475	萤石网络	20,195	608,071.45	0.22
103	688502	茂莱光学	1,517	605,358.85	0.22
104	688523	航天环宇	10,791	603,864.36	0.22
105	688048	长光华芯	4,794	600,927.90	0.22
106	688301	奕瑞科技	5,783	584,719.13	0.22
107	688660	电气风电	34,100	580,041.00	0.21
108	688698	伟创电气	5,849	578,349.12	0.21
109	688409	富创精密	8,460	570,204.00	0.21
110	688279	峰昭科技	2,792	568,144.08	0.21
111	688123	聚辰股份	4,517	567,244.86	0.21
112	688146	中船特气	13,874	560,509.60	0.21
113	688363	华熙生物	12,772	557,880.96	0.21
114	688281	华秦科技	7,527	555,492.60	0.21
115	688449	联芸科技	12,205	551,421.90	0.20
116	688166	博瑞医药	11,203	549,619.18	0.20

117	688766	普冉股份	4,255	541,278.55	0.20
118	688630	芯碁微装	3,993	537,178.29	0.20
119	688088	虹软科技	10,649	527,125.50	0.19
120	688353	华盛锂电	4,606	523,702.20	0.19
121	688141	杰华特	11,995	520,942.85	0.19
122	688519	南亚新材	6,442	520,900.12	0.19
123	688400	凌云光	12,261	519,621.18	0.19
124	688100	威胜信息	13,064	513,415.20	0.19
125	688520	神州细胞	11,846	513,050.26	0.19
126	688668	鼎通科技	4,015	497,860.00	0.18
127	688567	孚能科技	31,423	491,769.95	0.18
128	688548	广钢气体	33,807	491,553.78	0.18
129	688798	艾为电子	6,411	487,941.21	0.18
130	688332	中科蓝讯	3,680	483,220.80	0.18
131	688652	京仪装备	4,781	470,020.11	0.17
132	688800	瑞可达	5,644	468,452.00	0.17
133	688116	天奈科技	9,916	467,539.40	0.17
134	688686	奥普特	3,731	463,129.03	0.17
135	688388	嘉元科技	11,286	462,500.28	0.17
136	688484	南芯科技	11,372	462,385.52	0.17
137	688372	伟测科技	4,209	459,159.81	0.17
138	688167	炬光科技	2,596	454,481.72	0.17
139	688006	杭可科技	15,405	451,212.45	0.17
140	688097	博众精工	11,873	448,205.75	0.17
141	688068	热景生物	2,666	431,892.00	0.16
142	688153	唯捷创芯	11,403	429,208.92	0.16
143	688198	佰仁医疗	3,965	424,294.65	0.16
144	688029	南微医学	5,152	420,197.12	0.16
145	688131	皓元医药	5,808	418,640.64	0.15
146	688127	蓝特光学	10,789	415,268.61	0.15
147	688390	固德威	6,683	415,214.79	0.15
148	688300	联瑞新材	6,645	412,588.05	0.15
149	688326	经纬恒润	3,465	407,137.50	0.15
150	688503	聚和材料	6,671	406,931.00	0.15
151	688062	迈威生物	10,575	406,820.25	0.15
152	688160	步科股份	2,660	405,650.00	0.15
153	688025	杰普特	2,838	401,775.66	0.15
154	688789	宏华数科	4,919	401,242.83	0.15
155	688206	概伦电子	11,519	401,206.77	0.15
156	688382	益方生物	14,682	399,937.68	0.15
157	688031	星环科技	3,674	397,490.06	0.15
158	688432	有研硅	32,007	397,206.87	0.15
159	688392	骄成超声	3,527	395,729.40	0.15

160	688516	奥特维	8,697	393,626.22	0.15
161	688726	拉普拉斯	10,734	386,424.00	0.14
162	688352	顾中科技	30,601	385,878.61	0.14
163	688327	云从科技	26,676	383,334.12	0.14
164	688063	派能科技	6,741	383,023.62	0.14
165	688032	禾迈股份	3,766	379,575.14	0.14
166	688228	开普云	1,948	379,100.28	0.14
167	688584	上海合晶	17,036	373,769.84	0.14
168	688691	灿芯股份	3,649	372,125.02	0.14
169	688779	五矿新能	49,587	371,406.63	0.14
170	688612	威迈斯	11,118	366,560.46	0.14
171	688306	均普智能	31,588	366,420.80	0.14
172	688403	汇成股份	22,043	361,064.34	0.13
173	688001	华兴源创	11,857	357,844.26	0.13
174	688605	先锋精科	5,547	356,450.22	0.13
175	688543	国科军工	5,730	355,661.10	0.13
176	688439	振华风光	5,476	353,749.60	0.13
177	688239	航宇科技	5,227	353,711.09	0.13
178	688362	甬矽电子	10,909	353,560.69	0.13
179	688549	中巨芯	37,955	346,149.60	0.13
180	688016	心脉医疗	3,753	343,999.98	0.13
181	688380	中微半导	10,582	340,211.30	0.13
182	688158	优刻得	12,071	339,074.39	0.13
183	688233	神工股份	4,831	338,314.93	0.12
184	688190	云路股份	3,465	337,491.00	0.12
185	688522	纳睿雷达	8,405	335,611.65	0.12
186	688776	国光电气	3,312	333,650.88	0.12
187	688165	埃夫特	13,934	331,071.84	0.12
188	688083	中望软件	4,855	330,674.05	0.12
189	688552	航天南湖	9,075	329,604.00	0.12
190	688577	浙海德曼	3,396	328,936.56	0.12
191	688559	海目星	6,801	326,856.06	0.12
192	688050	爱博医疗	5,297	321,316.02	0.12
193	688631	莱斯信息	4,687	319,090.96	0.12
194	688125	安达智能	2,359	318,582.95	0.12
195	688321	微芯生物	10,780	314,991.60	0.12
196	688182	灿勤科技	10,636	313,974.72	0.12
197	688003	天准科技	5,319	313,289.10	0.12
198	688128	中国电研	10,757	312,813.56	0.12
199	688531	日联科技	4,731	312,387.93	0.12
200	688368	晶丰明源	2,680	309,352.40	0.11
201	688109	品茗科技	2,413	306,692.30	0.11
202	688656	浩欧博	1,984	305,139.20	0.11

203	688788	科思科技	4,489	302,289.26	0.11
204	688486	龙迅股份	4,060	301,698.60	0.11
205	688513	苑东生物	4,834	297,532.70	0.11
206	688161	威高骨科	10,582	295,449.44	0.11
207	688700	东威科技	8,263	291,518.64	0.11
208	688055	龙腾光电	80,857	291,085.20	0.11
209	688351	微电生理	12,531	290,092.65	0.11
210	688261	东微半导	3,536	289,987.36	0.11
211	688107	安路科技	10,662	289,793.16	0.11
212	688150	莱特光电	10,658	288,085.74	0.11
213	688603	天承科技	3,806	285,297.76	0.11
214	688535	华海诚科	2,544	285,131.52	0.11
215	688093	世华科技	7,709	284,076.65	0.10
216	688739	成大生物	11,017	283,797.92	0.10
217	688258	卓易信息	3,693	282,773.01	0.10
218	688717	艾罗能源	4,587	282,559.20	0.10
219	688275	万润新能	3,743	282,222.20	0.10
220	688591	泰凌微	6,617	281,619.52	0.10
221	688289	圣湘生物	14,772	279,338.52	0.10
222	688139	海尔生物	8,780	279,028.40	0.10
223	688499	利元亨	4,812	277,748.64	0.10
224	688626	翔宇医疗	4,586	277,453.00	0.10
225	688262	国芯科技	9,105	276,336.75	0.10
226	688690	纳微科技	10,706	276,321.86	0.10
227	688028	沃尔德	4,266	275,327.64	0.10
228	688507	索辰科技	2,733	274,092.57	0.10
229	688319	欧林生物	10,757	272,797.52	0.10
230	688443	智翔金泰	9,929	270,465.96	0.10
231	688658	悦康药业	11,912	269,330.32	0.10
232	688091	上海谊众	5,673	266,631.00	0.10
233	688586	江航装备	20,203	263,447.12	0.10
234	688596	正帆科技	8,170	258,417.10	0.10
235	688401	路维光电	5,285	257,960.85	0.10
236	688210	统联精密	4,636	256,463.52	0.09
237	688562	航天软件	10,639	254,059.32	0.09
238	688230	芯导科技	3,504	253,969.92	0.09
239	688177	百奥泰	10,975	253,961.50	0.09
240	688408	中信博	6,001	252,702.11	0.09
241	688539	高华科技	5,101	252,550.51	0.09
242	688106	金宏气体	12,819	251,124.21	0.09
243	688049	炬芯科技	4,772	251,007.20	0.09
244	688222	成都先导	10,598	248,523.10	0.09
245	688305	科德数控	4,010	247,818.00	0.09

246	688515	裕太微	2,412	247,350.60	0.09
247	688593	新相微	12,165	245,489.70	0.09
248	688138	清溢光电	8,701	245,020.16	0.09
249	688750	金天钛业	12,223	244,093.31	0.09
250	688508	芯朋微	4,004	243,843.60	0.09
251	688556	高测股份	21,164	241,692.88	0.09
252	688648	中邮科技	3,909	240,247.14	0.09
253	688257	新锐股份	6,984	239,411.52	0.09
254	688066	航天宏图	7,194	234,236.64	0.09
255	688696	极米科技	2,099	233,996.52	0.09
256	688095	福昕软件	2,621	233,976.67	0.09
257	688685	迈信林	4,210	233,570.80	0.09
258	688366	昊海生科	5,311	233,152.90	0.09
259	688155	先惠技术	3,854	232,974.30	0.09
260	688325	赛微微电	2,661	232,917.33	0.09
261	688383	新益昌	2,952	231,053.04	0.09
262	688456	有研粉材	2,969	230,691.30	0.09
263	688252	天德钰	10,865	230,012.05	0.08
264	688209	英集芯	11,527	229,848.38	0.08
265	688418	震有科技	5,283	229,704.84	0.08
266	688202	美迪西	4,065	229,266.00	0.08
267	688386	泛亚微透	2,607	228,373.20	0.08
268	688007	光峰科技	12,191	226,386.87	0.08
269	688661	和林微纳	4,355	225,414.80	0.08
270	688348	昱能科技	4,473	225,394.47	0.08
271	688639	华恒生物	6,878	224,085.24	0.08
272	688611	杭州柯林	4,406	224,045.10	0.08
273	688550	瑞联新材	4,941	223,876.71	0.08
274	688376	美埃科技	3,869	223,705.58	0.08
275	688518	联赢激光	9,200	223,468.00	0.08
276	688232	新点软件	8,901	220,922.82	0.08
277	688311	盟升电子	4,794	218,606.40	0.08
278	688196	卓越新能	3,706	218,283.40	0.08
279	688622	禾信仪器	2,122	214,597.86	0.08
280	688575	亚辉龙	15,030	213,426.00	0.08
281	688059	华锐精密	2,708	213,119.60	0.08
282	688227	品高股份	3,268	212,452.68	0.08
283	688625	呈和科技	5,154	212,344.80	0.08
284	688570	天玛智控	11,448	210,872.16	0.08
285	688108	赛诺医疗	10,943	210,543.32	0.08
286	688105	诺唯赞	10,508	210,370.16	0.08
287	688636	智明达	4,905	210,130.20	0.08
288	688268	华特气体	3,657	209,875.23	0.08

289	688787	海天瑞声	1,802	209,013.98	0.08
290	688276	百克生物	11,036	208,138.96	0.08
291	688185	康希诺	3,301	207,467.85	0.08
292	688225	亚信安全	10,618	205,989.20	0.08
293	688191	智洋创新	6,362	204,729.16	0.08
294	688621	阳光诺和	3,244	201,614.60	0.07
295	688553	汇宇制药	11,209	199,408.11	0.07
296	688359	三孚新科	2,956	196,958.28	0.07
297	688377	迪威尔	5,354	196,491.80	0.07
298	688035	德邦科技	4,065	196,136.25	0.07
299	688143	长盈通	3,901	195,869.21	0.07
300	688337	普源精电	5,283	194,889.87	0.07
301	688011	新光光电	3,051	194,775.84	0.07
302	688510	航亚科技	7,098	190,936.20	0.07
303	688151	华强科技	9,235	190,425.70	0.07
304	688226	威腾电气	5,132	190,397.20	0.07
305	688365	光云科技	11,238	189,585.06	0.07
306	688720	艾森股份	2,691	189,392.58	0.07
307	688526	科前生物	12,361	188,628.86	0.07
308	688707	振华新材	13,583	188,124.55	0.07
309	688378	奥来德	6,880	187,824.00	0.07
310	688697	纽威数控	12,143	186,759.34	0.07
311	688711	宏微科技	5,869	186,223.37	0.07
312	688084	晶品特装	2,221	183,898.80	0.07
313	688277	天智航	12,058	183,161.02	0.07
314	688488	艾迪药业	11,171	182,422.43	0.07
315	688221	前沿生物	10,080	181,944.00	0.07
316	688799	华纳药厂	3,809	181,689.30	0.07
317	688236	XD 春立医	7,932	181,484.16	0.07
318	688710	益诺思	4,071	179,734.65	0.07
319	688721	龙图光罩	3,861	179,652.33	0.07
320	688219	会通股份	14,446	179,419.32	0.07
321	688231	隆达股份	6,800	176,800.00	0.07
322	688103	国力电子	2,909	176,256.31	0.07
323	688290	景业智能	2,957	175,764.08	0.06
324	688186	广大特材	7,713	174,930.84	0.06
325	688136	科兴制药	5,500	174,185.00	0.06
326	688678	福立旺	7,155	173,007.90	0.06
327	688601	力芯微	4,026	171,467.34	0.06
328	688293	奥浦迈	3,491	171,059.00	0.06
329	688112	鼎阳科技	4,552	170,472.40	0.06
330	688212	澳华内镜	3,898	170,381.58	0.06
331	688117	圣诺生物	4,503	170,168.37	0.06

332	688334	西高院	8,768	169,748.48	0.06
333	688598	金博股份	5,685	166,911.60	0.06
334	688371	菲沃泰	9,023	166,654.81	0.06
335	688046	药康生物	10,822	166,225.92	0.06
336	688176	亚虹医药	14,435	166,146.85	0.06
337	688399	硕世生物	2,422	165,907.00	0.06
338	688090	瑞松科技	3,709	164,976.32	0.06
339	688168	安博通	2,192	164,750.72	0.06
340	688087	英科再生	5,330	164,270.60	0.06
341	688566	吉贝尔	5,468	163,219.80	0.06
342	688623	二元科技	1,738	163,198.20	0.06
343	688085	三友医疗	9,020	162,540.40	0.06
344	688157	松井股份	4,476	162,165.48	0.06
345	688767	博拓生物	4,280	161,698.40	0.06
346	688119	中钢洛耐	28,869	161,377.71	0.06
347	688020	方邦股份	2,371	161,275.42	0.06
348	688282	理工导航	2,526	160,401.00	0.06
349	688173	希荻微	10,904	160,288.80	0.06
350	688320	禾川科技	4,292	160,177.44	0.06
351	688733	壹石通	5,496	159,274.08	0.06
352	688073	毕得医药	2,602	158,852.10	0.06
353	688663	新风光	4,092	158,646.84	0.06
354	688716	中研股份	3,730	157,965.50	0.06
355	688023	安恒信息	3,056	157,108.96	0.06
356	688677	海泰新光	3,624	156,411.84	0.06
357	688719	爱科赛博	3,522	155,496.30	0.06
358	688682	霍莱沃	2,937	155,396.67	0.06
359	688135	利扬芯片	5,593	155,261.68	0.06
360	688381	帝奥微	6,800	155,108.00	0.06
361	688360	德马科技	7,215	153,390.90	0.06
362	688489	三未信安	3,329	152,168.59	0.06
363	688588	凌志软件	10,610	151,829.10	0.06
364	688428	诺诚健华	7,395	151,745.40	0.06
365	688269	凯立新材	3,781	151,277.81	0.06
366	688480	赛恩斯	2,925	150,608.25	0.06
367	688379	华光新材	2,735	150,589.10	0.06
368	688505	复旦张江	18,106	150,279.80	0.06
369	688075	安旭生物	3,874	149,807.58	0.06
370	688197	首药控股	4,259	147,957.66	0.05
371	688581	安杰思	2,522	147,864.86	0.05
372	688315	诺禾致源	11,128	147,779.84	0.05
373	688478	晶升股份	3,946	147,619.86	0.05
374	688101	三达膜	8,936	146,907.84	0.05

375	688389	普门科技	11,313	146,842.74	0.05
376	688330	宏力达	4,060	146,687.80	0.05
377	688302	海创药业	2,983	146,674.11	0.05
378	688356	键凯科技	1,782	146,480.40	0.05
379	688606	奥泰生物	2,283	145,860.87	0.05
380	688339	亿华通	5,370	144,775.20	0.05
381	688039	当虹科技	3,205	143,423.75	0.05
382	688010	福光股份	4,592	142,903.04	0.05
383	688580	伟思医疗	2,948	142,683.20	0.05
384	688665	四方光电	2,923	142,554.71	0.05
385	688283	坤恒顺维	3,532	142,339.60	0.05
386	688259	创耀科技	3,402	142,203.60	0.05
387	688683	莱尔科技	4,475	141,857.50	0.05
388	688308	欧科亿	4,431	140,196.84	0.05
389	688070	纵横股份	2,529	140,106.60	0.05
390	688699	明微电子	3,288	139,772.88	0.05
391	688662	富信科技	2,709	138,836.25	0.05
392	688312	燕麦科技	4,178	138,626.04	0.05
393	688429	时创能源	10,543	138,007.87	0.05
394	688653	康希通信	11,350	137,902.50	0.05
395	688512	慧智微	12,329	137,591.64	0.05
396	688609	九联科技	13,364	136,446.44	0.05
397	688533	上声电子	4,653	136,053.72	0.05
398	688267	中触媒	4,804	135,328.68	0.05
399	688595	芯海科技	4,109	134,775.20	0.05
400	688237	超卓航科	2,758	134,452.50	0.05
401	688590	新致软件	7,199	134,333.34	0.05
402	688299	长阳科技	7,912	133,871.04	0.05
403	688410	山外山	8,903	133,277.91	0.05
404	688500	慧辰股份	2,151	132,845.76	0.05
405	688416	恒烁股份	2,406	132,642.78	0.05
406	688291	金橙子	3,097	132,303.84	0.05
407	688292	浩瀚深度	4,512	130,848.00	0.05
408	688215	瑞晟智能	1,799	130,445.49	0.05
409	688273	麦澜德	3,065	130,323.80	0.05
410	688298	东方生物	5,547	129,966.21	0.05
411	688280	精进电动	14,927	129,864.90	0.05
412	688201	信安世纪	8,842	129,358.46	0.05
413	688610	埃科光电	2,085	128,873.85	0.05
414	688458	美芯晟	3,243	128,552.52	0.05
415	688159	有方科技	2,657	128,439.38	0.05
416	688286	敏芯股份	1,626	128,372.70	0.05
417	688569	铁科轨道	5,763	126,613.11	0.05

418	688175	高凌信息	3,903	125,715.63	0.05
419	688620	安凯微	10,437	125,661.48	0.05
420	688181	八亿时空	3,883	125,498.56	0.05
421	688253	英诺特	4,132	124,703.76	0.05
422	688115	思林杰	1,900	124,602.00	0.05
423	688459	哈铁科技	12,886	124,349.90	0.05
424	688152	麒麟信安	3,066	123,713.10	0.05
425	688079	美迪凯	10,813	122,403.16	0.05
426	688687	凯因科技	4,889	121,833.88	0.04
427	688162	巨一科技	3,912	120,489.60	0.04
428	688722	同益中	6,152	120,271.60	0.04
429	688013	天臣医疗	2,490	119,719.20	0.04
430	688602	康鹏科技	13,744	119,297.92	0.04
431	688148	芳源股份	13,509	118,473.93	0.04
432	688015	交控科技	5,186	118,137.08	0.04
433	688211	中科微至	3,811	117,378.80	0.04
434	688558	国盛智科	4,041	116,906.13	0.04
435	688247	宣泰医药	12,051	116,894.70	0.04
436	688255	凯尔达	3,191	116,886.33	0.04
437	688768	容知日新	2,683	116,549.52	0.04
438	688607	康众医疗	2,713	116,116.40	0.04
439	688786	悦安新材	4,111	115,971.31	0.04
440	688171	纬德信息	2,468	115,156.88	0.04
441	688435	英方软件	2,458	114,960.66	0.04
442	688061	灿瑞科技	3,506	114,330.66	0.04
443	688081	兴图新科	3,166	114,229.28	0.04
444	688033	天宜新材	14,823	114,137.10	0.04
445	688579	山大地纬	10,548	113,707.44	0.04
446	688557	兰剑智能	3,111	113,333.73	0.04
447	688089	嘉必优	4,849	112,884.72	0.04
448	688179	阿拉丁	8,984	112,210.16	0.04
449	688689	银河微电	3,948	112,044.24	0.04
450	688307	中润光学	2,560	110,617.60	0.04
451	688335	复洁科技	4,099	110,509.04	0.04
452	688238	和元生物	16,546	110,196.36	0.04
453	688323	瑞华泰	4,893	110,141.43	0.04
454	688509	正元地信	19,948	109,514.52	0.04
455	688199	久日新材	4,646	109,506.22	0.04
456	688207	格灵深瞳	7,137	108,482.40	0.04
457	688080	映翰通	2,147	108,423.50	0.04
458	688317	之江生物	5,274	106,376.58	0.04
459	688448	磁谷科技	2,194	106,343.18	0.04
460	688667	菱电电控	1,506	106,052.52	0.04

461	688260	昀冢科技	3,672	105,753.60	0.04
462	688244	永信至诚	4,323	105,654.12	0.04
463	688077	大地熊	3,458	105,641.90	0.04
464	688679	通源环境	3,969	105,575.40	0.04
465	688133	泰坦科技	4,747	105,098.58	0.04
466	688657	浩辰软件	1,965	104,557.65	0.04
467	688628	优利德	3,251	103,511.84	0.04
468	688358	祥生医疗	3,438	103,483.80	0.04
469	688600	皖仪科技	4,071	101,978.55	0.04
470	688373	盟科药业	16,676	100,723.04	0.04
471	688357	建龙微纳	3,044	100,604.20	0.04
472	688651	盛邦安全	2,253	99,177.06	0.04
473	688501	青达环保	3,739	98,821.77	0.04
474	688633	星球石墨	4,161	98,532.48	0.04
475	688680	海优新材	2,561	97,958.25	0.04
476	688098	申联生物	11,023	97,884.24	0.04
477	688370	丛麟科技	4,001	97,504.37	0.04
478	688455	科捷智能	4,840	97,235.60	0.04
479	688265	南模生物	2,350	96,373.50	0.04
480	688589	力合微	4,195	95,436.25	0.04
481	688345	博力威	3,039	94,816.80	0.03
482	688551	科威尔	2,573	94,763.59	0.03
483	688592	司南导航	2,293	94,242.30	0.03
484	688170	德龙激光	2,992	94,128.32	0.03
485	688391	钜泉科技	3,296	93,375.68	0.03
486	688057	金达莱	7,591	92,762.02	0.03
487	688419	耐科装备	3,313	92,730.87	0.03
488	688246	嘉和美康	3,966	92,209.50	0.03
489	688350	富淼科技	3,583	92,190.59	0.03
490	688251	井松智能	3,076	90,434.40	0.03
491	688316	青云科技	1,485	89,352.45	0.03
492	688030	山石网科	4,907	89,160.19	0.03
493	688618	三旺通信	3,337	88,964.42	0.03
494	688529	豪森智能	4,788	88,290.72	0.03
495	688051	佳华科技	2,224	88,092.64	0.03
496	688071	华依科技	2,625	87,071.25	0.03
497	688285	高铁电气	9,923	86,131.64	0.03
498	688369	致远互联	3,337	84,859.91	0.03
499	688571	杭华股份	11,298	84,170.10	0.03
500	688045	必易微	2,171	83,995.99	0.03
501	688613	奥精医疗	4,128	83,839.68	0.03
502	688693	锆威特	2,232	83,566.08	0.03
503	688338	赛科希德	3,217	83,255.96	0.03

504	688367	工大高科	2,670	82,663.20	0.03
505	688669	聚石化学	3,551	82,525.24	0.03
506	688398	赛特新材	4,799	81,583.00	0.03
507	688288	鸿泉技术	3,032	81,287.92	0.03
508	688426	康为世纪	3,397	80,950.51	0.03
509	688314	康拓医疗	2,441	80,699.46	0.03
510	688137	近岸蛋白	2,004	80,260.20	0.03
511	688328	深科达	2,749	80,215.82	0.03
512	688229	博睿数据	1,268	79,478.24	0.03
513	688576	西山科技	1,262	79,455.52	0.03
514	688560	明冠新材	5,554	79,366.66	0.03
515	688468	科美诊断	10,761	78,985.74	0.03
516	688737	中自科技	3,472	77,911.68	0.03
517	688218	江苏北人	3,401	77,610.82	0.03
518	688132	邦彦技术	4,186	77,106.12	0.03
519	688485	九州一轨	4,306	76,819.04	0.03
520	688670	金迪克	3,789	76,651.47	0.03
521	688530	欧莱新材	4,649	76,429.56	0.03
522	688069	德林海	3,392	76,082.56	0.03
523	688113	联测科技	1,912	75,581.36	0.03
524	688479	友车科技	3,985	75,037.55	0.03
525	688310	迈得医疗	4,817	73,844.61	0.03
526	688130	晶华微	3,523	73,771.62	0.03
527	688060	云涌科技	1,742	73,738.86	0.03
528	688118	普元信息	2,848	72,680.96	0.03
529	688597	煜邦电力	8,829	72,486.09	0.03
530	688022	瀚川智能	4,724	72,277.20	0.03
531	688203	海正生材	5,638	72,053.64	0.03
532	688129	东来技术	3,536	71,533.28	0.03
533	688272	富吉瑞	2,178	71,133.48	0.03
534	688496	清越科技	11,894	70,650.36	0.03
535	688216	气派科技	3,142	70,003.76	0.03
536	688619	罗普特	5,111	69,509.60	0.03
537	688655	迅捷兴	4,043	69,256.59	0.03
538	688163	赛伦生物	3,166	68,923.82	0.03
539	688121	卓然股份	6,239	68,129.88	0.03
540	688393	安必平	2,848	67,469.12	0.02
541	688056	莱伯泰科	1,990	66,883.90	0.02
542	688695	中创股份	2,430	66,654.90	0.02
543	688058	宝兰德	2,400	65,352.00	0.02
544	688026	洁特生物	4,031	64,939.41	0.02
545	688355	明志科技	3,576	63,652.80	0.02
546	688395	正弦电气	2,608	63,426.56	0.02

547	688573	信宇人	2,773	63,196.67	0.02
548	688178	万德斯	2,616	62,862.48	0.02
549	688517	金冠电气	4,018	62,640.62	0.02
550	688092	爱科科技	2,490	62,598.60	0.02
551	688638	誉辰智能	1,711	62,160.63	0.02
552	688718	唯赛勃	4,740	61,999.20	0.02
553	688420	美腾科技	2,593	61,894.91	0.02
554	688078	龙软科技	2,212	60,830.00	0.02
555	688189	南新制药	7,604	60,603.88	0.02
556	688466	金科环境	3,721	60,540.67	0.02
557	688193	仁度生物	1,246	60,269.02	0.02
558	688616	西力科技	4,905	59,988.15	0.02
559	688038	中科通达	3,369	59,530.23	0.02
560	688671	碧兴物联	2,383	59,026.91	0.02
561	688309	恒誉环保	2,440	58,877.20	0.02
562	688004	博汇科技	2,453	56,737.89	0.02
563	688681	科汇股份	3,170	55,728.60	0.02
564	688450	光格科技	1,990	54,884.20	0.02
565	688793	倍轻松	2,516	54,848.80	0.02
566	688096	京源环保	6,484	51,223.60	0.02
567	688329	艾隆科技	2,362	50,286.98	0.02
568	688067	爱威科技	2,040	50,102.40	0.02
569	688528	秦川物联	4,639	49,962.03	0.02
570	688565	力源科技	4,179	46,763.01	0.02
571	688156	路德科技	2,876	46,044.76	0.02
572	688659	元琛科技	4,672	44,150.40	0.02
573	688296	和达科技	3,286	43,539.50	0.02
574	688217	睿昂基因	1,618	42,634.30	0.02
575	688021	奥福科技	2,252	41,324.20	0.02
576	688701	卓锦股份	3,887	31,679.05	0.01

8.3.2 期末积极投资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	688795	摩尔线程	1,083	450,549.66	0.17
2	688802	沐曦股份	799	319,120.60	0.12
3	688759	必贝特	2,218	55,693.98	0.02
4	688790	昂瑞微	194	22,734.86	0.01
5	688809	强一股份	89	18,094.59	0.01
6	688727	恒坤新材	484	16,877.08	0.01
7	688807	优迅股份	121	16,402.76	0.01
8	688796	百奥赛图	271	11,449.75	0.00
9	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00

10	603092	德力佳	94	5,232.04	0.00
11	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
12	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
13	603334	丰倍生物	88	2,888.16	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	20,281,300.18	7.49
2	688041	海光信息	19,264,135.10	7.11
3	688981	中芯国际	8,744,422.34	3.23
4	688012	中微公司	6,008,320.84	2.22
5	688008	澜起科技	5,536,778.72	2.04
6	688111	金山办公	5,403,778.44	1.99
7	688506	百利天恒	5,381,989.25	1.99
8	688271	联影医疗	4,511,233.62	1.67
9	688775	影石创新	4,328,790.26	1.60
10	688036	传音控股	3,746,795.67	1.38
11	688521	芯原股份	3,297,267.48	1.22
12	688082	盛美上海	3,014,614.05	1.11
13	688183	生益电子	2,696,402.98	1.00
14	688126	沪硅产业	2,632,836.87	0.97
15	688396	华润微	2,575,488.00	0.95
16	688249	晶合集成	2,321,899.89	0.86
17	688072	拓荆科技	2,308,809.65	0.85
18	688303	大全能源	2,291,255.50	0.85
19	688047	龙芯中科	2,113,501.63	0.78
20	688223	晶科能源	2,065,053.42	0.76

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	5,678,234.55	2.10
2	688041	海光信息	5,407,736.89	2.00
3	688981	中芯国际	2,623,571.07	0.97
4	688111	金山办公	1,753,888.85	0.65
5	688008	澜起科技	1,724,904.60	0.64
6	688506	百利天恒	1,375,361.46	0.51
7	688012	中微公司	1,339,272.09	0.49
8	688271	联影医疗	1,274,531.09	0.47

9	688183	生益电子	1,190,246.77	0.44
10	688775	影石创新	1,115,746.06	0.41
11	688036	传音控股	959,276.45	0.35
12	688082	盛美上海	879,557.93	0.32
13	688249	晶合集成	796,628.42	0.29
14	688396	华润微	792,411.77	0.29
15	688472	阿特斯	784,600.44	0.29
16	688126	沪硅产业	745,263.60	0.28
17	688072	拓荆科技	743,782.34	0.27
18	688521	芯原股份	730,384.24	0.27
19	688525	佰维存储	723,491.15	0.27
20	688122	西部超导	721,196.77	0.27

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	344,144,416.03
卖出股票收入（成交）总额	95,405,789.42

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	6,060,578.63	2.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	93,697.21	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,154,275.84	2.27

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

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	019773	25 国债 08	60,000	6,060,578.63	2.24
2	118063	金 05 转债	500	50,000.77	0.02
3	118061	茂莱转债	180	43,696.44	0.02

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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**

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金国债期货投资情况符合既定的投资政策和投资目的。

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**

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

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

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	167,874.09
2	应收清算款	2,148,981.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,000.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,324,855.85
---	----	--------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资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	688012	中微公司	5,288,532.50	1.95	新股流通受限

8.12.5.2 期末积极投资前五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	688795	摩尔线程	450,549.66	0.17	新股锁定
2	688802	沐曦股份	319,120.60	0.12	新股锁定
3	688759	必贝特	55,693.98	0.02	新股锁定
4	688790	昂瑞微	22,734.86	0.01	新股锁定
5	688809	强一股份	18,094.59	0.01	新股锁定

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
长城上证科创板综合指数 A	1,292	161,040.56	1,885,516.55	0.91	206,178,887.53	99.09
长城上证科创板综合指数 C	1,077	57,785.64	2,000,166.67	3.21	60,234,965.55	96.79

合计	2,369	114,098.58	3,885,683.22	1.44	266,413,853.08	98.56
----	-------	------------	--------------	------	----------------	-------

注：上述机构/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）。

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	长城上证科创板综合指数 A	10,053.77	0.0048
	长城上证科创板综合指数 C	-	-
	合计	10,053.77	0.0037

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长城上证科创板综合指数 A	0
	长城上证科创板综合指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城上证科创板综合指数 A	0
	长城上证科创板综合指数 C	0
	合计	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本报告期期末无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
基金合同生效日	459,476,443.77	104,654,838.41

(2025 年 8 月 28 日) 基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	2,306,591.70	4,759,905.04
减: 基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	253,718,631.39	47,179,611.23
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	208,064,404.08	62,235,132.22

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动:

(1) 自 2025 年 12 月 4 日起, 车君女士不再担任公司副总经理。

(2) 期后事项: 自 2026 年 3 月 25 日起, 邱春杨不再担任公司总经理, 聘任祝函为公司总经理, 同时解聘其公司督察长职务。在公司新任督察长正式任职之前, 由祝函代为履行公司督察长职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

2025 年 2 月, 中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月, 中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月, 中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月, 中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为 38,000.00 元人民币。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

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

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 31 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理相关品类产品注册申请 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已按照相关要求完成了优化相关制度流程等整改工作，并经相关机构验收通过
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 10 月 27 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会深圳监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已按照相关要求完成了优化相关制度流程等整改工作，并经相关机构验收通过
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受稽查或处罚等情况。

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	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	1	380,610,595.77	86.76	74,583.20	86.77	本期报告新增1个
国泰海通	2	41,010,221.33	9.35	8,035.84	9.35	本期报告新增2个
招商证券	2	17,048,207.77	3.89	3,340.54	3.89	本期报告新增2个
财信证券	2	-	-	-	-	本期报告新增2个
长城证券	3	-	-	-	-	本期报告新增3个
长江证券	1	-	-	-	-	本期报告新增1个
大同证券	-	-	-	-	-	本报告期新增1个、本报告期退租1个
德邦证券	2	-	-	-	-	本期报告新增2个

东方财富	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
东方证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
东兴证券	-	-	-	-	-	本报告期新增 1 个、本报告期退租 1 个
方正证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
光大证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
国海证券	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
国联民生证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
华安证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个

华金证券	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
申万宏源	1	-	-	-	-	本报告期新增 2 个、本报告期退租 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
西南证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
信达证券	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
银河证券	-	-	-	-	-	本报告期新增 2 个、本报告期退租 2 个
粤开证券	2	-	-	-	-	本期报告新增 2 个
中金公司	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
中泰证券	2	-	-	-	-	本期报告新增

						2 个
中信证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 2 个、本报告期退租 1 个
中银国际	1	-	-	-	-	本期报告新增 1 个

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
 - (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
 - (3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
 - (4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服
- 务；
- (5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

- (1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；
- (2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；
- (3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

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(%)
中信建投	2,999,550.00	15.00	280,000,000.00	100.00	-	-
国泰海通	4,999,557.00	25.00	-	-	-	-
招商证券	12,002,180.00	60.01	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

华金证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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	长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年8月29日
2	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年9月4日
3	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年9月5日
4	长城基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年9月24日
5	长城上证科创板综合指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年9月24日
6	长城基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用本公司名义进行诈骗活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年11月11日
7	长城基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票及相关风险提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年11月22日

8	长城基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 6 日
9	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 9 日
10	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 25 日

§ 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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城上证科创板 100 指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《长城上证科创板 100 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城上证科创板 100 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他备查文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日