

景顺长城上证科创板综合价格交易型开放 式指数证券投资基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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 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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	59
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城上证科创板综合价格 ETF
场内简称	景顺科综（扩位简称为：科创综指 ETF 景顺）
基金主代码	589890
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	84,987,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	1、股票投资策略 本基金以上证科创板综合价格指数为标的指数，通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以采用选取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。抽样复制法，即根据个股行业、市值等指标，在指数成份股中选取更有代表性的样本股，并通过长期稳定的风险模型采用“跟踪误差最小化”的优化方式设计样本股的组合比例。 本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 2、股指期货投资策略 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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 3、股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。基金投资股票期权符合基金合同约定的比例限制（如股票仓位、个股占比等）、投资目标和风险收益特征。

	4、存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 5、债券投资策略 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。 6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略 A) 相对价值分析：基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。通过对可转换债券和可交换债券的转股溢价率和 Delta 系数的度量，筛选出股性或债性较强的品种作为下一阶段的投资重点。 B) 基本面研究：基金管理人依据内、外部研究成果，运用景顺长城股票研究数据库（SRD）对可转换债券和可交换债券标的公司进行多方位、多角度的分析，重点选择行业景气度较高、公司基本面素质优良的标的公司。 C) 估值分析：在基本面分析的基础上，运用 PE、PB、PCF、EV/EBITDA、PEG 等相对估值指标以及 DCF、DDM 等绝对估值方法对标的公司的股票价值进行评估，并根据标的股票的当前价格和目标价格，运用期权定价模型分别计算可转换债券和可交换债券当前的理论价格和未来目标价格，进行投资决策。 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。 参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 8、资产支持证券投资策略 本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以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，并通过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，基金管理人将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、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场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		景顺长城基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	张姗
	联系电话	0755-82370388	400-61-95555
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4008888606	400-61-95555
传真		0755-22381339	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518048	518040
法定代表人		叶才	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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)
本期已实现收益	94,332,778.31
本期利润	79,358,139.04
加权平均基金份额本期利润	0.3674
本期加权平均净值利润率	25.50%
本期基金份额净值增长率	53.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	68,972,452.52
期末可供分配基金份额利润	0.8116
期末基金资产净值	169,503,110.49
期末基金份额净值	1.9945
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	99.45%

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四位，小数点后第五位四舍五入，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

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	55.72%	2.32%	55.44%	2.36%	0.28%	-0.04%
过去六个月	53.98%	2.20%	53.71%	2.23%	0.27%	-0.03%
过去一年	103.96%	1.94%	104.19%	1.96%	-0.23%	-0.02%
自基金合同生效起至今	99.45%	1.90%	97.62%	1.94%	1.83%	-0.04%

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

景顺长城上证科创板综合价格ETF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：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓

期为自 2025 年 2 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。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。报告期末距离建仓结束期未滿一年。

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		
张 晓 南	本基金的基金助理	2025 年 12 月 30 日	-	16 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部总监、基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。
徐 卓 荻	本基金的基金经理	2026 年 5 月 22 日	-	5 年	理学硕士，CFA，FRM。曾任摩根基金管理有限公司组合基金投资部助理研究员。2024 年 9 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部研究员，自 2026 年 5 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 5 年证券、基金行业从业经验。

龚 丽	本基金的 基金经理	2025 年 2 月 26 日	2026 年 6 月 12 日	15 年	理学硕士。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理，申万菱信基金管理有限公司指数投资部负责人、基金经理。2022 年 3 月加入本公司，担任 ETF 与创新投资部副总经理，自 2023 年 11 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部副总经理、基金经理，兼任投资经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。
金璜	本基金的 基金经理	2025 年 2 月 26 日	2026 年 3 月 3 日	10 年	工 学 硕 士 ， CFA 。 曾 任 美 国 AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理，自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 10 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、《景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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

2026 年上半年 A 股整体呈现先抑后扬、结构极致分化的走势，科技成长板块在二季度强势爆发带动下领涨全市场，而一季度表现占优的周期与红利板块在二季度明显回撤。市场主要指数涨跌幅及排序为：科创 50(64.25%)>创业板 50(37.01%)>中证 500(20.97%)>沪深 300(7.55%)。市值维度分化较大，规模指数涨跌幅及排序为：中证 500(20.97%)>中证 1000(15.99%)>中证 2000(9.10%)>沪深 300(7.55%)。风格维度成长大幅领涨，中信风格指数涨跌幅及排序为：成长(36.71%)>周期(-4.31%)>稳定(-6.36%)>金融(-12.58%)>消费(-13.46%)。行业维度，中信证券一级行业指数涨跌幅前五为：电子(85.49%)>通信(74.54%)>建材(43.70%)>基础化工(18.56%)>机械(16.17%)，后五为：消费者服务(-31.88%)<综合金融(-29.58%)<综合(-25.09%)<农林牧渔(-24.76%)<商贸零售(-22.18%)。

2026 年上半年中国经济呈现“前稳后弱、外强内弱”的分化格局，但整体运行稳健。上半年 GDP 同比增长 4.7%，落在全年经济增速目标区间的中沿；二季度增速 4.3%，较一季度的 5.0%温和回落。价格端，二季度 GDP 平减指数同比上涨 1.4%，价格修复仍在延续；不过 7 月中东冲突再度升温令油价走势不确定性上升，对后续价格判断形成扰动。

从最近的 6 月数据来看，内外需在分化中已显露出边际改善的暖意。内需方面，社零在基数走低与“以旧换新”品类修复的支撑下由负转正，同比增长 1.0%；更全面的居民消费支出数据显示，二季度居民消费增速由 3.6%回升至 3.8%，说明前期社零下滑更多受“以旧换新”退坡拖累，更广泛的服务消费韧性犹在。投资端仍在低位，6 月当月同比下滑约一成，但其中制造业投资跌幅收窄、由-4.2%回升至-3.2%，基建与房地产投资则分别下滑 10.2%和 24.4%。房地产呈现一线企稳、全局分化的特征：一线城市二手房价 6 月环比上涨 0.3%，已实现连续 4 个月 0.3%以上的涨幅，表现甚至好于“924”之后，但企稳仍局限于一线城市，尚未向更广泛城市及一手房扩散。

外需是上半年较为突出的主线。6 月出口（美元计价）同比增速由 19.4%进一步攀升至 27%，

连续大幅超出市场预期，背后是 AI 产业高景气、关税扰动消退与中国供应链优势的共同驱动，机电、劳动密集型与原材料出口在 6 月迎来广谱改善。强劲的出口也带动生产端修复，工业增加值同比由 4.5%回升至 5.3%。需要留意的是，二季度产能利用率由 73.6%回落至 73.0%，逼近历史低点 72.9%，价格企稳回升的内生动能仍偏弱，后续复苏的基础也尚需进一步夯实。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 53.98%，业绩比较基准收益率为 53.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，二季度经济下行主要源于财政支出力度边际放缓。7 月中旬的经济形势座谈会明确要求“加大逆周期调节力度，用好用足存量政策，预研储备增量政策”，并强调“做好下半年经济工作直接关系全年发展目标实现”。预计财政工具下半年将加速落地，基建投资有望在“六张网”建设带动下回升，传统经济部门或有所修复，内外需分化也有望收敛。消费则仍受居民就业与预期偏弱制约，预计维持低速弱修复；房地产延续“销售回暖、投资仍待企稳”的分化格局。整体而言，经济或将呈现“稳中承压、结构分化”的运行态势，在稳增长政策持续发力下，下半年基本面的支撑将更为扎实，A 股科技成长与出口链的结构性机遇有望延续。

科技成长板块在上半年凭借全球 AI 产业链的高景气度独立走强，走出与内需走弱截然不同的行情。全球算力扩张与 AI 应用深化构成核心驱动，AI 需求从训练端向推理与应用端扩散，半导体、软件、通信等细分领域有望依次受益；国内政策围绕创新驱动、先进制造与数字经济持续加码，为科技企业研发与扩产提供更稳定的资金环境。整体来看，科技成长板块普遍具备高研发投入与高业绩弹性的特征，对 AI 算力扩张与国产自主可控的产业趋势高度敏感，在产业趋势与政策共振下，下半年景气有望延续并向更多细分领域扩散，中长期或仍有上行空间。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分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。

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

托管人声明：

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

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	2,287,792.09	3,376,918.30
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	167,388,142.69	424,316,855.30
其中：股票投资		167,331,837.73	423,965,068.98
基金投资		-	-
债券投资		56,304.96	351,786.32
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		169,675,934.78	427,693,773.60
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		-	-
应付管理人报酬		18,729.74	54,586.57
应付托管费		6,243.24	18,195.53
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	0.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	147,851.30	187,500.00
负债合计		172,824.29	260,283.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	84,987,000.00	329,987,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	84,516,110.49	97,446,490.53
净资产合计		169,503,110.49	427,433,490.53

负债和净资产总计		169,675,934.78	427,693,773.60
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.9945 元，基金份额总额 84,987,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

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 2 月 26 日（基金 合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		79,814,560.86	13,132,582.18
1. 利息收入		2,084.55	120,860.63
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,084.55	120,860.63
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）		94,644,707.96	652,686.96
其中：股票投资收益	6.4.7.14	94,178,450.70	-2,146,073.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	284,450.20	-
资产支持证券投资 收益	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	181,807.06	2,798,760.43
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	-14,974,639.27	12,541,581.28
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	142,407.62	-182,546.69
减：二、营业总支出		456,421.82	705,758.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	233,885.40	436,073.87

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,961.80	145,357.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.09	-
8. 其他费用	6.4.7.23	144,574.53	124,326.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,358,139.04	12,426,823.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,358,139.04	12,426,823.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,358,139.04	12,426,823.66

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

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	329,987,000.00	-	97,446,490.53	427,433,490.53
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	329,987,000.00	-	97,446,490.53	427,433,490.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-245,000,000.00	-	-12,930,380.04	-257,930,380.04
（一）、综合收益总额	-	-	79,358,139.04	79,358,139.04
（二）、本期基金份额交易产生的	-245,000,000.00	-	-92,288,519.08	-337,288,519.08

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	30,000,000.00	-	14,934,691.03	44,934,691.03
2. 基金赎 回款	-275,000,000.00	-	-107,223,210.11	-382,223,210.11
(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	84,987,000.00	-	84,516,110.49	169,503,110.49
项目	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 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	-	-	-	-
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	1,444,987,000.00	-	-	1,444,987,000.00
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-615,000,000.00	-	-18,358,504.77	-633,358,504.77
(一)、综合收益 总额	-	-	12,426,823.66	12,426,823.66
(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)	-615,000,000.00	-	-30,785,328.43	-645,785,328.43
其中：1. 基金申 购款	570,000,000.00	-	-38,029,700.01	531,970,299.99

2. 基金赎回款	-1,185,000,000.00	-	7,244,371.58	-1,177,755,628.42
(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	829,987,000.00	-	-18,358,504.77	811,628,495.23

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

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资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]135 号文《关于准予景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，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《景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2025 年 2 月 17 日至 2025 年 2 月 21 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,444,987,000.00 元，无认购资金利息折合基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,444,987,000.00 元，折合 1,444,987,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015711_H05 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、

金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

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	284,047.93

等于：本金	284,019.34
加：应计利息	28.59
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	2,003,744.16
等于：本金	2,003,691.09
加：应计利息	53.07
减：坏账准备	-
合计	2,287,792.09

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

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		114,068,750.52	-	167,331,837.73	53,263,087.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	50,000.00	3.06	56,304.96	6,301.90
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	50,000.00	3.06	56,304.96	6,301.90
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		114,118,750.52	3.06	167,388,142.69	53,269,389.11

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	143,809.93
其他	4,041.37
合计	147,851.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	329,987,000.00	329,987,000.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-275,000,000.00	-275,000,000.00
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	84,987,000.00	84,987,000.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	88,305,901.81	9,140,588.72	97,446,490.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	88,305,901.81	9,140,588.72	97,446,490.53
本期利润	94,332,778.31	-14,974,639.27	79,358,139.04
本期基金份额交易产生的变动数	-113,666,227.60	21,377,708.52	-92,288,519.08
其中：基金申购款	13,779,871.96	1,154,819.07	14,934,691.03
基金赎回款	-127,446,099.56	20,222,889.45	-107,223,210.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,972,452.52	15,543,657.97	84,516,110.49

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	908.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,176.17
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,084.55

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	53,769,400.45
股票投资收益——赎回差价收入	40,409,050.25
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	94,178,450.70

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	307,504,208.52
减：卖出股票成本总额	253,421,115.90
减：交易费用	313,692.17
买卖股票差价收入	53,769,400.45

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	382,223,210.11
减：现金支付赎回款总额	1,173,561.11
减：赎回股票成本总额	340,640,598.75
减：交易费用	-
赎回差价收入	40,409,050.25

6.4.7.14.4 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	29.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	284,421.08
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	284,450.20

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	676,505.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	392,000.00
减：应计利息总额	57.20
减：交易费用	27.15
买卖债券差价收入	284,421.08

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	181,807.06
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	181,807.06

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	-14,974,639.27
股票投资	-14,864,185.27
债券投资	-110,454.00
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	-14,974,639.27

注：公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

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	-
替代损益	142,407.62
合计	142,407.62

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	659.74
注册登记费	59,507.37
存托服务费	104.86
合计	144,574.53

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“景顺长城上证科创板综合价格 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	233,885.40	436,073.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	29,152.35	133,375.98
应支付基金管理人的净管理费	204,733.05	302,697.89

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/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 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	77,961.80	145,357.98

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年6月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
景顺长城上证科创板综合价格ETF联接	36,569,400.00	43.03	46,394,200.00	14.06

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2月26日（基金合同生效日）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
招商银行-活期	284,047.93	908.38	986,790.26	15,567.83

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
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	432	4,829.76	7,598.88	-
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	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	120	1,663.20	8,815.20	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	80	1,260.80	3,736.80	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	295	5,221.50	24,874.40	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	73	2,991.54	22,497.87	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	144	3,265.92	6,855.84	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-

688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	60	2,673.60	28,120.20	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	72	5,895.36	114,071.76	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,359	12,869.73	95,320.26	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	574	11,296.32	81,215.26	-

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
118069	爱科转债	2026年6月12日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	30	3,000.00	3,000.26	-
118070	南芯转债	2026年6月22日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	190	19,000.00	19,001.08	-
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	80	8,000.00	8,000.14	-
118072	鼎通转债	2026年6月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.28	-

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 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	2,906	1,198,198.24	2,417,792.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	1,192	52,032.75	171,648.00	-
688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	2,443	26,827.62	15,830.64	-

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同责任，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发行的证券，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 0.03%（上年度末：0.08%）。

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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行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 个工作日内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 个工作日内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，并按照合约

规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	2,287,792.09	-	-	-	-	-	2,287,792.09
交易性金融资产	-	-	-	-	56,304.96	167,331,837.73	167,388,142.69
资产总计	2,287,792.09	-	-	-	56,304.96	167,331,837.73	169,675,934.78
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,729.74	18,729.74
应付托管费	-	-	-	-	-	6,243.24	6,243.24
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	-	147,851.30	147,851.30
负债总计	-	-	-	-	-	172,824.29	172,824.29
利率敏感度缺口	2,287,792.09	-	-	-	56,304.96	-	-
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	3,376,918.30	-	-	-	-	-	3,376,918.30
交易性金融资产	-	-	-	-	351,786.32	423,965,068.98	424,316,855.30
资产总计	3,376,918.30	-	-	-	351,786.32	423,965,068.98	427,693,773.60
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,586.57	54,586.57
应付托管费	-	-	-	-	-	18,195.53	18,195.53
应交税费	-	-	-	-	-	0.97	0.97
其他负债	-	-	-	-	-	187,500.00	187,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	260,283.07	260,283.07
利率敏感度缺口	3,376,918.30	-	-	-	351,786.32	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.03%（上年度末：0.08%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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	167,331,837.73	98.72	423,965,068.98	99.19
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	167,331,837.73	98.72	423,965,068.98	99.19

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%	10,196,470.98	29,710,499.14
	沪深 300 指数下降 5%	-10,196,470.98	-29,710,499.14

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	164,266,065.76	416,579,512.90
第二层次	2,644,272.40	7,737,342.40
第三层次	477,804.53	-
合计	167,388,142.69	424,316,855.30

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	167,331,837.73	98.62
	其中：股票	167,331,837.73	98.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,304.96	0.03
	其中：债券	56,304.96	0.03

	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	2,287,792.09	1.35
8	其他各项资产	-	-
9	合计	169,675,934.78	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	135,372,270.51	79.86
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	28,429,609.42	16.77
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	2,532,424.75	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	519,728.52	0.31
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	166,854,033.20	98.44

7.2.2 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	477,804.53	0.28
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	-	-
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	477,804.53	0.28

7.2.3 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

7.3.1 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	6,757	10,781,131.35	6.36
2	688041	海光信息	25,145	9,311,193.50	5.49
3	688012	中微公司	10,087	4,725,759.50	2.79
4	688981	中芯国际	27,752	4,407,572.64	2.60
5	688008	澜起科技	12,385	3,838,111.50	2.26
6	688795	摩尔线程	5,057	3,623,289.93	2.14
7	688802	沐曦股份	4,197	3,476,375.10	2.05
8	688525	佰维存储	5,088	2,517,186.24	1.49
9	688498	源杰科技	1,334	2,515,924.00	1.48
10	688072	拓荆科技	2,906	2,417,792.00	1.43
11	688082	盛美上海	5,067	2,188,944.00	1.29
12	688521	芯原股份	5,573	2,068,363.22	1.22
13	688146	中船特气	5,693	1,992,493.07	1.18
14	688120	华海清科	5,271	1,698,210.78	1.00
15	688702	盛科通信	4,300	1,676,957.00	0.99
16	688361	中科飞测	3,757	1,615,510.00	0.95
17	688347	华虹宏力	4,275	1,437,682.50	0.85
18	688126	沪硅产业	36,022	1,436,917.58	0.85
19	688396	华润微	14,465	1,411,060.75	0.83

20	688172	燕东微	15,559	1,301,665.94	0.77
21	688249	晶合集成	21,868	1,290,868.04	0.76
22	688506	百利天恒	4,331	1,273,443.93	0.75
23	688183	生益电子	9,131	1,208,944.40	0.71
24	688766	普冉股份	1,425	1,092,405.00	0.64
25	688200	华峰测控	2,029	1,065,427.90	0.63
26	688111	金山办公	4,881	1,039,897.05	0.61
27	688777	中控技术	8,744	1,027,420.00	0.61
28	688110	东芯股份	4,952	1,008,722.40	0.60
29	688409	富创精密	3,178	973,262.50	0.57
30	688469	芯联集成	91,377	969,509.97	0.57
31	688629	华丰科技	5,022	941,675.22	0.56
32	688313	仕佳光子	4,985	920,480.25	0.54
33	688271	联影医疗	8,981	909,146.63	0.54
34	688519	南亚新材	2,381	904,875.24	0.53
35	688037	芯源微	2,015	884,685.75	0.52
36	688048	长光华芯	1,734	870,468.00	0.51
37	688147	微导纳米	5,264	852,136.32	0.50
38	688234	天岳先进	4,816	835,624.16	0.49
39	688002	睿创微纳	5,230	809,028.70	0.48
40	688019	安集科技	2,359	800,786.14	0.47
41	688630	芯碁微装	1,421	780,683.19	0.46
42	688141	杰华特	5,007	768,574.50	0.45
43	688017	绿的谐波	1,817	759,251.62	0.45
44	688548	广钢气体	14,369	748,624.90	0.44
45	688387	信科移动	37,446	742,928.64	0.44
46	688036	传音控股	12,534	738,879.30	0.44
47	688585	上纬新材	4,435	735,323.00	0.43
48	688375	国博电子	6,634	691,926.20	0.41
49	688047	龙芯中科	4,398	680,238.66	0.40
50	688187	时代电气	9,469	650,141.54	0.38
51	688775	影石创新	4,402	610,337.30	0.36
52	688300	联瑞新材	2,454	599,757.60	0.35
53	688627	精智达	835	597,025.00	0.35
54	688728	格科微	28,328	596,021.12	0.35
55	688295	中复神鹰	9,792	592,807.68	0.35
56	688549	中巨芯	16,104	592,788.24	0.35
57	688220	翱捷科技	4,719	586,666.08	0.35
58	688322	奥比中光	4,397	574,028.35	0.34
59	688432	有研硅	13,608	543,911.76	0.32
60	688027	国盾量子	1,067	537,778.67	0.32
61	688578	艾力斯	4,910	536,172.00	0.32
62	688545	兴福电子	4,012	533,836.72	0.31

63	688223	晶科能源	111,925	531,643.75	0.31
64	688411	海博思创	1,808	526,489.60	0.31
65	688336	三生国健	9,888	525,052.80	0.31
66	688668	鼎通科技	1,401	522,993.30	0.31
67	688331	荣昌生物	3,872	504,366.72	0.30
68	688536	思瑞浦	1,365	496,982.85	0.29
69	688188	柏楚电子	4,582	488,899.40	0.29
70	688362	甬矽电子	4,940	476,216.00	0.28
71	688099	晶晨股份	4,619	475,295.10	0.28
72	688167	炬光科技	1,341	474,995.61	0.28
73	688213	思特威	4,407	471,857.49	0.28
74	688122	西部超导	7,205	452,546.05	0.27
75	688127	蓝特光学	4,593	448,276.80	0.26
76	688001	华兴源创	5,220	447,354.00	0.26
77	688009	中国通号	93,936	447,135.36	0.26
78	688368	晶丰明源	2,038	441,267.76	0.26
79	688676	金盘科技	5,186	438,943.04	0.26
80	688403	汇成股份	10,927	433,801.90	0.26
81	688233	神工股份	2,021	433,342.82	0.26
82	688449	联芸科技	5,013	432,672.03	0.26
83	688472	阿特斯	39,674	429,272.68	0.25
84	688248	南网科技	6,205	429,261.90	0.25
85	688385	复旦微电	5,886	419,612.94	0.25
86	688303	大全能源	23,401	407,879.43	0.24
87	688102	斯瑞新材	8,609	406,172.62	0.24
88	688025	杰普特	859	403,730.00	0.24
89	688301	奕瑞科技	3,255	403,620.00	0.24
90	688433	华曙高科	4,642	397,355.20	0.23
91	688052	纳芯微	1,369	394,696.39	0.23
92	688257	新锐股份	3,865	393,843.50	0.23
93	688652	京仪装备	1,963	392,933.71	0.23
94	688502	茂莱光学	566	392,577.60	0.23
95	688195	腾景科技	2,032	391,322.56	0.23
96	688538	和辉光电	150,378	390,982.80	0.23
97	688065	凯赛生物	7,956	380,694.60	0.22
98	688568	中科星图	8,927	370,202.69	0.22
99	688205	德科立	1,750	364,332.50	0.21
100	688599	天合光能	25,514	360,257.68	0.21
101	688503	聚和材料	2,697	357,891.90	0.21
102	688123	聚辰股份	1,647	350,152.20	0.21
103	688018	乐鑫科技	2,725	348,582.00	0.21
104	688400	凌云光	5,216	345,299.20	0.20
105	688268	华特气体	1,289	344,807.50	0.20

106	688372	伟测科技	1,844	342,984.00	0.20
107	688266	泽璟制药	2,897	337,964.02	0.20
108	688332	中科蓝讯	2,113	332,797.50	0.20
109	688343	云天励飞	4,069	332,274.54	0.20
110	688531	日联科技	1,825	324,558.00	0.19
111	688388	嘉元科技	7,336	322,784.00	0.19
112	688308	欧科亿	1,752	318,531.12	0.19
113	688352	硕中科技	13,154	318,063.72	0.19
114	688333	铂力特	3,100	317,440.00	0.19
115	688297	中无人机	7,539	313,245.45	0.18
116	688235	百济神州	1,217	309,860.37	0.18
117	688150	莱特光电	4,509	309,407.58	0.18
118	688608	恒玄科技	1,850	309,301.50	0.18
119	689009	九号公司	8,055	307,298.25	0.18
120	688097	博众精工	4,853	305,981.65	0.18
121	688700	东威科技	3,395	303,513.00	0.18
122	688778	厦钨新能	5,574	303,225.60	0.18
123	688757	胜科纳米	4,532	302,284.40	0.18
124	688800	瑞可达	3,138	301,153.86	0.18
125	688390	固德威	2,765	300,030.15	0.18
126	688603	天承科技	1,416	294,457.20	0.17
127	688380	中微半导	4,456	293,694.96	0.17
128	688692	达梦数据	1,195	291,926.55	0.17
129	688582	芯动联科	4,491	291,915.00	0.17
130	688535	华海诚科	1,551	290,037.00	0.17
131	688180	君实生物	8,547	289,059.54	0.17
132	688318	财富趋势	4,033	287,593.23	0.17
133	688169	石头科技	3,010	285,859.70	0.17
134	688617	惠泰医疗	1,554	282,144.24	0.17
135	688003	天准科技	2,198	279,805.40	0.17
136	688143	长盈通	1,590	279,649.20	0.16
137	688484	南芯科技	4,762	269,005.38	0.16
138	688584	上海合晶	7,472	268,618.40	0.16
139	688709	成都华微	7,042	268,229.78	0.16
140	688661	和林微纳	1,670	265,496.60	0.16
141	688349	三一重能	17,427	264,541.86	0.16
142	688392	骄成超声	1,143	259,666.74	0.15
143	688615	合合信息	2,293	259,338.30	0.15
144	688028	沃尔德	1,663	259,211.81	0.15
145	688625	呈和科技	3,040	256,606.40	0.15
146	688596	正帆科技	3,207	253,545.42	0.15
147	688278	特宝生物	4,638	252,307.20	0.15
148	688563	航材股份	4,916	251,846.68	0.15

149	688106	金宏气体	5,915	245,354.20	0.14
150	688772	珠海冠宇	12,480	244,982.40	0.14
151	688005	容百科技	7,986	244,371.60	0.14
152	688006	杭可科技	6,679	244,117.45	0.14
153	688507	索辰科技	899	242,442.32	0.14
154	688726	拉普拉斯	4,584	242,264.40	0.14
155	688523	航天环宇	4,607	241,406.80	0.14
156	688114	华大智造	4,668	238,441.44	0.14
157	688475	萤石网络	8,674	237,233.90	0.14
158	688383	新益昌	1,260	236,930.40	0.14
159	688559	海目星	2,808	235,647.36	0.14
160	688131	皓元医药	2,490	235,554.00	0.14
161	688819	天能股份	10,586	235,009.20	0.14
162	688425	铁建重工	58,286	234,309.72	0.14
163	688605	先锋精科	2,240	233,004.80	0.14
164	688359	三孚新科	1,153	228,801.32	0.13
165	688279	峰昭科技	1,013	227,357.72	0.13
166	688686	奥普特	1,346	226,652.94	0.13
167	688708	佳驰科技	4,443	225,704.40	0.13
168	688662	富信科技	1,337	224,616.00	0.13
169	688206	概伦电子	4,953	219,764.61	0.13
170	688281	华秦科技	4,285	215,235.55	0.13
171	688059	华锐精密	1,060	211,692.60	0.12
172	688055	龙腾光电	36,658	211,150.08	0.12
173	688401	路维光电	2,181	209,332.38	0.12
174	688515	裕太微	837	208,212.12	0.12
175	688192	迪哲医药	5,141	205,280.13	0.12
176	688353	华盛锂电	1,764	204,747.48	0.12
177	688107	安路科技	4,468	203,740.80	0.12
178	688593	新相微	5,181	201,644.52	0.12
179	688319	欧林生物	4,581	201,472.38	0.12
180	688516	奥特维	3,497	200,692.83	0.12
181	688690	纳微科技	4,545	200,434.50	0.12
182	688363	华熙生物	5,406	193,372.62	0.11
183	688798	艾为电子	2,630	192,831.60	0.11
184	688182	灿勤科技	4,443	191,360.01	0.11
185	688275	万润新能	1,477	188,391.35	0.11
186	688378	奥来德	3,034	188,108.00	0.11
187	688416	恒烁股份	1,339	187,460.00	0.11
188	688208	道通科技	7,434	187,262.46	0.11
189	688090	瑞松科技	1,747	185,968.15	0.11
190	688530	欧莱新材	1,911	185,175.90	0.11
191	688158	优刻得	4,999	183,763.24	0.11

192	688561	奇安信	7,546	180,953.08	0.11
193	688020	方邦股份	719	179,462.40	0.11
194	688610	埃科光电	681	179,375.40	0.11
195	688520	神州细胞	5,212	178,302.52	0.11
196	688376	美埃科技	1,480	172,124.00	0.10
197	688260	昀冢科技	1,192	171,648.00	0.10
198	688779	五矿新能	21,134	171,396.74	0.10
199	688456	有研粉材	1,211	169,055.60	0.10
200	688166	博瑞医药	4,827	168,993.27	0.10
201	688100	威胜信息	5,487	167,847.33	0.10
202	688337	普源精电	2,177	163,122.61	0.10
203	688669	聚石化学	1,522	162,854.00	0.10
204	688138	清溢光电	3,440	161,680.00	0.10
205	688116	天奈科技	4,167	159,179.40	0.09
206	688088	虹软科技	4,476	159,121.80	0.09
207	688262	国芯科技	3,656	158,048.88	0.09
208	688258	卓易信息	1,332	157,895.28	0.09
209	688153	唯捷创芯	4,830	155,139.60	0.09
210	688031	星环科技	1,336	153,880.48	0.09
211	688508	芯朋微	1,648	153,198.08	0.09
212	688691	灿芯股份	1,313	152,216.09	0.09
213	688029	南微医学	2,114	151,785.20	0.09
214	688125	安达智能	925	151,237.50	0.09
215	688371	菲沃泰	3,863	150,618.37	0.09
216	688381	帝奥微	2,802	149,907.00	0.09
217	688717	艾罗能源	1,778	146,809.46	0.09
218	688063	派能科技	2,747	146,332.69	0.09
219	688222	成都先导	4,464	143,339.04	0.08
220	688209	英集芯	4,920	143,073.60	0.08
221	688198	佰仁医疗	1,597	142,516.28	0.08
222	688035	德邦科技	1,549	142,198.20	0.08
223	688261	东微半导	1,353	141,970.29	0.08
224	688079	美迪凯	4,602	141,511.50	0.08
225	688327	云从科技	11,328	141,146.88	0.08
226	688677	海泰新光	1,390	140,570.70	0.08
227	688612	威迈斯	4,742	140,315.78	0.08
228	688567	孚能科技	13,309	139,744.50	0.08
229	688112	鼎阳科技	1,901	139,647.46	0.08
230	688486	龙迅股份	2,161	137,396.38	0.08
231	688016	心脉医疗	1,546	137,037.44	0.08
232	688663	新风光	1,542	136,405.32	0.08
233	688306	均普智能	13,364	134,976.40	0.08
234	688478	晶升股份	1,523	134,861.65	0.08

235	688720	艾森股份	1,335	134,835.00	0.08
236	688202	美迪西	1,666	134,462.86	0.08
237	688312	燕麦科技	1,591	133,628.09	0.08
238	688231	隆达股份	3,620	132,962.60	0.08
239	688191	智洋创新	3,709	132,411.30	0.08
240	688321	微芯生物	4,957	130,517.81	0.08
241	688325	赛微微电	1,000	130,410.00	0.08
242	688628	优利德	1,296	128,226.24	0.08
243	688239	航宇科技	2,141	128,096.03	0.08
244	688155	先惠技术	1,580	127,806.20	0.08
245	688227	品高股份	1,238	127,130.22	0.08
246	688062	迈威生物	4,436	125,317.00	0.07
247	688660	电气风电	14,477	124,791.74	0.07
248	688583	思看科技	1,436	123,165.72	0.07
249	688698	伟创电气	2,329	122,156.05	0.07
250	688083	中望软件	1,884	121,989.00	0.07
251	688323	瑞华泰	2,149	121,418.50	0.07
252	688351	微电生理	5,345	121,117.70	0.07
253	688611	杭州柯林	1,691	120,821.95	0.07
254	688556	高测股份	9,048	120,157.44	0.07
255	688190	云路股份	1,322	119,918.62	0.07
256	688093	世华科技	3,240	119,556.00	0.07
257	688165	埃夫特	5,838	119,095.20	0.07
258	688485	九州一轨	1,844	118,126.64	0.07
259	688788	科思科技	2,580	116,048.40	0.07
260	688710	益诺思	1,725	115,920.00	0.07
261	688382	益方生物	6,421	115,578.00	0.07
262	688386	泛亚微透	1,286	115,534.24	0.07
263	688598	金博股份	2,334	115,416.30	0.07
264	688032	禾迈股份	1,365	115,369.80	0.07
265	688170	德龙激光	1,196	114,827.96	0.07
266	688699	明微电子	1,400	114,730.00	0.07
267	688518	联赢激光	3,711	114,669.90	0.07
268	688789	宏华数科	2,155	114,581.35	0.07
269	688135	利扬芯片	2,714	114,205.12	0.07
270	688711	宏微科技	2,512	114,170.40	0.07
271	688550	瑞联新材	1,941	112,286.85	0.07
272	688046	药康生物	4,634	112,142.80	0.07
273	688252	天德钰	4,618	110,832.00	0.07
274	688307	中润光学	1,373	109,771.35	0.06
275	688179	阿拉丁	3,953	109,537.63	0.06
276	688543	国科军工	2,774	109,434.30	0.06
277	688160	步科股份	997	108,443.69	0.06

278	688128	中国电研	4,563	108,325.62	0.06
279	688678	福立旺	4,384	105,961.28	0.06
280	688068	热景生物	1,211	104,872.60	0.06
281	688418	震有科技	2,180	104,814.40	0.06
282	688552	航天南湖	3,694	103,912.22	0.06
283	688719	爱科赛博	1,339	103,103.00	0.06
284	688758	赛分科技	4,667	102,720.67	0.06
285	688253	英诺特	1,701	102,536.28	0.06
286	688230	芯导科技	1,301	102,531.81	0.06
287	688787	海天瑞声	761	102,316.45	0.06
288	688586	江航装备	8,711	101,831.59	0.06
289	688439	振华风光	2,184	100,900.80	0.06
290	688667	菱电电控	751	100,371.15	0.06
291	688226	威腾电气	2,330	99,793.90	0.06
292	688419	耐科装备	1,266	99,570.90	0.06
293	688499	利元亨	1,877	98,636.35	0.06
294	688328	深科达	1,025	98,092.50	0.06
295	688105	诺唯赞	5,653	98,079.55	0.06
296	688689	银河微电	1,498	96,950.56	0.06
297	688480	赛恩斯	1,105	96,786.95	0.06
298	688591	泰凌微	2,796	96,126.48	0.06
299	688139	海尔生物	3,618	95,587.56	0.06
300	688305	科德数控	1,462	95,424.74	0.06
301	688697	纽威数控	6,978	94,831.02	0.06
302	688522	纳睿雷达	4,725	94,594.50	0.06
303	688091	上海谊众	2,335	93,867.00	0.06
304	688221	前沿生物	4,189	93,833.60	0.06
305	688289	圣湘生物	6,499	93,585.60	0.06
306	688326	经纬恒润	1,320	93,561.60	0.06
307	688010	福光股份	1,923	93,515.49	0.06
308	688161	威高骨科	4,443	93,214.14	0.05
309	688181	八亿时空	1,483	92,835.80	0.05
310	688443	智翔金泰	3,974	92,395.50	0.05
311	688049	炬芯科技	1,961	91,990.51	0.05
312	688286	敏芯股份	797	91,710.79	0.05
313	688739	成大生物	4,667	90,959.83	0.05
314	688733	壹石通	2,173	89,853.55	0.05
315	688513	苑东生物	2,039	89,634.44	0.05
316	688601	力芯微	1,477	89,432.35	0.05
317	688551	科威尔	1,271	89,313.17	0.05
318	688786	悦安新材	1,930	88,934.40	0.05
319	688655	迅捷兴	1,658	88,802.48	0.05
320	688428	诺诚健华	3,088	87,915.36	0.05

321	688379	华光新材	1,046	87,895.38	0.05
322	688750	金天钛业	5,243	87,191.09	0.05
323	688685	迈信林	1,588	87,181.20	0.05
324	688277	天智航	5,094	87,107.40	0.05
325	688173	希荻微	4,534	86,780.76	0.05
326	688479	友车科技	2,284	86,723.48	0.05
327	688108	赛诺医疗	4,661	86,368.33	0.05
328	688168	安博通	1,252	86,075.00	0.05
329	688665	四方光电	1,302	85,541.40	0.05
330	688721	龙图光罩	1,452	84,767.76	0.05
331	688626	翔宇医疗	1,910	84,536.60	0.05
332	688631	莱斯信息	1,782	83,593.62	0.05
333	688653	康希通信	4,809	83,580.42	0.05
334	688693	锆威特	802	83,367.90	0.05
335	688577	浙海德曼	1,798	82,402.34	0.05
336	688512	慧智微	5,070	80,967.90	0.05
337	688011	新光光电	1,153	80,560.11	0.05
338	688656	浩欧博	823	79,641.71	0.05
339	688408	中信博	2,466	79,281.90	0.05
340	688210	统联精密	1,951	79,035.01	0.05
341	688050	爱博医疗	2,165	78,914.25	0.05
342	688103	国力电子	1,052	78,279.32	0.05
343	688621	阳光诺和	1,422	78,082.02	0.05
344	688177	百奥泰	4,610	77,540.20	0.05
345	688109	品茗科技	1,022	77,365.40	0.05
346	688320	禾川科技	1,862	77,179.90	0.05
347	688219	会通股份	5,947	76,954.18	0.05
348	688045	必易微	952	76,902.56	0.05
349	688218	江苏北人	1,370	75,295.20	0.04
350	688087	英科再生	2,243	74,961.06	0.04
351	688115	思林杰	909	74,765.25	0.04
352	688365	光云科技	4,714	74,339.78	0.04
353	688290	景业智能	1,102	73,128.72	0.04
354	688636	智明达	2,008	72,749.84	0.04
355	688707	振华新材	5,634	72,396.90	0.04
356	688553	汇宇制药	6,794	72,220.22	0.04
357	688683	莱尔科技	1,900	72,048.00	0.04
358	688061	灿瑞科技	1,447	71,872.49	0.04
359	688776	国光电气	1,169	71,706.46	0.04
360	688620	安凯微	4,368	70,761.60	0.04
361	688570	天玛智控	4,900	69,727.00	0.04
362	688291	金橙子	1,183	69,181.84	0.04
363	688510	航亚科技	2,883	68,846.04	0.04

364	688595	芯海科技	1,568	68,772.48	0.04
365	688293	奥浦迈	1,643	68,496.67	0.04
366	688228	开普云	876	67,749.84	0.04
367	688069	德林海	1,812	67,696.32	0.04
368	688448	磁谷科技	1,058	67,246.48	0.04
369	688562	航天软件	4,443	66,911.58	0.04
370	688199	久日新材	1,937	66,884.61	0.04
371	688539	高华科技	2,070	65,991.60	0.04
372	688007	光峰科技	4,951	65,848.30	0.04
373	688232	新点软件	3,702	65,821.56	0.04
374	688799	华纳药厂	1,466	65,779.42	0.04
375	688658	悦康药业	5,101	65,598.86	0.04
376	688117	圣诺生物	2,393	64,682.79	0.04
377	688345	博力威	1,112	64,584.96	0.04
378	688623	二元科技	641	64,394.86	0.04
379	688073	毕得医药	1,195	64,314.90	0.04
380	688334	西高院	3,545	64,306.30	0.04
381	688276	百克生物	4,599	64,110.06	0.04
382	688526	科前生物	5,274	63,815.40	0.04
383	688366	昊海生科	2,209	63,773.83	0.04
384	688185	康希诺	1,247	63,584.53	0.04
385	688176	亚虹医药	6,372	63,210.24	0.04
386	688237	超卓航科	1,178	62,928.76	0.04
387	688309	恒誉环保	1,029	62,645.52	0.04
388	688348	昱能科技	1,798	62,534.44	0.04
389	688609	九联科技	5,649	62,195.49	0.04
390	688679	通源环境	1,461	61,493.49	0.04
391	688450	光格科技	899	60,224.01	0.04
392	688377	迪威尔	2,524	59,515.92	0.04
393	688767	博拓生物	1,826	59,363.26	0.04
394	688056	莱伯泰科	919	59,321.45	0.03
395	688101	三达膜	3,573	59,061.69	0.03
396	688282	理工导航	1,013	58,956.60	0.03
397	688607	康众医疗	1,153	58,803.00	0.03
398	688633	星球石墨	1,968	58,508.64	0.03
399	688163	赛伦生物	1,197	58,425.57	0.03
400	688095	福昕软件	982	58,360.26	0.03
401	688315	诺禾致源	4,664	58,346.64	0.03
402	688505	复旦张江	7,903	58,324.14	0.03
403	688488	艾迪药业	4,538	58,313.30	0.03
404	688207	格灵深瞳	2,899	58,269.90	0.03
405	688119	中钢洛耐	12,242	58,149.50	0.03
406	688580	伟思医疗	1,053	56,093.31	0.03

407	688581	安杰思	1,083	56,001.93	0.03
408	688575	亚辉龙	6,375	55,845.00	0.03
409	688566	吉贝尔	2,173	55,607.07	0.03
410	688216	气派科技	1,321	55,495.21	0.03
411	688299	长阳科技	3,315	55,393.65	0.03
412	688151	华强科技	3,711	55,182.57	0.03
413	688225	亚信安全	4,430	55,020.60	0.03
414	688330	宏力达	1,608	54,398.64	0.03
415	688350	富淼科技	1,570	54,212.10	0.03
416	688360	德马科技	3,022	54,093.80	0.03
417	688648	中邮科技	1,473	53,838.15	0.03
418	688197	首药控股	1,609	53,756.69	0.03
419	688311	盟升电子	2,051	53,715.69	0.03
420	688159	有方科技	1,210	53,711.90	0.03
421	688356	键凯科技	696	53,647.68	0.03
422	688410	山外山	3,659	52,543.24	0.03
423	688039	当虹科技	1,405	52,434.60	0.03
424	688267	中触媒	2,626	51,732.20	0.03
425	688211	中科微至	1,501	51,664.42	0.03
426	688600	皖仪科技	1,543	51,351.04	0.03
427	688269	凯立新材	1,619	51,338.49	0.03
428	688084	晶品特装	1,015	51,034.20	0.03
429	688682	霍莱沃	1,301	50,608.90	0.03
430	688399	硕世生物	1,110	50,382.90	0.03
431	688458	美芯晟	1,206	50,362.56	0.03
432	688259	创耀科技	1,280	50,073.60	0.03
433	688511	天微电子	1,645	49,695.45	0.03
434	688273	麦澜德	1,282	49,664.68	0.03
435	688196	卓越新能	1,378	49,470.20	0.03
436	688085	三友医疗	4,097	49,041.09	0.03
437	688171	纬德信息	1,111	48,839.56	0.03
438	688696	极米科技	756	48,792.24	0.03
439	688175	高凌信息	1,939	48,765.85	0.03
440	688768	容知日新	945	48,705.30	0.03
441	688057	金达莱	3,139	48,371.99	0.03
442	688716	中研股份	1,524	47,899.32	0.03
443	688236	春立医疗	3,307	47,819.22	0.03
444	688215	瑞晟智能	1,189	47,750.24	0.03
445	688157	松井股份	1,799	47,475.61	0.03
446	688398	赛特新材	1,814	47,000.74	0.03
447	688075	安旭生物	1,579	46,991.04	0.03
448	688148	芳源股份	5,470	46,932.60	0.03
449	688389	普门科技	4,783	46,825.57	0.03

450	688558	国盛智科	1,419	46,628.34	0.03
451	688081	兴图新科	1,135	46,398.80	0.03
452	688639	华恒生物	2,870	46,321.80	0.03
453	688500	慧辰股份	1,020	46,236.60	0.03
454	688680	海优新材	1,088	45,696.00	0.03
455	688186	广大特材	3,005	45,525.75	0.03
456	688459	哈铁科技	5,421	45,156.93	0.03
457	688429	时创能源	4,423	45,070.37	0.03
458	688489	三未信安	1,981	44,968.70	0.03
459	688391	钜泉科技	1,252	44,909.24	0.03
460	688136	科兴制药	2,158	44,692.18	0.03
461	688592	司南导航	1,066	44,175.04	0.03
462	688602	康鹏科技	5,600	44,128.00	0.03
463	688283	坤恒顺维	1,319	43,672.09	0.03
464	688080	映翰通	1,004	43,423.00	0.03
465	688590	新致软件	3,493	43,417.99	0.03
466	688335	复洁科技	1,804	43,368.16	0.03
467	688618	三旺通信	1,391	42,801.07	0.03
468	688212	澳华内镜	1,442	42,394.80	0.03
469	688339	亿华通	2,248	42,037.60	0.02
470	688571	杭华股份	4,742	41,492.50	0.02
471	688533	上声电子	1,973	41,156.78	0.02
472	688023	安恒信息	1,118	41,052.96	0.02
473	688589	力合微	1,778	40,858.44	0.02
474	688302	海创药业	1,138	40,023.46	0.02
475	688098	申联生物	4,597	39,488.23	0.02
476	688298	东方生物	2,207	39,417.02	0.02
477	688722	同益中	2,581	39,153.77	0.02
478	688569	铁科轨道	2,421	39,099.15	0.02
479	688588	凌志软件	4,282	38,923.38	0.02
480	688238	和元生物	7,153	38,769.26	0.02
481	688255	凯尔达	1,392	38,697.60	0.02
482	688316	青云科技	713	38,502.00	0.02
483	688755	汉邦科技	1,396	38,473.76	0.02
484	688247	宣泰医药	5,104	38,382.08	0.02
485	688358	祥生医疗	1,250	38,212.50	0.02
486	688657	浩辰软件	1,065	38,095.05	0.02
487	688367	工大高科	1,143	38,061.90	0.02
488	688133	泰坦科技	1,781	37,632.53	0.02
489	688455	科捷智能	2,010	37,506.60	0.02
490	688671	碧兴物联	1,052	37,419.64	0.02
491	688576	西山科技	923	36,781.55	0.02
492	688070	纵横股份	983	36,695.39	0.02

493	688130	晶华微	1,299	36,527.88	0.02
494	688229	博睿数据	474	36,355.80	0.02
495	688272	富吉瑞	813	36,097.20	0.02
496	688509	正元地信	8,420	36,037.60	0.02
497	688129	东来技术	1,375	36,011.25	0.02
498	688280	精进电动	6,545	35,932.05	0.02
499	688606	奥泰生物	872	35,821.76	0.02
500	688265	南模生物	1,035	35,800.65	0.02
501	688338	赛科希德	1,211	35,736.61	0.02
502	688152	麒麟信安	1,300	35,724.00	0.02
503	688096	京源环保	2,660	35,537.60	0.02
504	688435	英方软件	1,095	35,040.00	0.02
505	688162	巨一科技	1,478	34,939.92	0.02
506	688557	兰剑智能	1,124	34,877.72	0.02
507	688292	浩瀚深度	1,825	33,945.00	0.02
508	688077	大地熊	1,281	33,933.69	0.02
509	688071	华依科技	931	33,925.64	0.02
510	688030	山石网科	2,139	33,774.81	0.02
511	688579	地纬智能	4,443	33,722.37	0.02
512	688357	建龙微纳	1,138	33,536.86	0.02
513	688156	路德科技	1,102	33,335.50	0.02
514	688373	盟科药业	7,315	33,136.95	0.02
515	688015	交控科技	2,109	32,436.42	0.02
516	688619	罗普特	1,996	32,395.08	0.02
517	688246	嘉和美康	1,572	32,304.60	0.02
518	688178	万德斯	941	31,815.21	0.02
519	688718	唯赛勃	1,981	31,636.57	0.02
520	688370	丛麟科技	1,511	31,610.12	0.02
521	688317	之江生物	2,061	31,327.20	0.02
522	688687	凯因科技	1,918	31,282.58	0.02
523	688113	联测科技	878	30,817.80	0.02
524	688193	仁度生物	546	30,193.80	0.02
525	688355	明志科技	1,566	30,145.50	0.02
526	688369	致远互联	1,427	29,981.27	0.02
527	688314	康拓医疗	878	29,746.64	0.02
528	688285	高铁电气	4,148	29,741.16	0.02
529	688529	豪森智能	1,808	28,439.84	0.02
530	688251	井松智能	1,094	28,039.22	0.02
531	688501	青达环保	1,417	27,206.40	0.02
532	688137	近岸蛋白	752	27,072.00	0.02
533	688060	云涌科技	820	26,969.80	0.02
534	688310	迈得医疗	1,748	26,866.76	0.02
534	688517	金冠电气	1,537	26,866.76	0.02

535	688026	洁特生物	1,691	26,565.61	0.02
536	688651	盛邦安全	819	26,388.18	0.02
537	688560	明冠新材	2,197	26,034.45	0.02
538	688468	科美诊断	4,554	25,912.26	0.02
539	688395	正弦电气	1,163	25,702.30	0.02
540	688737	中自科技	1,324	25,341.36	0.01
541	688597	煜邦电力	3,810	24,765.00	0.01
542	688118	普元信息	1,224	24,626.88	0.01
543	688420	美腾科技	1,159	24,420.13	0.01
544	688638	誉辰智能	763	23,782.71	0.01
545	688426	康为世纪	1,289	23,640.26	0.01
546	688203	海正生材	2,359	23,542.82	0.01
547	688670	金迪克	1,380	23,377.20	0.01
548	688092	爱科科技	1,072	22,769.28	0.01
549	688244	永信至诚	1,590	22,673.40	0.01
550	688013	天臣医疗	903	22,277.01	0.01
551	688132	邦彦技术	1,689	22,210.35	0.01
552	688038	中科通达	1,316	22,135.12	0.01
553	688089	嘉必优	2,059	21,845.99	0.01
554	688695	中创股份	1,103	20,626.10	0.01
555	688078	龙软科技	974	20,502.70	0.01
556	688329	艾隆科技	1,014	20,492.94	0.01
557	688613	奥精医疗	1,447	20,417.17	0.01
558	688573	信宇人	1,102	19,527.44	0.01
559	688058	宝兰德	932	19,497.44	0.01
560	688288	鸿泉技术	1,085	19,280.45	0.01
561	688616	西力科技	1,902	19,210.20	0.01
562	688466	金科环境	1,491	19,129.53	0.01
563	688659	元琛科技	1,819	18,990.36	0.01
564	688051	佳华科技	812	18,659.76	0.01
565	688189	ST 南新	3,089	18,472.22	0.01
566	688681	科汇股份	1,307	18,271.86	0.01
567	688565	力源科技	1,882	17,784.90	0.01
568	688393	安必平	984	17,495.52	0.01
569	688528	秦川物联	1,901	17,375.14	0.01
570	688004	博汇科技	886	16,125.20	0.01
571	688021	奥福科技	832	16,107.52	0.01
572	688121	*ST 卓然	2,443	15,830.64	0.01
573	688217	睿昂基因	761	15,722.26	0.01
574	688793	倍轻松	894	14,402.34	0.01
575	688067	爱威科技	704	14,185.60	0.01
576	688296	和达科技	1,129	12,915.76	0.01
577	688701	卓锦股份	1,509	11,362.77	0.01

7.3.2 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	688808	联讯仪器	72	114,071.76	0.07
2	688818	电科蓝天	1,359	95,320.26	0.06
3	688820	盛合晶微	574	81,215.26	0.05
4	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.03
5	688797	臻宝科技	60	28,120.20	0.02
6	603459	红板科技	295	24,874.40	0.01
7	688635	长进光子	73	22,497.87	0.01
8	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
9	603407	长裕集团	120	8,815.20	0.01
10	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
11	601112	振石股份	432	7,598.88	0.00
12	688781	视涯科技	144	6,855.84	0.00
13	603435	嘉德利	80	3,736.80	0.00
14	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	688795	摩尔线程	18,063,555.22	4.23
2	688981	中芯国际	12,714,672.95	2.97
3	688802	沐曦股份	11,235,103.01	2.63
4	688041	海光信息	9,796,889.61	2.29
5	688008	澜起科技	9,707,079.92	2.27
6	688775	影石创新	4,531,927.46	1.06
7	688506	百利天恒	4,445,334.53	1.04
8	688012	中微公司	4,384,652.76	1.03
9	688411	海博思创	4,128,765.82	0.97
10	688256	寒武纪	3,490,056.85	0.82
11	688521	芯原股份	3,353,775.22	0.78
12	688187	时代电气	3,136,666.18	0.73
13	688347	华虹宏力	3,100,930.99	0.73
14	688702	盛科通信	2,835,384.15	0.66
15	688082	盛美上海	2,614,780.43	0.61
16	688498	源杰科技	2,444,748.28	0.57
17	688019	安集科技	2,364,360.13	0.55
18	688172	燕东微	2,274,268.74	0.53
19	688120	华海清科	2,183,207.85	0.51
20	688017	绿的谐波	2,163,546.48	0.51

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	688981	中芯国际	11,649,324.90	2.73
2	688008	澜起科技	9,581,179.11	2.24
3	688041	海光信息	9,158,127.31	2.14
4	688795	摩尔线程	6,687,072.54	1.56
5	688498	源杰科技	5,721,382.36	1.34
6	688012	中微公司	4,906,944.12	1.15
7	688775	影石创新	4,393,434.74	1.03
8	688506	百利天恒	4,191,776.63	0.98
9	688256	寒武纪	3,343,764.90	0.78
10	688187	时代电气	3,159,869.49	0.74
11	688347	华虹宏力	2,956,948.67	0.69
12	688521	芯原股份	2,933,933.62	0.69
13	688082	盛美上海	2,926,889.84	0.68
14	688027	国盾量子	2,739,039.10	0.64
15	688702	盛科通信	2,577,958.82	0.60
16	688235	百济神州	2,469,905.41	0.58
17	688172	燕东微	2,204,501.43	0.52
18	688200	华峰测控	2,038,898.47	0.48
19	688183	生益电子	2,036,119.52	0.48
20	688167	炬光科技	2,010,003.60	0.47

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	310,408,237.97
卖出股票收入（成交）总额	307,504,208.52

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	-	-
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）	56,304.96	0.03

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,304.96	0.03

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	118070	南芯转债	190	19,001.08	0.01
2	118068	迪威转债	110	17,303.20	0.01
3	118072	鼎通转债	90	9,000.28	0.01
4	118071	华峰转债	80	8,000.14	0.00
5	118069	爱科转债	30	3,000.26	0.00

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

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。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和本带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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

无。

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

7.12.5.1 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	688072	拓荆科技	2,417,792.00	1.43	重大事项停牌

7.12.5.2 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	688808	联讯仪器	114,071.76	0.07	新股流通受限
2	688818	电科蓝天	95,320.26	0.06	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	81,215.26	0.05	新股流通受限
4	688785	恒运昌	53,725.40	0.03	新股流通受限
5	688797	臻宝科技	28,120.20	0.02	新股流通受限

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

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		招商银行股份有限公司 - 景顺长城上证科创板 综合价格交易型开放式 指数证券投资基金联接 基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)

990	85,845.45	15,830,300.00	18.63	32,587,300.00	38.34	36,569,400.00	43.03
-----	-----------	---------------	-------	---------------	-------	---------------	-------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 2 月 26 日） 基金份额总额	1,444,987,000.00
本报告期期初基金份额总额	329,987,000.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	275,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	84,987,000.00

§ 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：
本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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、基金管理业务的诉讼或仲裁，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，不存在基金托管人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，不存在基金托管人相关从业人员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 (%)	
中国银河证券股份有限公司	5	617,185,569.07	100.00	120,393.16	100.00	未变更

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 (%)
中国银河证券股份有限公司	676,505.43	100.00	-	-	-	-

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
3	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 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
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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联民生证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 27 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 4 日
9	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 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 3 月 6 日
10	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 6 日
11	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
13	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
14	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
15	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
16	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
17	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

18	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 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
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 4 月 29 日
20	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
21	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
22	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
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景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	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
26	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 27 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 5 月 27 日
28	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金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 27 日
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 2 日
30	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
31	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 13 日
32	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 17 日
33	景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 17 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2026 年 6 月 23 日

	停机维护的通知	网站	
35	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20260101-20260401	98,619,300.00	-	98,619,300.00	-	-
	2	20260101-20260407	67,123,200.00	-	67,123,200.00	-	-
本基金的联接基金	3	20260408-20260630	46,394,200.00	12,348,500.00	22,173,300.00	36,569,400.00	43.03

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况,可能会出现如下风险:

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(5) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

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上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

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