

# 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开 放式指数证券投资基金发起式联接基金 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：中信证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意。

基金托管人中信证券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 04 月 23 日(基金合同生效日)起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人 and 基金托管人                     | 7         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 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                                | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 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              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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                | 13        |
| 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 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 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 44        |
| 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 ..... | 44        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 44        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 44        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....   | 44        |
| 7.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 44        |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 45        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 47        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>47</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 48        |
| 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 .....      | 48        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 48        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 48        |
| 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 .....      | 48        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 49        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>52</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 52        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 52        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 52        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 52        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 52        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                                     |                         |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------|
| 基金名称            | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 |                         |
| 基金简称            | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接               |                         |
| 基金主代码           | 027047                              |                         |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                              |                         |
| 基金合同生效日         | 2026 年 4 月 23 日                     |                         |
| 基金管理人           | 景顺长城基金管理有限公司                        |                         |
| 基金托管人           | 中信证券股份有限公司                          |                         |
| 报告期末基金份额总额      | 645,278,723.66 份                    |                         |
| 基金合同存续期         | 不定期                                 |                         |
| 下属分级基金的基金简称     | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A             | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 027047                              | 027048                  |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 134,584,582.02 份                    | 510,694,141.64 份        |

2.1.1 目标基金基本情况

|              |                              |
|--------------|------------------------------|
| 基金名称         | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159142                       |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                       |
| 基金合同生效日      | 2025 年 12 月 5 日              |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                      |
| 上市日期         | 2025 年 12 月 12 日             |
| 基金管理人名称      | 景顺长城基金管理有限公司                 |
| 基金托管人名称      | 中信证券股份有限公司                   |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人将尽快对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的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%。 |
| 业绩比较基准 | 中证科创创业人工智能指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金                                                                                                                                                                               |

|  |                                                                         |
|--|-------------------------------------------------------------------------|
|  | 为股票型指数基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，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。 |
|--|-------------------------------------------------------------------------|

### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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   | <p>1、股票投资策略 本基金以中证科创创业人工智能指数为标的指数，采用完全复制法，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。</p> <p>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，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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略 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。</p> <p>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。</p> <p>8、资产支持证券投资策略 本基金将通过分析宏观经济、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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证科创创业人工智能指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 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                 | 中信证券股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨皞阳                          | 杨军智                           |
|             | 联系电话 | 0755-82370388                | 010-60834299                  |
|             | 电子邮箱 | investor@igwfm.com           | yjz@citics.com                |
| 客户服务电话      |      | 4008888606                   | 010-60836588                  |
| 传真          |      | 0755-22381339                | 010-60834004                  |
| 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 | 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 | 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层     |
| 邮政编码        |      | 518048                       | 100125                        |
| 法定代表人       |      | 叶才                           | 张佑君                           |

## 2.4 信息披露方式

|                   |               |
|-------------------|---------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 中国证券报         |
| 登载基金中期报告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 | 景顺长城基金管理有限公司 | 深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层 |

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日 |                         |
|---------------|------------------------------------------|-------------------------|
|               | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A                  | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C |
| 本期已实现收益       | 2,658,667.09                             | 10,013,147.87           |
| 本期利润          | 27,399,555.15                            | 104,515,467.14          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2184                                   | 0.2076                  |
| 本期加权平均净值利润率   | 20.05%                                   | 19.07%                  |
| 本期基金份额净值增长率   | 24.28%                                   | 24.23%                  |
| 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     | 2,714,008.41     | 10,089,715.79  |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0202           | 0.0198         |
| 期末基金资产净值     | 167,262,425.43   | 634,456,948.66 |
| 期末基金份额净值     | 1.2428           | 1.2423         |
| 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  | 24.28%           | 24.23%         |

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，小数点后第五位舍去，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。

5、本基金基金合同生效日为 2026 年 04 月 23 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A

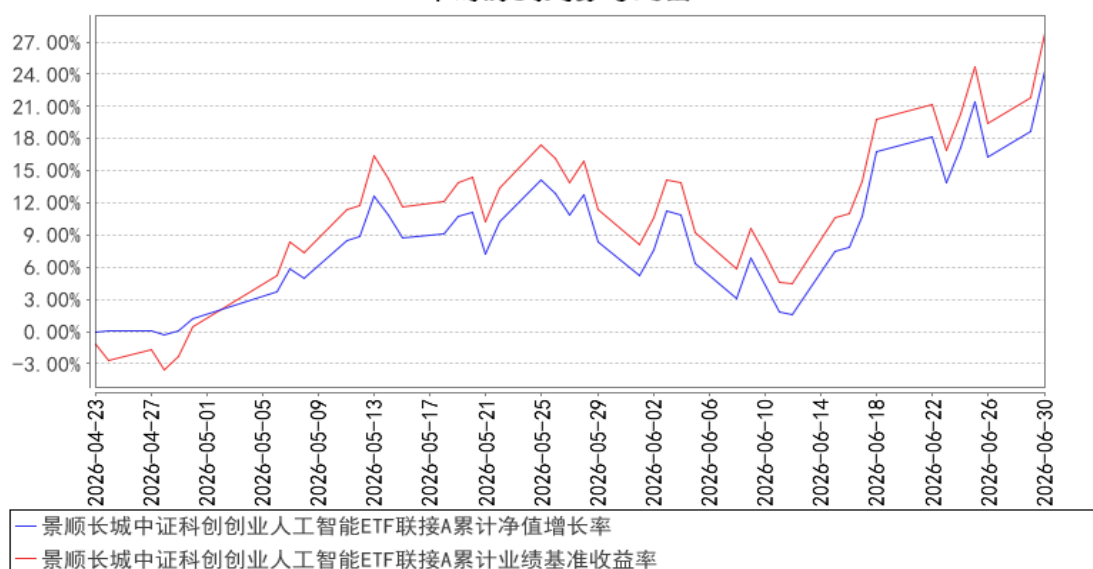
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 24.28%   | 2.66%       | 27.86%     | 2.85%         | -3.58% | -0.19% |

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C

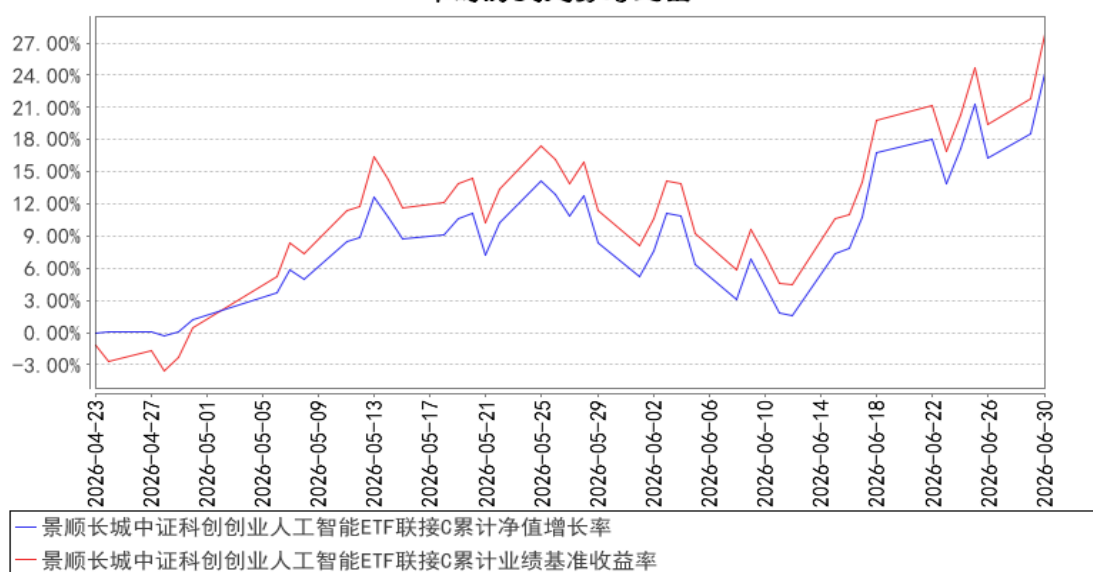
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 24.23%   | 2.66%       | 27.86%     | 2.85%         | -3.63% | -0.19% |

### 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

景顺长城中证科创创业人工智能ETF联接A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中证科创创业人工智能ETF联接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：基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金参与金融衍生品交易的，每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2026 年 4 月 23 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2026 年 4 月 23 日）起至本报告期末不满一年。

### 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 | 本基金的基金经理 | 2026 年 4 月 23 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。                                                          |
| 金 璜   | 本基金的基金助理 | 2026 年 5 月 7 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、《景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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 A 类份额净值增长率为 24.28%，业绩比较基准收益率为 27.86%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 24.23%，业绩比较基准收益率为 27.86%。

#### 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价机遇有望延续。

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。

本基金是目标 ETF 的联接基金，主要投资于目标 ETF。报告期内，本基金结合申购赎回情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

#### 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

本基金为发起式基金且发起资金持有期限不满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》关于“基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元”的披露规定。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵

守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------|---------|------------------------|
| 资 产：     |         |                        |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 60,262,092.81          |
| 结算备付金    |         | 4,809,828.22           |
| 存出保证金    |         | 702,565.64             |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 762,191,649.24         |
| 其中：股票投资  |         | -                      |
| 基金投资     |         | 762,191,649.24         |
| 债券投资     |         | -                      |
| 资产支持证券投资 |         | -                      |
| 贵金属投资    |         | -                      |
| 其他投资     |         | -                      |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                      |
| 债权投资     | 6.4.7.5 | -                      |
| 其中：债券投资  |         | -                      |
| 资产支持证券投资 |         | -                      |
| 其他投资     |         | -                      |
| 其他债权投资   | 6.4.7.6 | -                      |

|               |            |                           |
|---------------|------------|---------------------------|
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                         |
| 应收清算款         |            | -                         |
| 应收股利          |            | -                         |
| 应收申购款         |            | 18,451,863.95             |
| 递延所得税资产       |            | -                         |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         |
| 资产总计          |            | 846,417,999.86            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年6月30日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                           |
| 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         |            | 20,084,681.16             |
| 应付赎回款         |            | 24,033,196.54             |
| 应付管理人报酬       |            | 12,851.61                 |
| 应付托管费         |            | 2,570.29                  |
| 应付销售服务费       |            | 99,222.12                 |
| 应付投资顾问费       |            | -                         |
| 应交税费          |            | 361,056.99                |
| 应付利润          |            | -                         |
| 递延所得税负债       |            | -                         |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 105,047.06                |
| 负债合计          |            | 44,698,625.77             |
| <b>净资产:</b>   |            |                           |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 645,278,723.66            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 156,440,650.43            |
| 净资产合计         |            | 801,719,374.09            |
| 负债和净资产总计      |            | 846,417,999.86            |

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 645,278,723.66 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.2428 元，基金份额 134,584,582.02 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.2423 元，基金份额 510,694,141.64 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                             | 附注号        | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）<br>至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|------------|-----------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>                  |            | 132,298,516.10                                      |
| 1. 利息收入                         |            | 57,208.18                                           |
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.7.13   | 57,208.18                                           |
| 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）               |            | 12,627,582.27                                       |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | 1,700,332.76                                        |
| 基金投资收益                          | 6.4.7.15   | 10,927,208.53                                       |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.16   | -93.02                                              |
| 资产支持证券投资收益                      | 6.4.7.17   | -                                                   |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.18   | -                                                   |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.19   | -                                                   |
| 股利收益                            | 6.4.7.20   | 134.00                                              |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>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“-”<br>号填列）      | 6.4.7.21   | 119,243,207.33                                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）              |            | -                                                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）              | 6.4.7.22   | 370,518.32                                          |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 383,493.81                                          |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 90,610.40                                           |
| 其中：暂估管理人报酬                      |            | -                                                   |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 18,122.05                                           |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 200,883.16                                          |
| 4. 投资顾问费                        |            | -                                                   |
| 5. 利息支出                         |            | -                                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |            | -                                                   |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.23   | -                                                   |
| 7. 税金及附加                        |            | 39,387.37                                           |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.24   | 34,490.83                                           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号<br/>填列）</b> |            | 131,915,022.29                                      |
| 减：所得税费用                         |            | -                                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>        |            | 131,915,022.29                                      |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>            |            | -                                                   |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 131,915,022.29                                      |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）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                                | -                                               | -      | -              | -               |
| 加：会计政策变更                                 | -                                               | -      | -              | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                               | -      | -              | -               |
| 其他                                       | -                                               | -      | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 435,586,285.94                                  | -      | -              | 435,586,285.94  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 209,692,437.72                                  | -      | 156,440,650.43 | 366,133,088.15  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                               | -      | 131,915,022.29 | 131,915,022.29  |
| （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）      | 209,692,437.72                                  | -      | 24,525,628.14  | 234,218,065.86  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 803,705,164.30                                  | -      | 86,263,231.16  | 889,968,395.46  |
| 2. 基金赎回款                                 | -594,012,726.58                                 | -      | -61,737,603.02 | -655,750,329.60 |
| （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                                | 645,278,723.66                                  | -      | 156,440,650.43 | 801,719,374.09  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>康乐</u> | <u>吴建军</u> | <u>邵媛媛</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2026]467 号文《关于准予景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的批复》，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《景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》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 2026 年 4 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 4 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 435,556,019.33 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 30,266.61 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 435,586,285.94 元，折合 435,586,285.94 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（2026）验字第 70015711\_H15 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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

本基金是景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标 ETF”）的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数的紧密跟踪的全被动指数基金，本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%，年化跟踪误差控制在 4%以内。

本基金投资范围主要为目标 ETF 基金份额、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国内依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票及存托凭证）、银行存款、同业存单、债券（国债、金融债（含商业银行金融债）、政府支持机构债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易可转债

的纯债部分)、可交换债券、次级债)、债券回购、衍生品(包括股指期货、股票期权)、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。本基金参与金融衍生品交易的,每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证金及应收申购款等。

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 4 月 23 日(基金合同生效日)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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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。

### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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，并

于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 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。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------------------|
| 活期存款              | 60,262,092.81          |
| 等于：本金             | 60,259,144.60          |
| 加：应计利息            | 2,948.21               |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 定期存款              | —                      |
| 等于：本金             | —                      |
| 加：应计利息            | —                      |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内    | —                      |
| 存款期限 1 个月（含）-3 个月 | —                      |
| 存款期限 3 个月（含）至 1 年 | —                      |
| 存款期限 1 年（含）以上     | —                      |
| 其他存款              | —                      |
| 等于：本金             | —                      |
| 加：应计利息            | —                      |
| 减：坏账准备            | —                      |
| 合计                | 60,262,092.81          |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |                |                |
|---------------|------------------------|------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | -                      | -    | -              | -              |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -    | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | -    | -              | -              |
|               | 银行间市场                  | -    | -              | -              |
|               | 合计                     | -    | -              | -              |
| 资产支持证券        | -                      | -    | -              | -              |
| 基金            | 642,948,441.91         | -    | 762,191,649.24 | 119,243,207.33 |
| 其他            | -                      | -    | -              | -              |
| 合计            | 642,948,441.91         | -    | 762,191,649.24 | 119,243,207.33 |

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 18.38                  |
| 应付证券出借违约金   | —                      |
| 应付交易费用      | 70,937.85              |
| 其中：交易所市场    | 70,937.85              |
| 银行间市场       | —                      |
| 应付利息        | —                      |
| 预提费用        | 34,090.83              |
| 合计          | 105,047.06             |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|-------------------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额           |
| 基金合同生效日       | 86,377,848.56                                   | 86,377,848.56  |
| 本期申购          | 132,196,734.49                                  | 132,196,734.49 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -83,990,001.03                                  | -83,990,001.03 |
| 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 | 134,584,582.02 | 134,584,582.02 |
|-----|----------------|----------------|

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C

| 项目            | 本期                                        |                 |
|---------------|-------------------------------------------|-----------------|
|               | 2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                                   | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 349,208,437.38                            | 349,208,437.38  |
| 本期申购          | 671,508,429.81                            | 671,508,429.81  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -510,022,725.55                           | -510,022,725.55 |
| 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           | 510,694,141.64                            | 510,694,141.64  |

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2026 年 4 月 23 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 435,556,019.33 元，折合 435,556,019.33 份基金份额（其中 A 类基金份额 86,368,276.97 份，C 类基金份额 349,187,742.36 份）；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 30,266.61 元，折合 30,266.61 份基金份额（其中 A 类基金份额 9,571.59 份，C 类基金份额 20,695.02 份）。以上收到的实收基金共计人民币 435,586,285.94 元，折合 435,586,285.94 份基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 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           | 2,658,667.09 | 24,740,888.06 | 27,399,555.15 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 55,341.32    | 5,222,946.94  | 5,278,288.26  |
| 其中：基金申购款       | 681,135.67   | 13,336,459.16 | 14,017,594.83 |
| 基金赎回款          | -625,794.35  | -8,113,512.22 | -8,739,306.57 |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 2,714,008.41 | 29,963,835.00 | 32,677,843.41 |

景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 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           | 10,013,147.87 | 94,502,319.27  | 104,515,467.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 76,567.92     | 19,170,771.96  | 19,247,339.88  |
| 其中：基金申购款       | 3,679,581.20  | 68,566,055.13  | 72,245,636.33  |
| 基金赎回款          | -3,603,013.28 | -49,395,283.17 | -52,998,296.45 |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 10,089,715.79 | 113,673,091.23 | 123,762,807.02 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 55,537.97                                       |
| 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 | 1,437.30                                        |
| 其他        | 232.91                                          |
| 合计        | 57,208.18                                       |

#### 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<br>2026年4月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|------------------|--------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -94,280.74                           |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                    |
| 股票投资收益——申购差价收入   | 1,794,613.50                         |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                    |
| 合计               | 1,700,332.76                         |

##### 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<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | -                                               |
| 减：卖出股票成本总额 | -                                               |

|          |            |
|----------|------------|
| 减：交易费用   | 94,280.74  |
| 买卖股票差价收入 | -94,280.74 |

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2026年4月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|-------------|--------------------------------------|
| 申购基金份额总额    | 703,516,400.00                       |
| 减：现金支付申购款总额 | 337,972,927.29                       |
| 减：申购股票成本总额  | 363,748,859.21                       |
| 减：交易费用      | —                                    |
| 申购差价收入      | 1,794,613.50                         |

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2026年4月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|-------------------|--------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 184,831,668.51                       |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 173,562,681.36                       |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 328,222.92                           |
| 减：交易费用            | 13,555.70                            |
| 基金投资收益            | 10,927,208.53                        |

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年4月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |
|------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 171.98                               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -265.00                              |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | —                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | —                                    |
| 合计                           | -93.02                               |

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年4月23日（基金合同生效日）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   | 5,323,730.92 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,302,915.00 |
| 减：应计利息总额               | 21,080.92    |
| 减：交易费用                 | -            |
| 买卖债券差价收入               | -265.00      |

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 134.00                                          |
| 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            | 134.00                                          |

#### 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|-------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 119,243,207.33                                  |
| 股票投资       | -                                               |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 债券投资                   | —              |
| 资产支持证券投资               | —              |
| 基金投资                   | 119,243,207.33 |
| 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                     | 119,243,207.33 |

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|-------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 369,475.85                                      |
| 基金转换费收入 | 1,042.47                                        |
| 合计      | 370,518.32                                      |

#### 6.4.7.23 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|-------------------------------------------------|
| 审计费用    | 9,545.46                                        |
| 信息披露费   | 24,545.37                                       |
| 证券出借违约金 | —                                               |
| 其他      | 400.00                                          |
| 合计      | 34,490.83                                       |

#### 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、登记机构、基金销售机构 |
| 中信证券股份有限公司（“中信证券”）                         | 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          |
| 景顺资产管理有限公司                                 | 基金管理人的股东          |
| 开滦(集团)有限责任公司                               | 基金管理人的股东          |
| 大连实德集团有限公司                                 | 基金管理人的股东          |
| 景顺长城资产管理(深圳)有限公司                           | 基金管理人的子公司         |
| 景顺长城中证科创创业人工智能交易型<br>开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”） | 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                     |
|-------|-------------------------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                                            | 占当期股票<br>成交总额的比例（%） |
| 中信证券  | 363,748,859.21                                  | 100.00              |

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年4月23日（基金合同生效日）至2026年6月30日 |                   |              |                     |
|-------|--------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|       | 当期<br>佣金                             | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 中信证券  | 70,937.85                            | 100.00            | 70,937.85    | 100.00              |

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

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

##### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 90,610.40                                       |

|                  |             |
|------------------|-------------|
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 302,710.53  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | -212,100.13 |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的目标 ETF 而调减，因此应支付基金管理人的净管理费可能为负。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取零）的 0.50% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值） × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 18,122.05                                       |

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取零）的 0.10% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值） × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                         |        |
|----------------|-------------------------------------------------|-------------------------|--------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                |                         |        |
|                | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A                         | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C | 合计     |
| 景顺长城基金管理有限公司   | -                                               | -                       | -      |
| 中信证券           | -                                               | 127.41                  | 127.41 |
| 长城证券           | -                                               | -                       | -      |
| 合计             | -                                               | 127.41                  | 127.41 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

（1）基金管理人直销机构：

对于 C 类基金份额计提的销售服务费，在投资人赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资人。

(2) 代销机构：

对于投资人持续持有期限未超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额计提的销售服务费，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

对于持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，在投资人赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款或清算款一并返还给投资人。

#### 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

本基金本报告期末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

本基金于本报告期末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

本基金于本报告期末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

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2026 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日 |                             |
|---------------------------------|-------------------------------------------------|-----------------------------|
|                                 | 景顺长城中证科创创业人工智能<br>ETF 联接 A                      | 景顺长城中证科创创业人工智<br>能 ETF 联接 C |
| 基金合同生效日（2026 年 4 月 23 日）持有的基金份额 | 10,000,388.89                                   | —                           |
| 报告期初持有的基金份额                     | —                                               | —                           |
| 报告期间申购/买入总份额                    | —                                               | —                           |
| 报告期间因拆分变动份额                     | —                                               | —                           |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | —                                               | —                           |
| 报告期末持有的基金份额                     | 10,000,388.89                                   | —                           |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 7.43%                                           | —                           |

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额；

2、对于分级基金，报告期末持有的基金份额占比计算时分母采用各自级别的份额；

3、投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金本报告期末将银行存款保管于关联方。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有 480,999,400.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 52.21%。

#### 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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券。

#### 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公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月 30<br>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                      | 60,262,092.81 | -      | -        | -     | -     | -              | 60,262,092.81  |
| 结算备付金                     | 4,809,828.22  | -      | -        | -     | -     | -              | 4,809,828.22   |
| 存出保证金                     | 702,565.64    | -      | -        | -     | -     | -              | 702,565.64     |
| 交易性金融资产                   | -             | -      | -        | -     | -     | 762,191,649.24 | 762,191,649.24 |
| 应收申购款                     | -             | -      | -        | -     | -     | 18,451,863.95  | 18,451,863.95  |
| 资产总计                      | 65,774,486.67 | -      | -        | -     | -     | 780,643,513.19 | 846,417,999.86 |
| 负债                        |               |        |          |       |       |                |                |
| 应付赎回款                     | -             | -      | -        | -     | -     | 24,033,196.54  | 24,033,196.54  |
| 应付管理人报酬                   | -             | -      | -        | -     | -     | 12,851.61      | 12,851.61      |
| 应付托管费                     | -             | -      | -        | -     | -     | 2,570.29       | 2,570.29       |
| 应付清算款                     | -             | -      | -        | -     | -     | 20,084,681.16  | 20,084,681.16  |
| 应付销售服务费                   | -             | -      | -        | -     | -     | 99,222.12      | 99,222.12      |
| 应交税费                      | -             | -      | -        | -     | -     | 361,056.99     | 361,056.99     |
| 其他负债                      | -             | -      | -        | -     | -     | 105,047.06     | 105,047.06     |
| 负债总计                      | -             | -      | -        | -     | -     | 44,698,625.77  | 44,698,625.77  |
| 利率敏感度缺口                   | 65,774,486.67 | -      | -        | -     | -     | -              | -              |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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<br>2026 年 6 月 30 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  | —                      | —            |
| 交易性金融资产—基金投资  | 762,191,649.24         | 95.07        |
| 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            | 762,191,649.24         | 95.07        |

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）        |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 67,022,461.23               |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -67,022,461.23              |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | 762, 191, 649. 24      |
| 第二层次          | -                      |
| 第三层次          | -                      |
| 合计            | 762, 191, 649. 24      |

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   | -                 | -             |
|    | 其中：股票  | -                 | -             |
| 2  | 基金投资   | 762, 191, 649. 24 | 90. 05        |
| 3  | 固定收益投资 | -                 | -             |
|    | 其中：债券  | -                 | -             |
|    | 资产支持证券 | -                 | -             |
| 4  | 贵金属投资  | -                 | -             |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 65,071,921.03  | 7.69   |
| 8 | 其他各项资产            | 19,154,429.59  | 2.26   |
| 9 | 合计                | 846,417,999.86 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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  | 300502 | 新易盛  | 75,161,333.80 | 9.38           |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 74,760,216.00 | 9.32           |
| 3  | 300857 | 协创数据 | 36,700,777.95 | 4.58           |
| 4  | 300442 | 润泽科技 | 28,011,478.29 | 3.49           |
| 5  | 300223 | 北京君正 | 17,883,352.00 | 2.23           |
| 6  | 300418 | 昆仑万维 | 16,325,959.00 | 2.04           |
| 7  | 300454 | 深信服  | 11,169,600.00 | 1.39           |
| 8  | 300458 | 全志科技 | 9,295,873.63  | 1.16           |
| 9  | 300496 | 中科创达 | 8,805,410.00  | 1.10           |
| 10 | 300383 | 光环新网 | 8,704,320.00  | 1.09           |
| 11 | 300474 | 景嘉微  | 8,676,564.00  | 1.08           |
| 12 | 300364 | 中文在线 | 7,871,103.00  | 0.98           |
| 13 | 300738 | 奥飞数据 | 7,650,181.00  | 0.95           |
| 14 | 300002 | 神州泰岳 | 6,933,107.00  | 0.86           |
| 15 | 300253 | 卫宁健康 | 5,815,140.00  | 0.73           |
| 16 | 300166 | 东方国信 | 5,767,589.35  | 0.72           |
| 17 | 300229 | 拓尔思  | 4,731,592.00  | 0.59           |
| 18 | 301536 | 星宸科技 | 4,650,135.00  | 0.58           |
| 19 | 300045 | 华力创通 | 4,364,388.19  | 0.54           |
| 20 | 301316 | 慧博云通 | 4,336,346.00  | 0.54           |

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细**

无。

**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 | 363,748,859.21 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | -              |

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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

**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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                         | 基金类型    | 运作方式        | 管理人          | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------------|---------|-------------|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型指数基金 | 交易型开放式(ETF) | 景顺长城基金管理有限公司 | 762,191,649.24 | 95.07        |

**7.11 本基金投资股指期货的投资政策**

为了更好地实现投资目标，基金还有权投资于股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生工具。

基金投资股指期货、股票期权等衍生工具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、股票期权合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。基金还可适度参与目标 ETF 基金份额交易和申购、赎回以及股指期货、

股票期权之间的投资操作，以更好地跟踪标的指数。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.13.3 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 | 702,565.64    |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 18,451,863.95 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 19,154,429.59 |

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别                                   | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 景顺长城<br>中证科创<br>创业人工<br>智能 ETF<br>联接 A | 18,615           | 7,229.90      | 10,000,388.89 | 7.43              | 124,584,193.13 | 92.57                 |
| 景顺长城<br>中证科创<br>创业人工<br>智能 ETF<br>联接 C | 88,864           | 5,746.92      | 181,534.69    | 0.04              | 510,512,606.95 | 99.96                 |
| 合计                                     | 107,479          | 6,003.77      | 10,181,923.58 | 1.58              | 635,096,800.08 | 98.42                 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A | 197,008.13 | 0.146382    |
|                              | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C | 45,732.58  | 0.008955    |
|                              | 合计                      | 242,740.71 | 0.037618    |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                         | 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、<br>基金投资和相关部门<br>负责人持有本开放式<br>基金 | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A | —                 |
|                                            | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C | —                 |
|                                            | 合计                      | —                 |

|                     |                         |       |
|---------------------|-------------------------|-------|
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 A | 10~50 |
|                     | 景顺长城中证科创创业人工智能 ETF 联接 C | —     |
|                     | 合计                      | 10~50 |

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,388.89 | 1.55                        | 10,000,000.00 | 2.30                    | 3 年            |
| 基金管理人高级管理人员 | —             | —                           | —             | —                       | —              |
| 基金经理等人员     | —             | —                           | —             | —                       | —              |
| 基金管理人股东     | —             | —                           | —             | —                       | —              |
| 其他          | —             | —                           | —             | —                       | —              |
| 合计          | 10,000,388.89 | 1.55                        | 10,000,000.00 | 2.30                    | —              |

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 景顺长城中证科创创业人工智能<br>ETF 联接 A | 景顺长城中证科创创业人工智能<br>ETF 联接 C |
|----------------------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 基金合同生效日<br>(2026 年 4 月 23 日)<br>基金份额总额 | 86,377,848.56              | 349,208,437.38             |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金总申<br>购份额          | 132,196,734.49             | 671,508,429.81             |
| 减：基金合同生效日<br>起至报告期期末基金<br>总赎回份额        | 83,990,001.03              | 510,022,725.55             |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金拆分<br>变动份额         | —                          | —                          |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                       | 134,584,582.02             | 510,694,141.64             |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

### 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|                    | 数量 | 成交金额           | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) |                       |
|--------------------|----|----------------|--------------------------|-----------|-----------------------|-----------------------|
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 2  | 363,748,859.21 | 100.00                   | 70,937.85 | 100.00                | 本期<br>报告<br>新增<br>2 个 |

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

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

### 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商<br>名称                   | 债券交易          |                                 | 债券回购交易           |                                       | 权证交易             |                                 | 基金交易           |                             |
|----------------------------|---------------|---------------------------------|------------------|---------------------------------------|------------------|---------------------------------|----------------|-----------------------------|
|                            | 成交金额          | 占当期<br>债券成<br>交总额<br>的比例<br>(%) | 成<br>交<br>金<br>额 | 占当期<br>债券回<br>购成交<br>总额的<br>比例<br>(%) | 成<br>交<br>金<br>额 | 占当期<br>权证成<br>交总额<br>的比例<br>(%) | 成交金额           | 占当期基<br>金成交总<br>额的比例<br>(%) |
| 中信<br>证券<br>股份<br>有限<br>公司 | 10,605,565.00 | 100.00                          | -                | -                                     | -                | -                               | 297,119,670.11 | 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 |
| 3  | 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 |
| 4  | 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 |
| 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 3 月 25 日 |
| 6  | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |

|    |                                                       |              |                 |
|----|-------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 接基金基金合同                                               |              |                 |
| 7  | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额发售公告           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |
| 8  | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要           | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |
| 9  | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议               | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |
| 10 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同及招募说明书提示性公告    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |
| 11 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书              | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 26 日 |
| 12 | 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 |
| 13 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金新增肯特瑞等多家公司为销售机构的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 14 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金新增万家财富为销售机构的公告     | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 1 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 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数型证券投资基金发起式联接基金新增开源证券为销售机构的公告    | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 21 日 |
| 18 | 关于景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同生效的公告        | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 24 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                   | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 4 月 29 日 |

|    |                                                                    |              |                 |
|----|--------------------------------------------------------------------|--------------|-----------------|
|    | 与股东大会投票信息披露                                                        |              |                 |
| 21 | 景顺长城基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告                                          | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 7 日  |
| 22 | 景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告       | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 7 日  |
| 23 | 关于景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金参加部分销售机构申购及或定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 7 日  |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 关于景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金新增招商银行为销售机构的公告                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 15 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 21 日 |
| 28 | 关于景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金新增光大证券为销售机构的公告                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 5 月 22 日 |
| 29 | 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 |
| 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 5 月 27 日 |
| 31 | 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  |
| 32 | 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  |
| 33 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增排排网销售为销售机构的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 22 日 |
| 34 | 景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知                                            | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 23 日 |
| 35 | 关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金新增汇添富财富为销售机构的公告                                | 中国证监会指定报刊及网站 | 2026 年 6 月 25 日 |
| 36 | 景顺长城基金管理有限公司关于旗下                                                   | 中国证监会指定报刊及   | 2026 年 6 月 26 日 |

|  |                 |    |  |
|--|-----------------|----|--|
|  | 基金调整持有股票估值价格的公告 | 网站 |  |
|--|-----------------|----|--|

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证科创创业人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；
- 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