

长信上证科创板综合指数增强型证券投资 基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	12
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）	14
6.1 资产负债表	14
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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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	49
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信上证科创板综合指数增强	
基金主代码	025866	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 17 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	98,201,532.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信上证科创板综合指数增强 A	长信上证科创板综合指数增 强 C
下属分级基金的交易代码	025866	025867
报告期末下属分级基金的份额总额	19,503,378.40 份	78,698,153.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，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。本基金若投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	冯萌
	联系电话	021-61009999	021-52629999-213310
	电子邮箱	zhouygcxfund.com.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		4007005566	95561
传真		021-61009800	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		肖剑	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	长信上证科创板综合指数增强 A	长信上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	10,354,076.63	39,259,784.95
本期利润	14,956,387.87	57,118,393.02
加权平均基金份额本期利润	0.3117	0.2864
本期加权平均净值利润率	29.99%	27.69%
本期基金份额净值增长率	50.44%	50.13%
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	4,368,534.35	17,406,343.52
期末可供分配基金份额利润	0.2240	0.2212
期末基金资产净值	27,108,902.96	109,140,214.42
期末基金份额净值	1.3900	1.3868
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	51.05%	50.72%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信上证科创板综合指数增强 A

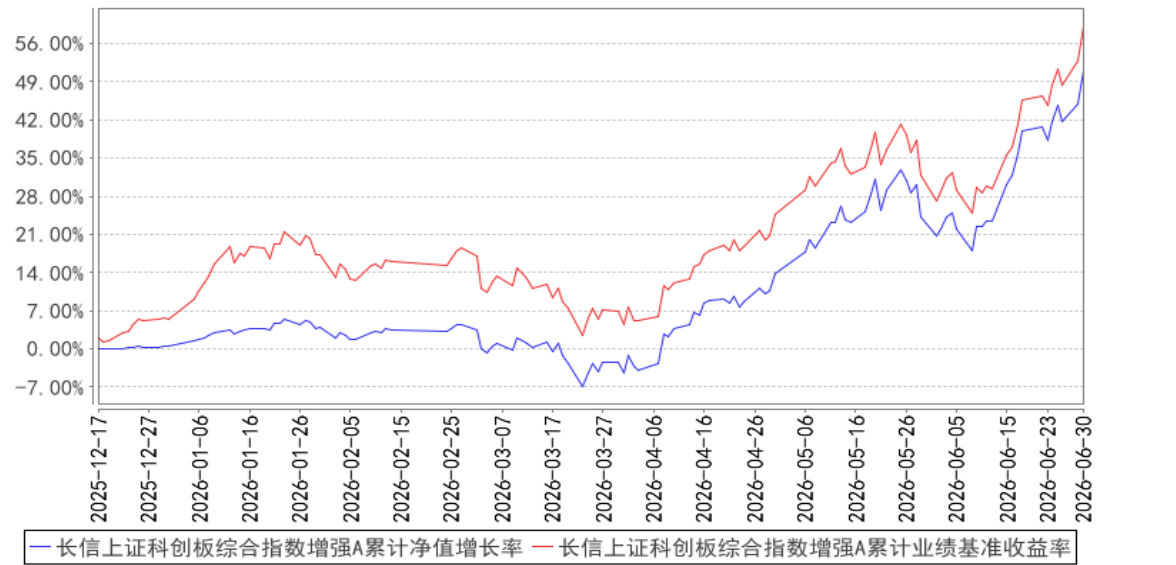
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	58.00%	2.26%	52.44%	2.24%	5.56%	0.02%
过去六个月	50.44%	1.89%	50.92%	2.11%	-0.48%	-0.22%
自基金合同生效起至今	51.05%	1.80%	59.10%	2.03%	-8.05%	-0.23%

长信上证科创板综合指数增强 C

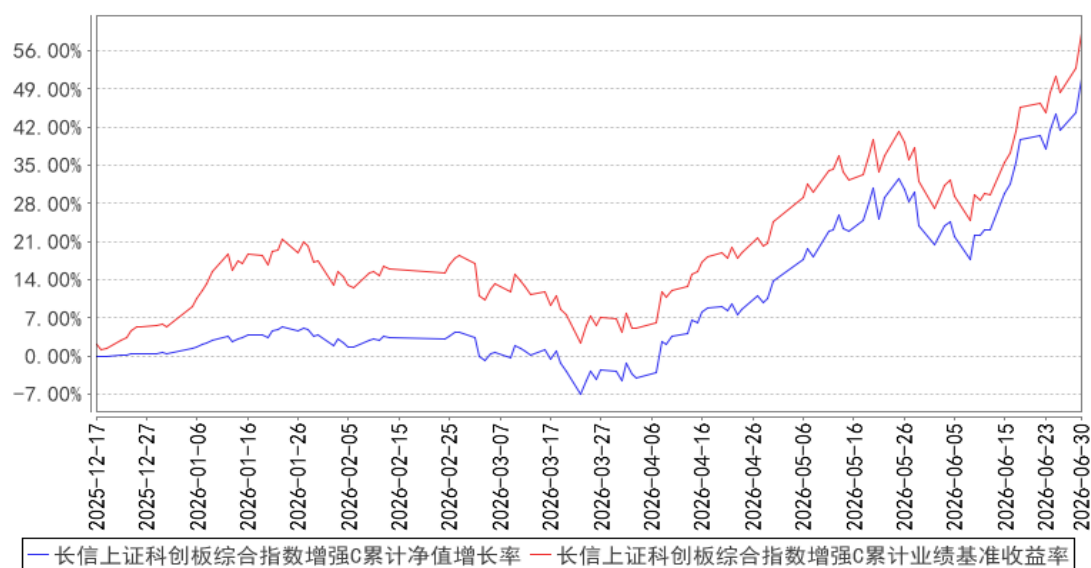
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	57.82%	2.26%	52.44%	2.24%	5.38%	0.02%
过去六个月	50.13%	1.89%	50.92%	2.11%	-0.79%	-0.22%
自基金合同生效起至今	50.72%	1.80%	59.10%	2.03%	-8.38%	-0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长信上证科创板综合指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 17 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2025 年 12 月 17 日至 2026 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型

证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信

中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金、长信均衡配置混合型证券投资基金、长信稳健汇利 90 天持有期债券型证券投资基金、长信汇众量化选股混合型证券投资基金、长信北证 50 成份指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金和长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理、量化投资管理中心总经理兼量化投资部总监	2025 年 12 月 17 日	-	16 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和 risk 与绩效评估研究员、量化研究部总监、总经理助理、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF)、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信量化优选混合型证券投资基金 (LOF)、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 和长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金的基金经理。现

					任量化投资管理中心总经理兼量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金和长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，市场维持高位震荡，板块行情分化明显。一季度受中东战争影响有所回落，石油价格一度突破 100 美元，能源板块阶段性受益；二季度 AI 算力相关的板块领涨，5 月以来受到资金追捧而加速上涨，行业分化愈演愈烈，传统行业相对弱势。沪深两市成交活跃度较高，成交额维持在历史较高水平。随着中东局势的逐渐缓和，传统能源和新能源板块均有所回落，市场重新回到 AI 科技爆发的叙事中，全球主要市场均呈现半导体领涨的格局。市场风格方面，AI 算力相关领域的大幅上涨推动大盘、高贝塔、高动量、高成长风格相对占优。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，长信上证科创板综合指数增强 A 基金份额净值为 1.3900 元，份额累计净值为 1.4880 元，本报告期内长信上证科创板综合指数增强 A 净值增长率为 50.44%；长信上证科创板综合指数增强 C 基金份额净值为 1.3868 元，份额累计净值为 1.4848 元，本报告期内长信上证科创板综合指数增强 C 净值增长率为 50.13%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，算力基建已经越来越成为未来 AI 发展的基石，终端算力需求正在推动半导体和通信的整条产业链进行技术的快速迭代升级，而算力所需要的天量能源也将助推能源建设开启新的增长周期。在地缘局势逐渐缓解、不确定性降低的背景下，新质生产力和科技创新有望成为推动经济增长和产业升级的新动能。AI、机器人、新能源等重点产业的技术突破、新技术产业化落地将开启新一轮资本开支周期，持续的研发投入将带动相关资产价值重估，在市场交易持续活跃的状态下有望获得更多关注，具备相对较好的成长空间。在上半年动量行情的背景下，当前的调整有利于下半年的市场机会更加均衡，超额收益机会的广度有望增加。在投资策略上，本基金坚持以基本面为主导，综合考量短期交易情绪、中期行业景气度及长期竞争格局，自下而上精选景气度边际改善、质地优异且被市场低估的优质个股。综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争为投资者获取长期稳健超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人根据相关法律法规和本基金基金合同约定已于 2026 年 2 月 4 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.360 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.360 元，于 2026 年 6 月 24 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.620 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.620 元。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、

收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	10,961,067.75	270,838,724.86
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	129,046,358.87	106,186,753.54
其中：股票投资		129,046,358.87	106,186,753.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-25,746.85
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		1,339,304.51	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		141,346,731.13	376,999,731.55
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		4,873,504.78	-
应付管理人报酬		87,851.53	115,412.10
应付托管费		10,981.41	14,426.51
应付销售服务费		35,203.78	46,887.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	100.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	90,072.25	-
负债合计		5,097,613.75	176,825.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	98,201,532.04	375,356,643.31
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	38,047,585.34	1,466,262.27
净资产合计		136,249,117.38	376,822,905.58
负债和净资产总计		141,346,731.13	376,999,731.55

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，长信上证科创板综合指数增强 A 份额净值 1.3900 元；长信上证科创板综合指数增强 C 份额净值 1.3868 元；基金份额总额为 98,201,532.04 份，其中长信上证科创板综合指数增强 A 份额 19,503,378.40 份。长信上证科创板综合指数增强 C 份额 78,698,153.64 份。

- 2、货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。
- 3、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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
一、营业总收入		73,747,737.54
1. 利息收入		92,435.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,726.42
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		25,709.37
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		51,178,462.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	50,865,077.94
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
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	313,384.56
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	22,460,919.31
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	15,919.94
减：二、营业总支出		1,672,956.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,033,283.26
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	129,160.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	416,174.19
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		4.49
8. 其他费用	6.4.7.23	94,334.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		72,074,780.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		72,074,780.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		72,074,780.89

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	375,356,643.31	-	1,466,262.27	376,822,905.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	375,356,643.31	-	1,466,262.27	376,822,905.58
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-277,155,111.27	-	36,581,323.07	-240,573,788.20
（一）、综合收益总额	-	-	72,074,780.89	72,074,780.89
（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）	-277,155,111.27	-	-15,757,286.24	-292,912,397.51
其中：1. 基金申购款	42,391,516.16	-	7,310,952.85	49,702,469.01
2. 基金赎回款	-319,546,627.43	-	-23,068,239.09	-342,614,866.52
（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）	-	-	-19,736,171.58	-19,736,171.58
（四）、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	98,201,532.04	-	38,047,585.34	136,249,117.38

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：

肖剑

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]2229 号《关于准予长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司自 2025 年 11 月 17 日至 2025 年 12 月 15 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具德师报（验）字（25）第 00430 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2025 年 12 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 375,284,512.84 元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币 72,130.47 元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币 375,356,643.31 元，折合基金份额 375,356,643.31 份，其中 A 类基金份额 70,368,226.10 份，C 类基金份额 304,988,417.21 份。本基金的基金管理人及注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据认购、申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金份额时收取认购、申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

本基金的标的指数为上证科创板综合指数。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、国内依法发行或上市的其他股票（包括主板、创业板、科创板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于

港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。国债期货、股指期货、股票期权、信用衍生品及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如果法律法规或中国证监会对该比例要求有变更的，在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%

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发布的《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发布的其他相关规定。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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）占基金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）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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

(1) 基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；若《基金合同》生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(2) 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

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

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

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，并履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整。

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。

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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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%；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；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

6.4.6.2 增值税

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 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《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：

本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人，

适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；

至 2027 年 12 月 31 日，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、债券的转让收入免征增值税。至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	5,343,468.50
等于：本金	5,342,893.70
加：应计利息	574.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,617,599.25
等于：本金	5,617,522.96
加：应计利息	76.29
减：坏账准备	-
合计	10,961,067.75

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	105,625,891.34	-	129,046,358.87	23,420,467.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		105,625,891.34	-	129,046,358.87	23,420,467.53

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

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

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
其他	812.10
合计	90,072.25

注：其他为券商结算股息红利提前到账。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信上证科创板综合指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,368,226.10	70,368,226.10
本期申购	4,237,561.98	4,237,561.98
本期赎回（以“-”号填列）	-55,102,409.68	-55,102,409.68
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	19,503,378.40	19,503,378.40

长信上证科创板综合指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,988,417.21	304,988,417.21
本期申购	38,153,954.18	38,153,954.18
本期赎回（以“-”号填列）	-264,444,217.75	-264,444,217.75
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	78,698,153.64	78,698,153.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	103,794.15	179,890.94	283,685.09
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	103,794.15	179,890.94	283,685.09
本期利润	10,354,076.63	4,602,311.24	14,956,387.87
本期基金份额交易产生的变动数	-2,334,713.02	-1,545,211.97	-3,879,924.99
其中：基金申购款	489,063.45	252,785.65	741,849.10
基金赎回款	-2,823,776.47	-1,797,997.62	-4,621,774.09
本期已分配利润	-3,754,623.41	-	-3,754,623.41
本期末	4,368,534.35	3,236,990.21	7,605,524.56

长信上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	402,919.90	779,657.28	1,182,577.18
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	402,919.90	779,657.28	1,182,577.18
本期利润	39,259,784.95	17,858,608.07	57,118,393.02
本期基金份额交易产生的变动数	-6,274,813.16	-5,602,548.09	-11,877,361.25
其中：基金申购款	4,567,192.50	2,001,911.25	6,569,103.75
基金赎回款	-10,842,005.66	-7,604,459.34	-18,446,465.00
本期已分配利润	-15,981,548.17	-	-15,981,548.17
本期末	17,406,343.52	13,035,717.26	30,442,060.78

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	50,767.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,956.19
结算备付金利息收入	-
其他	2.73
合计	66,726.42

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	866,620,809.89
减：卖出股票成本总额	814,885,164.74
减：交易费用	870,567.21
买卖股票差价收入	50,865,077.94

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	313,384.56
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	313,384.56

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	22,460,919.31
股票投资	22,460,919.31
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	22,460,919.31

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	15,919.94
合计	15,919.94

注：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25% 应归基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用	5,036.80
存托服务费	37.39
合计	94,334.34

注：其他费用为银行手续费。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长江证券	1,681,552,143.47	100.00

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长江证券	329,472.27	100.00	—	—

注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,033,283.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	514,862.61
应支付基金管理人的净管理费	518,420.65

注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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
当期发生的基金应支付的托管费	129,160.37

注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信上证科创板综合指数增强 A	长信上证科创板综合指数增强 C	合计
长信基金	—	8.90	8.90
兴业银行	—	282,821.32	282,821.32
长江证券	—	39,598.17	39,598.17
合计	—	322,428.39	322,428.39

注：1、本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。计算方法如下：

$$H=E\times 0.4\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期内无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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

基金管理人在这报告期末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

除基金管理人之外的其他关联方在这报告期末及上年度末均未投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	5,343,468.50	50,767.50

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 17 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在这报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金这报告期末存放于长江证券的证券交易结算资金余额为人民币 5,617,599.25 元（2025 年 12 月 31 日：人民币 195,468,574.69 元）；这报告期存放于长江证券的证券交易结算资金产生的利息收入为人民币 15,956.19 元（无上年度可比区间）。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

长信上证科创板综合指数增强 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2 月 4 日	-	2026 年 2 月 4 日	0.360	2,464,134 .83	69,122.51	2,533,257 .34	-
2	2026 年 6 月 24 日	-	2026 年 6 月 24 日	0.620	1,169,427 .13	51,938.94	1,221,366 .07	-
合计	-	-	-	0.980	3,633,561 .96	121,061.45	3,754,623 .41	-
长信上证科创板综合指数增强 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 2	-	2026 年 2 月	0.360	10,767,48	212,099.69	10,979,58	-

	月 4 日		4 日		3.40		3.09	
2	2026 年 6 月 24 日	-	2026 年 6 月 24 日	0.620	4,635,187.12	366,777.96	5,001,965.08	-
合计	-	-	-	0.980	15,402,670.52	578,877.65	15,981,548.17	-

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
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	47	1,574.03	1,594.71	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	2,557	57,992.76	107,803.12	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	63	5,158.44	99,812.79	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	798	5,115.18	19,255.74	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	207	5,439.96	35,622.63	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	376	7,399.68	53,200.24	-

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	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	2,455	1,121,598.34	2,159,246.15	-

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 6 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金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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融出证券。

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

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

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

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

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中

的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现

投资的风险。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	10,961,067.75	-	-	-	-	10,961,067.75
交易性金融资产	-	-	-	-	129,046,358.87	129,046,358.87
应收申购款	-	-	-	-	1,339,304.51	1,339,304.51
资产总计	10,961,067.75	-	-	-	130,385,663.38	141,346,731.13
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,873,504.78	4,873,504.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	87,851.53	87,851.53
应付托管费	-	-	-	-	10,981.41	10,981.41
应付销售服务费	-	-	-	-	35,203.78	35,203.78
其他负债	-	-	-	-	90,072.25	90,072.25

负债总计	-	-	-	-	5,097,613.75	5,097,613.75
利率敏感度缺口	10,961,067.75	-	-	-	-125,288,049.63	136,249,117.38
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	270,838,724.86	-	-	-	-	270,838,724.86
交易性金融资产	-	-	-	-	106,186,753.54	106,186,753.54
买入返售金融资产	-25,746.85	-	-	-	-	-25,746.85
资产总计	270,812,978.01	-	-	-	106,186,753.54	376,999,731.55
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	115,412.10	115,412.10
应付托管费	-	-	-	-	14,426.51	14,426.51
应付销售服务费	-	-	-	-	46,887.25	46,887.25
应交税费	-	-	-	-	100.11	100.11
负债总计	-	-	-	-	176,825.97	176,825.97
利率敏感度缺口	270,812,978.01	-	-	-	-106,009,927.57	376,822,905.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	129,046,358.87	94.71	106,186,753.54	28.18
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	129,046,358.87	94.71	106,186,753.54	28.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 8.41%(2025 年 12 月 31 日 VaR 值为 1.56%)	-11,465,063.71	-5,888,960.88

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2025 年的分析同样基于该假设。

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	126,568,219.47	106,023,121.54
第二层次	2,159,246.15	163,632.00
第三层次	318,893.25	—
合计	129,046,358.87	106,186,753.54

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项

§ 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	129,046,358.87	91.30
	其中：股票	129,046,358.87	91.30
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,961,067.75	7.75
8	其他各项资产	1,339,304.51	0.95
9	合计	141,346,731.13	100.00

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

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	80,923,390.55	59.39
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	21,357,906.35	15.68
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	5,058,212.50	3.71
N	水利、环境和公共设施管理业	1,096,626.80	0.80
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	108,436,136.20	79.59

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	591,652.00	0.43
C	制造业	18,226,923.67	13.38
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	1,506,351.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	258,416.00	0.19
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	26,880.00	0.02
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	20,610,222.67	15.13

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

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	688041	海光信息	24,018	8,893,865.40	6.53
2	688256	寒武纪	4,905	7,826,172.75	5.74
3	688981	中芯国际	25,868	4,108,355.76	3.02
4	688498	源杰科技	1,370	2,583,820.00	1.90
5	688120	华海清科	7,848	2,528,468.64	1.86
6	688396	华润微	23,388	2,281,499.40	1.67
7	688629	华丰科技	11,590	2,173,240.90	1.60
8	688072	拓荆科技	2,455	2,159,246.15	1.58
9	688795	摩尔线程	2,846	2,039,130.54	1.50
10	688728	格科微	95,391	2,007,026.64	1.47
11	688008	澜起科技	6,391	1,980,570.90	1.45
12	688766	普冉股份	2,581	1,978,594.60	1.45
13	688409	富创精密	6,361	1,948,056.25	1.43
14	688802	沐曦股份	2,297	1,902,605.10	1.40
15	688110	东芯股份	9,025	1,838,392.50	1.35
16	688012	中微公司	3,873	1,814,500.50	1.33
17	688469	芯联集成	170,400	1,807,944.00	1.33
18	688266	泽璟制药	14,206	1,657,271.96	1.22
19	688141	杰华特	10,645	1,634,007.50	1.20
20	688002	睿创微纳	10,348	1,600,732.12	1.17
21	688111	金山办公	7,430	1,582,961.50	1.16
22	688025	杰普特	3,267	1,535,490.00	1.13
23	688372	伟测科技	8,100	1,506,600.00	1.11

24	688652	京仪装备	7,213	1,443,826.21	1.06
25	688668	鼎通科技	3,800	1,418,540.00	1.04
26	688699	明微电子	17,000	1,393,150.00	1.02
27	688202	美迪西	16,347	1,319,366.37	0.97
28	688257	新锐股份	12,821	1,306,459.90	0.96
29	688388	嘉元科技	29,483	1,297,252.00	0.95
30	688615	合合信息	11,326	1,280,970.60	0.94
31	688559	海目星	14,835	1,244,953.20	0.91
32	688046	药康生物	51,312	1,241,750.40	0.91
33	688549	中巨芯	33,287	1,225,294.47	0.90
34	688475	萤石网络	44,673	1,221,806.55	0.90
35	688231	隆达股份	33,094	1,215,542.62	0.89
36	688221	前沿生物	54,141	1,212,758.40	0.89
37	688239	航宇科技	20,132	1,204,497.56	0.88
38	688620	安凯微	73,721	1,194,280.20	0.88
39	688390	固德威	10,952	1,188,401.52	0.87
40	688327	云从科技	92,412	1,151,453.52	0.85
41	688378	奥来德	18,479	1,145,698.00	0.84
42	688035	德邦科技	12,373	1,135,841.40	0.83
43	688226	威腾电气	26,066	1,116,406.78	0.82
44	688700	东威科技	12,451	1,113,119.40	0.82
45	688059	华锐精密	5,535	1,105,394.85	0.81
46	688609	九联科技	100,131	1,102,442.31	0.81
47	688449	联芸科技	12,716	1,097,517.96	0.81
48	688480	赛恩斯	12,520	1,096,626.80	0.80
49	688577	浙海德曼	23,873	1,094,099.59	0.80
50	688787	海天瑞声	8,121	1,091,868.45	0.80
51	688216	气派科技	25,975	1,091,209.75	0.80
52	688045	必易微	13,305	1,074,777.90	0.79
53	688128	中国电研	43,355	1,029,247.70	0.76
54	688639	华恒生物	63,032	1,017,336.48	0.75
55	688365	光云科技	63,784	1,005,873.68	0.74
56	688222	成都先导	30,593	982,341.23	0.72
57	688626	翔宇医疗	21,902	969,382.52	0.71
58	688456	有研粉材	6,566	916,613.60	0.67
59	688410	山外山	61,721	886,313.56	0.65
60	688599	天合光能	61,895	873,957.40	0.64
61	688516	奥特维	15,060	864,293.40	0.63
62	688018	乐鑫科技	6,271	802,186.32	0.59
63	688737	中自科技	40,982	784,395.48	0.58
64	688536	思瑞浦	2,107	767,137.63	0.56
65	688533	上声电子	28,600	596,596.00	0.44
66	688525	佰维存储	1,035	512,045.55	0.38

67	688220	翱捷科技	3,372	419,207.04	0.31
68	688029	南微医学	5,700	409,260.00	0.30
69	688208	道通科技	15,870	399,765.30	0.29
70	688521	芯原股份	856	317,695.84	0.23
71	688183	生益电子	1,600	211,840.00	0.16
72	688702	盛科通信	436	170,035.64	0.12
73	688369	致远互联	7,006	147,196.06	0.11
74	688653	康希通信	1,860	32,326.80	0.02
75	688429	时创能源	2,741	27,930.79	0.02
76	688530	欧莱新材	264	25,581.60	0.02
77	688211	中科微至	453	15,592.26	0.01
78	688281	华秦科技	300	15,069.00	0.01
79	688061	灿瑞科技	300	14,901.00	0.01
80	688105	诺唯赞	470	8,154.50	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	300458	全志科技	23,700	935,202.00	0.69
2	300666	江丰电子	2,500	921,500.00	0.68
3	301536	星辰科技	7,000	900,970.00	0.66
4	300475	香农芯创	3,000	900,000.00	0.66
5	301150	中一科技	13,120	828,003.20	0.61
6	605117	德业股份	7,660	813,338.80	0.60
7	002384	东山精密	3,100	813,285.00	0.60
8	002415	海康威视	23,600	807,120.00	0.59
9	605007	五洲特纸	59,200	792,688.00	0.58
10	300681	英搏尔	26,800	767,016.00	0.56
11	300308	中际旭创	600	762,000.00	0.56
12	600482	中国动力	22,800	747,840.00	0.55
13	002414	高德红外	54,600	723,996.00	0.53
14	603197	保隆科技	25,400	709,676.00	0.52
15	300438	鹏辉能源	8,400	695,940.00	0.51
16	000957	中通客车	70,700	661,752.00	0.49
17	605123	派克新材	6,800	659,668.00	0.48
18	000933	神火股份	30,400	644,480.00	0.47
19	603225	新凤鸣	32,500	638,625.00	0.47
20	601061	中信金属	56,300	606,351.00	0.45
21	300661	圣邦股份	4,200	602,616.00	0.44
22	601168	西部矿业	21,800	591,652.00	0.43
23	300453	三鑫医疗	63,500	574,040.00	0.42
24	600522	中天科技	9,300	564,324.00	0.41
25	605189	富春染织	43,800	527,790.00	0.39
26	301526	国际复材	10,400	485,368.00	0.36

27	300207	欣旺达	24,900	472,851.00	0.35
28	000589	贵州轮胎	105,400	427,924.00	0.31
29	002120	韵达股份	38,800	246,768.00	0.18
30	600487	亨通光电	2,100	229,614.00	0.17
31	002156	通富微电	1,500	113,805.00	0.08
32	688781	视涯科技	2,557	107,803.12	0.08
33	688808	联讯仪器	63	99,812.79	0.07
34	688820	盛合晶微	376	53,200.24	0.04
35	300503	昊志机电	400	36,920.00	0.03
36	688813	泰金新能	207	35,622.63	0.03
37	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.02
38	603588	高能环境	1,400	26,880.00	0.02
39	688811	有研复材	798	19,255.74	0.01
40	002134	天津普林	400	12,168.00	0.01
41	002468	申通快递	800	11,648.00	0.01
42	002897	意华股份	79	6,950.42	0.01
43	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
44	603293	埃泰克	47	1,594.71	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	688041	海光信息	23,264,877.57	6.17
2	688981	中芯国际	13,977,193.56	3.71
3	688012	中微公司	13,315,037.16	3.53
4	688256	寒武纪	11,796,025.42	3.13
5	688521	芯原股份	10,447,065.70	2.77
6	688111	金山办公	9,556,679.43	2.54
7	688629	华丰科技	8,876,928.45	2.36
8	688449	联芸科技	8,802,676.45	2.34
9	688072	拓荆科技	8,376,190.04	2.22
10	688008	澜起科技	7,858,091.57	2.09
11	688599	天合光能	7,787,941.20	2.07
12	688110	东芯股份	7,420,848.99	1.97
13	688795	摩尔线程	7,261,598.84	1.93
14	688222	成都先导	7,014,651.57	1.86
15	688002	睿创微纳	6,958,128.95	1.85
16	688271	联影医疗	6,836,447.30	1.81
17	688525	佰维存储	6,817,823.22	1.81
18	688047	龙芯中科	6,753,930.17	1.79
19	688486	龙迅股份	6,456,053.48	1.71
20	688802	沐曦股份	6,378,213.09	1.69

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

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	688041	海光信息	28,410,119.63	7.54
2	688256	寒武纪	16,017,585.99	4.25
3	688521	芯原股份	15,229,654.63	4.04
4	688981	中芯国际	14,698,567.71	3.90
5	688012	中微公司	13,047,780.27	3.46
6	688072	拓荆科技	11,854,812.38	3.15
7	688111	金山办公	10,283,745.00	2.73
8	688008	澜起科技	9,926,698.39	2.63
9	688449	联芸科技	8,603,901.08	2.28
10	688525	佰维存储	8,531,220.49	2.26
11	688002	睿创微纳	8,298,893.86	2.20
12	688271	联影医疗	8,068,634.63	2.14
13	688127	蓝特光学	7,863,715.51	2.09
14	688629	华丰科技	7,686,344.50	2.04
15	688222	成都先导	7,581,335.96	2.01
16	688599	天合光能	7,082,618.69	1.88
17	688380	中微半导	6,997,410.54	1.86
18	688700	东威科技	6,860,558.26	1.82
19	688047	龙芯中科	6,713,601.92	1.78
20	688486	龙迅股份	6,680,717.80	1.77

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

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	815,283,850.76
卖出股票收入（成交）总额	866,620,809.89

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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。

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。

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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

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

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同约定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,339,304.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,339,304.51

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	2,159,246.15	1.58	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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
长信上证科创板综合指数增强 A	465	41,942.75	0.00	0.00	19,503,378.40	100.00
长信上证科创板综合指数增强 C	1,337	58,861.75	1,200,605.56	1.53	77,497,548.08	98.47
合计	1,802	54,495.86	1,200,605.56	1.22	97,000,926.48	98.78

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

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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信上证科创板综合指数增强 A	0.00	0.00
	长信上证科创板综合指数增强 C	6,649.39	0.01
	合计	6,649.39	0.01

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基

金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信上证科创板综合指数增强 A	0
	长信上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信上证科创板综合指数增强 A	0
	长信上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信上证科创板综合指数增强 A	长信上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 17 日）基金份额总额	70,368,226.10	304,988,417.21
本报告期期初基金份额总额	70,368,226.10	304,988,417.21
本报告期基金总申购份额	4,237,561.98	38,153,954.18
减：本报告期基金总赎回份额	55,102,409.68	264,444,217.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,503,378.40	78,698,153.64

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2026 年 3 月 19 日起，刘元瑞先生不再担任公司董事长，由肖剑先生担任公司董事长。

自 2026 年 4 月 3 日起，经工商行政管理部门核准，公司法定代表人变更为肖剑先生。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	长信基金管理有限责任公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 4 月 30 日
采取调查或处罚等措施的机构	上海证券交易所
受到调查或处罚等措施类型	其他（自律监管措施）
受到的具体措施类型	警示
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（新股网下询价）
受到处罚的依据	《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则（2025 年修订）》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已落实优化模型、完善机制等整改措施，完成整改工作。
其他	无

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，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无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 (%)	
长江证券	2	1,681,552,143.47	100.00	329,472.27	100.00	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

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

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

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 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-

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	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-13
2	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22
3	长信基金管理有限责任公司关于长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-2-3

	的分红公告		
4	长信基金管理有限责任公司关于长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务并参与部分销售机构申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-2-24
5	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
6	长信基金管理有限责任公司关于董事变更情况的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
8	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-31
9	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-3
10	长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
11	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2026 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
12	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026-4-30
13	长信基金管理有限责任公司关于长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金的分红公告	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-23
14	长信基金管理有限责任公司关于长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-23
15	长信基金管理有限责任公司关于长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-24
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金的基金合同提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-27

§ 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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2026 年 8 月 31 日