

长盛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：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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
§ 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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55

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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	长盛上证科创板综合指数增强	
基金主代码	025576	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 22 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	22,681,207.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛上证科创板综合指数增强 A	长盛上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025576	025577
报告期末下属分级基金的份额总额	10,058,448.01 份	12,622,759.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取量化方法进行组合管理，力争在控制跟踪误差的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的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 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。 本基金除跟踪标的指数外，亦可通过成份股权重优化增强和非成份股优选等增强策略对投资组合进行优化，利用公司自主研发的量化多因子选股模型进行股票投资价值定量分析，并在此基础上构建股票投资组合。在力求有效跟踪标的指数基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 1、股票投资策略 指数化被动投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整，力争控制本基金与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差。 量化增强策略主要采用超额收益模型和风险优化模型构建股票投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。 2、存托凭证的投资策略 3、固定收益品种投资策略 4、衍生产品投资/交易策略 5、融资、转融通证券出借业务投资策略 6、其他 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。本基金除了投资 A 股以外，还可以根据法律法规规定投资港股通标的股

	票。本基金若投资港股通标的的股票，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		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	任航
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100029	100031
法定代表人		胡甲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长盛上证科创板综合指数增强 A	长盛上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	3,721,703.12	3,626,667.95
本期利润	8,459,185.88	8,328,768.07
加权平均基金份额本期利润	0.1314	0.1481
本期加权平均净值利润率	12.95%	14.57%
本期基金份额净值增值	41.44%	41.16%

长率		
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	2,236,248.21	2,773,215.81
期末可供分配基金份额利润	0.2223	0.2197
期末基金资产净值	14,225,606.50	17,814,934.75
期末基金份额净值	1.4143	1.4113
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	41.43%	41.13%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

4、本基金基金合同生效日为 2025 年 12 月 22 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛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	48.69%	2.13%	52.44%	2.24%	-3.75%	-0.11%
过去六个月	41.44%	1.63%	50.92%	2.11%	-9.48%	-0.48%
自基金合同生效起至今	41.43%	1.58%	56.90%	2.05%	-15.47%	-0.47%

长盛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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

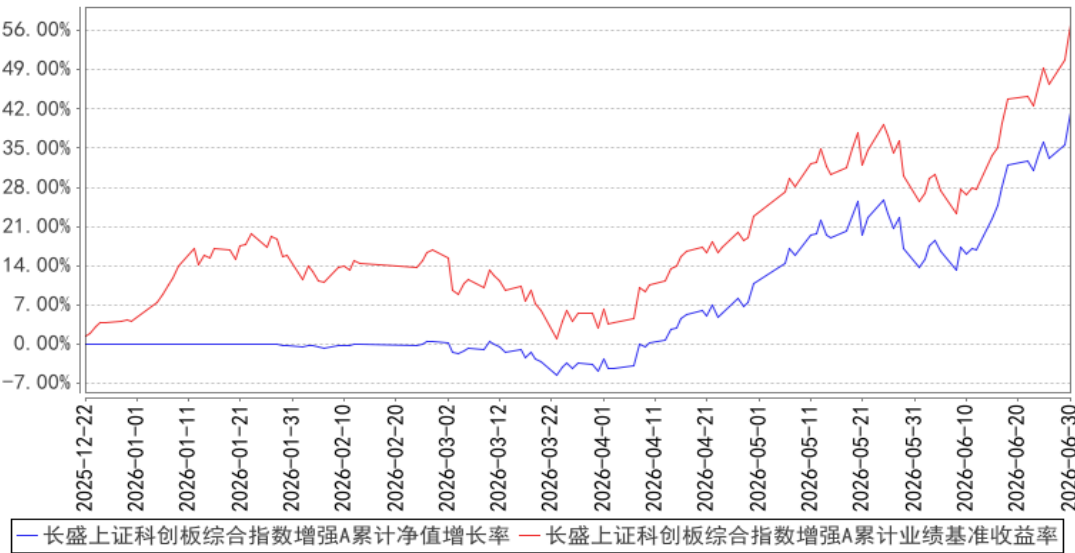
过去三个月	48.53%	2.12%	52.44%	2.24%	-3.91%	-0.12%
过去六个月	41.16%	1.63%	50.92%	2.11%	-9.76%	-0.48%
自基金合同生效起 至今	41.13%	1.58%	56.90%	2.05%	-15.77 %	-0.47%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

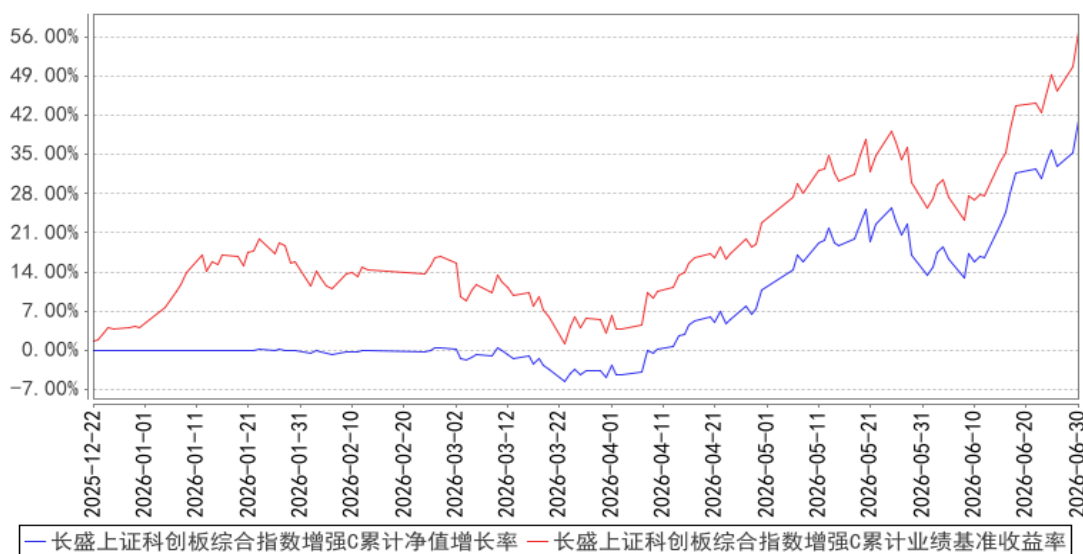
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中上证科创板芯片指数、人民币银行活期存款利率（税后）每日按照95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

长盛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



长盛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 22 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证 A100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理，长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，长盛上证科创板芯片指数发起式证券投资基金基金经理，长盛聚利债券型证券投资基金基金经理，量化投资部总经理助理。	2025 年 12 月 22 日	-	17 年	陈 亘 斯 先 生， 硕 士。 曾 任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易

执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2026 年上半年 A 股市场整体在经历 2025 年四季度的震荡调整后，在 1 月初重新启动快速上涨且成交量同步急剧放大，其中科技出海板块的光通信、电路板及其上游的玻纤、光纤等细分板块上行动能充沛，而红利板块走势呈现明显的负相关性。其后在主要宽基 ETF 的资金大幅流出的引导下，市场的波动率有所降低，价格水平在高位保持震荡。2 月底 3 月初受到中东地缘冲突的突发影响，国际油价大幅调升并在高位剧烈震荡，使得全球投资者对于美联储本年度的降息空间转向极为谨慎的态度，对于滞胀风险的评估显著提升，风险偏好快速下降，进而传导至 A 股市场，使得国内股市发生显著的大面积回调，即使基本面受益的石油石化、储存芯片等板块亦冲高回落，而红利板块则走势相对稳健。

其后在二季度由于国内适度宽松的政策托底、新质生产力相关产业的持续落地，以及外部地缘风险的边际缓和，市场在 4 月后逐步修复并呈现结构性行情。本季度市场整体呈现“K 型分化”特征，科技成长板块一枝独秀，而传统消费、金融地产等板块普遍承压。在板块结构上，AI 硬科技产业链成为绝对主线。成长板块内部，电子、通信、半导体设备等细分领域受 AI 产业资本开支扩张、国产替代加速驱动，全季度涨幅位居行业前列，成为拉动 A 股指数的核心动力；成长板块内部亦呈现明显的结构性轮动，资金精准流向业绩落地、技术突破的上游细分环节，对缺乏业绩支撑的纯概念标的逐步规避。红利与价值板块方面，受消费复苏不及预期、地产行业持续承压影响，食品饮料、银行、非银金融、房地产等板块普遍出现下跌，仅高股息、业绩确定性强的地方性银行、公用事业板块展现出一定的抗跌性，成为市场震荡中的防御性选择。此外，本季度市场日均成交金额维持在 3 万亿左右的高位，但交易集中度显著提升，“一九行情”特征凸显，多数个股难以跑赢指数，需警惕板块极致分化后出现的风格再均衡带来的短期波动风险。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛上证科创板综合指数增强 A 的基金份额净值为 1.4143 元，本报告期基金份额净值增长率为 41.44%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；截至本报告期末长盛上证科创板综合指数增强 C 的基金份额净值为 1.4113 元，本报告期基金份额净值增长率为 41.16%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。本报告期内日均跟踪偏离度为 0.7144%，年度化跟踪误差为 16.5928%。由于本报告期内部分时间基金处于建仓阶段，因此跟踪误差会显著大于合同约定目标，待建仓期完成后会力争控制在合同约定范围内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，美国科技巨头的资本开支在经历两年的大幅扩张的爆发期后，后续大概率进入边际增速放缓的平台期，目前 AI 应用在编程等方面的企业用户端有显著突破，但普通消费者端的应用性价比仍有待观察。AI 科技行业的设备原料相关的 PPI 持续处于高企状态，即所谓的 AI 产业链通胀，使得 AI 科技行业能在高企的美债利率背景下持续吸引资本流入形成正循环，但目前我们一看到部分巨头对于算力的利用率出现裂隙，并且叠加巨头们开始普遍进行债务融资，现金流压力陡增，使得市场对于美国科技行业尤其是上游设备材料的定价开始由分子端转向分母端。我们预计 AI 科技行业的景气度大概率仍会持续一段时间，但其股价受到的影响因素可能会进入成长预期和建设成本二者的拉扯阶段。此外再考虑到上半年全球科技股极致走势所吸引的杠杆资金的入场比重，杠杆率对于波动率的敏感性大概率使得其股价走势的波动率加大，风险收益率

比值下降，动量因子难以维持，而反转因子很可能重新回到历史水平。A 股的科技板块受日韩和美国股市影响，亦容易进入类似的状态，但我们对 A 股市场整体仍维持震荡向上的较为乐观的态度，因为在上半年的极致分化行情中，以医药、消费、银行、公用事业为代表的红利板块和质量板块已经调整出有效的配置空间，并且当下我们看到国内宏观政策已经开始将注意力转向内需消费和居民收入提升。如果美国 AI 科技的成长预期无法维持高增速，外加中东地缘冲突的持续对于滞胀的引导，那么科技产业链的出口一旦受到较大压力，我们预计国内刺激政策会相应加码作为对冲来扭转 K 型经济走势，而这一转变目前是市场尚未充分预期的，也是未来收益弹性的希望所在。未来 AI 应用的大面积落地和形成有效的商业闭环可能亦需要居民的收入和消费信心的修复和提升来形成发育的土壤。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本基金自 2026 年 5 月 12 日至 2026 年 6 月 30 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金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进行核查，以上内容真实、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：长盛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	2,186,321.99	303,893,666.38
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	30,446,094.21	-
其中：股票投资		30,446,094.21	-
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	-	-
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		356,534.84	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		32,988,951.04	303,893,666.38
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		831,768.54	-
应付管理人报酬		22,256.03	59,936.93
应付托管费		2,781.98	7,492.11
应付销售服务费		5,790.53	12,417.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	85,812.71	-
负债合计		948,409.79	79,846.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	22,681,207.02	303,871,477.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	9,359,334.23	-57,657.54
净资产合计		32,040,541.25	303,813,820.10
负债和净资产总计		32,988,951.04	303,893,666.38

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛上证科创板综合指数增强 A 的基金份额净值为 1.4143 元，份额总额为 10,058,448.01 份；长盛上证科创板综合指数增强 C 的基金份额净值为 1.4113 元，份额总额为 12,622,759.01 份。基金份额总额 22,681,207.02 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛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		17,543,170.96
1. 利息收入		66,463.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	66,463.28
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）		8,036,094.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	7,959,417.47
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	76,676.79
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	9,439,582.88
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	1,030.54
减：二、营业总支出		755,217.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	493,691.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,711.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	115,271.36
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		-
8. 其他费用	6.4.7.23	84,542.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,787,953.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,787,953.95
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		16,787,953.95

注：本基金合同于 2025 年 12 月 22 日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	303,871,477.64	-57,657.54	303,813,820.10
二、本期期初净资产	303,871,477.64	-57,657.54	303,813,820.10
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-281,190,270.62	9,416,991.77	-271,773,278.85
（一）、综合收益总额	-	16,787,953.95	16,787,953.95
（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）	-281,190,270.62	-7,370,962.18	-288,561,232.80
其中：1. 基金申购款	13,872,335.83	1,318,219.77	15,190,555.60
2. 基金赎回款	-295,062,606.45	-8,689,181.95	-303,751,788.40
（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、本期期末净资产	22,681,207.02	9,359,334.23	32,040,541.25

注：本基金合同于 2025 年 12 月 22 日生效，无上年度可比期间。

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：

胡甲

张壬午

龚珉

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

长盛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〕1913 号的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2025 年 12 月 22 日生效，于基金合同生效日，本基金规模为 303,871,477.64 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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、申购时收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且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 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股及其备选成份股（均含存托凭证，下同），其他非标的指数成份股（包含主板、创业板及其他国内依法发行或上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、金融衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具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）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和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：本基金以标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准：上证科创板综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税

后) × 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>》,以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、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 日和 2025 年 12 月 31 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值变动情况。

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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以

外，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，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

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。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。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）占基金净值比例计算的金额。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）占基金净值比例计算的金额。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预期收益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) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金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予以确认。

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所有者权益转出。

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。

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‰；

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；

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。

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 号文《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 号文

《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，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《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，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，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

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，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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	824,809.91
等于：本金	824,704.42
加：应计利息	105.49
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	1,361,512.08
等于：本金	1,361,471.74
加：应计利息	40.34
减：坏账准备	-
合计	2,186,321.99

注：其他存款余额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		21,006,511.33	-	30,446,094.21	9,439,582.88
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		21,006,511.33	-	30,446,094.21	9,439,582.88

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-

其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
其他	1,510.15
合计	85,812.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛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	177,961,014.79	177,961,014.79
本期申购	8,714,219.04	8,714,219.04
本期赎回（以“-”号填列）	-176,616,785.82	-176,616,785.82
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	10,058,448.01	10,058,448.01

长盛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	125,910,462.85	125,910,462.85
本期申购	5,158,116.79	5,158,116.79
本期赎回（以“-”号填列）	-118,445,820.63	-118,445,820.63
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	12,622,759.01	12,622,759.01

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

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

长盛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	-26,495.29	-	-26,495.29
本期期初	-26,495.29	-	-26,495.29

本期利润	3,721,703.12	4,737,482.76	8,459,185.88
本期基金份额交易产生的变动数	-1,458,959.62	-2,806,572.48	-4,265,532.10
其中：基金申购款	253,691.51	323,126.41	576,817.92
基金赎回款	-1,712,651.13	-3,129,698.89	-4,842,350.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,236,248.21	1,930,910.28	4,167,158.49

长盛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	-31,162.25	-	-31,162.25
本期期初	-31,162.25	-	-31,162.25
本期利润	3,626,667.95	4,702,100.12	8,328,768.07
本期基金份额交易产生的变动数	-822,289.89	-2,283,140.19	-3,105,430.08
其中：基金申购款	351,931.91	389,469.94	741,401.85
基金赎回款	-1,174,221.80	-2,672,610.13	-3,846,831.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,773,215.81	2,418,959.93	5,192,175.74

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	51,488.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	14,974.68
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	66,463.28

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。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,959,417.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	7,959,417.47

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	70,823,677.59
减：卖出股票成本总额	62,780,272.88
减：交易费用	83,987.24
买卖股票差价收入	7,959,417.47

6.4.7.15 债券投资收益

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	76,676.79
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	76,676.79

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	9,439,582.88
股票投资	9,439,582.88
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	9,439,582.88

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	1,030.54
合计	1,030.54

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	240.00
合计	84,542.56

6.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本报告期内，未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。

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
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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	493,691.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	243,623.41
应支付基金管理人的净管理费	250,068.27

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年管理费率计提。计算方法如下：

$H=E\times \text{年管理费率}/\text{当年天数}$

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

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	61,711.41

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

$H=E\times \text{年托管费率}/\text{当年天数}$

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

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		
	长盛上证科创板综合	长盛上证科创板综合	合计

	指数增强 A	指数增强 C	
国元证券	—	9.38	9.38
农业银行	—	109,595.32	109,595.32
合计	—	109,604.70	109,604.70

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.40%。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E\times\text{年销售服务费率}/\text{当年天数}$$

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

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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
中国农业银行	824,809.91	51,488.60
合计	824,809.91	51,488.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	662	235,835.76	550,784.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	异常波动停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	769	22,059.05	110,736.00	-

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风

险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,186,176.16	-	-	145.83	2,186,321.99
交易性金融资产	-	-	-	30,446,094.21	30,446,094.21
应收申购款	-	-	-	356,534.84	356,534.84
资产总计	2,186,176.16	-	-	30,802,774.88	32,988,951.04
负债					

应付赎回款	-	-	-	831,768.54	831,768.54
应付管理人报酬	-	-	-	22,256.03	22,256.03
应付托管费	-	-	-	2,781.98	2,781.98
应付销售服务费	-	-	-	5,790.53	5,790.53
其他负债	-	-	-	85,812.71	85,812.71
负债总计	-	-	-	948,409.79	948,409.79
利率敏感度缺口	2,186,176.16	-	-	29,854,365.09	32,040,541.25
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	303,871,077.64	-	-	22,588.74	303,893,666.38
资产总计	303,871,077.64	-	-	22,588.74	303,893,666.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	59,936.93	59,936.93
应付托管费	-	-	-	7,492.11	7,492.11
应付销售服务费	-	-	-	12,417.24	12,417.24
负债总计	-	-	-	79,846.28	79,846.28
利率敏感度缺口	303,871,077.64	-	-	-57,257.54	303,813,820.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	30,446,094.21	95.02	—	—
合计	30,446,094.21	95.02	—	—

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末成立未满一年，尚无充足的经验数据；上年度末未持有交易性权益类投资或持有的交易性权益类投资占比并不重大，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

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	29,784,574.21	—
第二层次	661,520.00	—
第三层次	—	—
合计	30,446,094.21	—

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（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

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

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	30,446,094.21	92.29
	其中：股票	30,446,094.21	92.29
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	2,186,321.99	6.63
8	其他各项资产	356,534.84	1.08
9	合计	32,988,951.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,445,324.72	76.29
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	5,208,644.00	16.26
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	569,085.76	1.78
N	水利、环境和公共设施管理业	223,039.73	0.70
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	30,446,094.21	95.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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持有港股通投资股票。

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	688498	源杰科技	670	1,263,620.00	3.94
2	688256	寒武纪	692	1,104,120.60	3.45
3	688072	拓荆科技	662	550,784.00	1.72
4	688802	沐曦股份	627	519,344.10	1.62
5	688627	精智达	721	515,515.00	1.61
6	688795	摩尔线程	700	501,543.00	1.57
7	688766	普冉股份	600	459,960.00	1.44
8	688200	华峰测控	666	349,716.60	1.09
9	688630	芯碁微装	600	329,634.00	1.03
10	688027	国盾量子	626	315,510.26	0.98
11	688082	盛美上海	719	310,608.00	0.97

12	688025	杰普特	656	308,320.00	0.96
13	688525	佰维存储	597	295,353.81	0.92
14	688048	长光华芯	578	290,156.00	0.91
15	688502	茂莱光学	400	277,440.00	0.87
16	688012	中微公司	580	271,730.00	0.85
17	688037	芯源微	600	263,430.00	0.82
18	688361	中科飞测	598	257,140.00	0.80
19	688041	海光信息	690	255,507.00	0.80
20	688017	绿的谐波	602	251,551.72	0.79
21	688167	炬光科技	661	234,132.81	0.73
22	688519	南亚新材	609	231,444.36	0.72
23	688120	华海清科	713	229,714.34	0.72
24	688521	芯原股份	603	223,797.42	0.70
25	688536	思瑞浦	600	218,454.00	0.68
26	688347	华虹宏力	647	217,586.10	0.68
27	688702	盛科通信	529	206,304.71	0.64
28	688409	富创精密	656	200,900.00	0.63
29	688668	鼎通科技	532	198,595.60	0.62
30	688052	纳芯微	672	193,744.32	0.60
31	688019	安集科技	565	191,794.90	0.60
32	688146	中船特气	536	187,594.64	0.59
33	688506	百利天恒	613	180,240.39	0.56
34	688411	海博思创	600	174,720.00	0.55
35	688008	澜起科技	532	164,866.80	0.51
36	688507	索辰科技	600	161,808.00	0.51
37	688268	华特气体	600	160,500.00	0.50
38	688235	百济神州	620	157,858.20	0.49
39	688368	晶丰明源	715	154,811.80	0.48
40	688300	联瑞新材	628	153,483.20	0.48
41	688111	金山办公	714	152,117.70	0.47
42	688020	方邦股份	600	149,760.00	0.47
43	688515	裕太微	600	149,256.00	0.47
44	688233	神工股份	690	147,949.80	0.46
45	688692	达梦数据	600	146,574.00	0.46
46	688205	德科立	686	142,818.34	0.45
47	688279	峰昭科技	600	134,664.00	0.42
48	688313	仕佳光子	720	132,948.00	0.41
49	688535	华海诚科	688	128,656.00	0.40
50	688123	聚辰股份	600	127,560.00	0.40
51	688392	骄成超声	560	127,220.80	0.40
52	688603	天承科技	600	124,770.00	0.39
53	688617	惠泰医疗	663	120,374.28	0.38
54	688652	京仪装备	600	120,102.00	0.37

55	688059	华锐精密	600	119,826.00	0.37
56	688359	三孚新科	600	119,064.00	0.37
57	688308	欧科亿	650	118,176.50	0.37
58	688143	长盈通	669	117,663.72	0.37
59	688110	东芯股份	564	114,886.80	0.36
60	688195	腾景科技	588	113,237.04	0.35
61	688383	新益昌	600	112,824.00	0.35
62	688629	华丰科技	598	112,130.98	0.35
63	688372	伟测科技	600	111,600.00	0.35
64	688260	昀冢科技	769	110,736.00	0.35
65	688585	上纬新材	667	110,588.60	0.35
66	688531	日联科技	600	106,704.00	0.33
67	688234	天岳先进	608	105,494.08	0.33
68	688610	埃科光电	400	105,360.00	0.33
69	688188	柏楚电子	965	102,965.50	0.32
70	688147	微导纳米	633	102,470.04	0.32
71	688686	奥普特	600	101,034.00	0.32
72	688608	恒玄科技	600	100,314.00	0.31
73	688661	和林微纳	625	99,362.50	0.31
74	688141	杰华特	647	99,314.50	0.31
75	688662	富信科技	567	95,256.00	0.30
76	688981	中芯国际	597	94,815.54	0.30
77	688002	睿创微纳	606	93,742.14	0.29
78	688028	沃尔德	600	93,522.00	0.29
79	688332	中科蓝讯	584	91,980.00	0.29
80	688018	乐鑫科技	718	91,846.56	0.29
81	688047	龙芯中科	585	90,481.95	0.28
82	688183	生益电子	676	89,502.40	0.28
83	688125	安达智能	534	87,309.00	0.27
84	688322	奥比中光	657	85,771.35	0.27
85	688266	泽璟制药	718	83,761.88	0.26
86	688456	有研粉材	600	83,760.00	0.26
87	688416	恒烁股份	580	81,200.00	0.25
88	688503	聚和材料	611	81,079.70	0.25
89	688301	奕瑞科技	641	79,484.00	0.25
90	688325	赛微微电	600	78,246.00	0.24
91	688545	兴福电子	580	77,174.80	0.24
92	688003	天准科技	600	76,380.00	0.24
93	688275	万润新能	598	76,274.90	0.24
94	688353	华盛锂电	653	75,793.71	0.24
95	688775	影石创新	545	75,564.25	0.24
96	688331	荣昌生物	580	75,550.80	0.24
97	688227	品高股份	715	73,423.35	0.23

98	688257	新锐股份	715	72,858.50	0.23
99	688258	卓易信息	600	71,124.00	0.22
100	688213	思特威	664	71,094.48	0.22
101	688691	灿芯股份	609	70,601.37	0.22
102	688376	美埃科技	600	69,780.00	0.22
103	688031	星环科技	600	69,108.00	0.22
104	688170	德龙激光	713	68,455.13	0.21
105	688390	固德威	630	68,361.30	0.21
106	688220	翱捷科技	547	68,003.04	0.21
107	688615	合合信息	600	67,860.00	0.21
108	688375	国博电子	635	66,230.50	0.21
109	688777	中控技术	558	65,565.00	0.20
110	688190	云路股份	721	65,401.91	0.20
111	688160	步科股份	600	65,262.00	0.20
112	688720	艾森股份	640	64,640.00	0.20
113	688578	艾力斯	588	64,209.60	0.20
114	688669	聚石化学	599	64,093.00	0.20
115	688271	联影医疗	633	64,078.59	0.20
116	688090	瑞松科技	598	63,657.10	0.20
117	688480	赛恩斯	725	63,502.75	0.20
118	688261	东微半导	601	63,062.93	0.20
119	688605	先锋精科	600	62,412.00	0.19
120	688693	锆威特	600	62,370.00	0.19
121	688449	联芸科技	698	60,244.38	0.19
122	688628	优利德	600	59,364.00	0.19
123	688677	海泰新光	580	58,655.40	0.18
124	688800	瑞可达	611	58,637.67	0.18
125	688530	欧莱新材	600	58,140.00	0.18
126	688401	路维光电	600	57,588.00	0.18
127	688328	深科达	600	57,420.00	0.18
128	688099	晶晨股份	557	57,315.30	0.18
129	688131	皓元医药	600	56,760.00	0.18
130	688559	海目星	674	56,562.08	0.18
131	688362	甬矽电子	586	56,490.40	0.18
132	688127	蓝特光学	574	56,022.40	0.17
133	688508	芯朋微	600	55,776.00	0.17
134	688230	芯导科技	700	55,167.00	0.17
135	688583	思看科技	640	54,892.80	0.17
136	688596	正帆科技	688	54,393.28	0.17
137	688386	泛亚微透	600	53,904.00	0.17
138	688787	海天瑞声	400	53,780.00	0.17
139	688700	东威科技	600	53,640.00	0.17
140	688035	德邦科技	584	53,611.20	0.17

141	688169	石头科技	564	53,563.08	0.17
142	688396	华润微	549	53,554.95	0.17
143	688198	佰仁医疗	600	53,544.00	0.17
144	688016	心脉医疗	600	53,184.00	0.17
145	688663	新风光	600	53,076.00	0.17
146	688478	晶升股份	599	53,041.45	0.17
147	688068	热景生物	600	51,960.00	0.16
148	688798	艾为电子	705	51,690.60	0.16
149	688625	呈和科技	608	51,321.28	0.16
150	688307	中润光学	640	51,168.00	0.16
151	688343	云天励飞	623	50,874.18	0.16
152	688676	金盘科技	600	50,784.00	0.16
153	688032	禾迈股份	600	50,712.00	0.16
154	688379	华光新材	600	50,418.00	0.16
155	688312	燕麦科技	600	50,394.00	0.16
156	688202	美迪西	619	49,959.49	0.16
157	688717	艾罗能源	600	49,542.00	0.15
158	688001	华兴源创	574	49,191.80	0.15
159	688699	明微电子	600	49,170.00	0.15
160	688155	先惠技术	600	48,534.00	0.15
161	688337	普源精电	640	47,955.20	0.15
162	688168	安博通	692	47,575.00	0.15
163	688419	耐科装备	600	47,190.00	0.15
164	688150	莱特光电	680	46,661.60	0.15
165	688112	鼎阳科技	635	46,647.10	0.15
166	688719	爱科赛博	600	46,200.00	0.14
167	688286	敏芯股份	400	46,028.00	0.14
168	688433	华曙高科	534	45,710.40	0.14
169	688172	燕东微	544	45,511.04	0.14
170	688248	南网科技	650	44,967.00	0.14
171	688400	凌云光	675	44,685.00	0.14
172	688103	国力电子	600	44,646.00	0.14
173	688611	杭州柯林	614	43,870.30	0.14
174	688380	中微半导	659	43,434.69	0.14
175	688029	南微医学	600	43,080.00	0.13
176	688181	八亿时空	687	43,006.20	0.13
177	688326	经纬恒润	600	42,528.00	0.13
178	688385	复旦微电	591	42,132.39	0.13
179	688011	新光光电	600	41,922.00	0.13
180	688486	龙迅股份	649	41,263.42	0.13
181	688318	财富趋势	577	41,145.87	0.13
182	688757	胜科纳米	615	41,020.50	0.13
183	688551	科威尔	580	40,756.60	0.13

184	688710	益诺思	600	40,320.00	0.13
185	688623	二元科技	400	40,184.00	0.13
186	688290	景业智能	600	39,816.00	0.12
187	688665	四方光电	600	39,420.00	0.12
188	688305	科德数控	600	39,162.00	0.12
189	688097	博众精工	617	38,901.85	0.12
190	688239	航宇科技	648	38,769.84	0.12
191	688656	浩欧博	400	38,708.00	0.12
192	688582	芯动联科	595	38,675.00	0.12
193	688036	传音控股	656	38,671.20	0.12
194	688485	九州一轨	603	38,628.18	0.12
195	688291	金橙子	658	38,479.84	0.12
196	688109	品茗科技	505	38,228.50	0.12
197	688689	银河微电	584	37,796.48	0.12
198	688378	奥来德	603	37,386.00	0.12
199	688122	西部超导	590	37,057.90	0.12
200	688187	时代电气	537	36,870.42	0.12
201	688083	中望软件	569	36,842.75	0.11
202	688278	特宝生物	677	36,828.80	0.11
203	688776	国光电气	599	36,742.66	0.11
204	688381	帝奥微	685	36,647.50	0.11
205	688185	康希诺	717	36,559.83	0.11
206	688309	恒誉环保	600	36,528.00	0.11
207	688295	中复神鹰	586	35,476.44	0.11
208	688253	英诺特	588	35,444.64	0.11
209	688114	华大智造	688	35,143.04	0.11
210	688721	龙图光罩	599	34,969.62	0.11
211	688282	理工导航	600	34,920.00	0.11
212	688345	博力威	600	34,848.00	0.11
213	688516	奥特维	600	34,434.00	0.11
214	688550	瑞联新材	594	34,362.90	0.11
215	688448	磁谷科技	540	34,322.40	0.11
216	688237	超卓航科	642	34,295.64	0.11
217	688063	派能科技	638	33,986.26	0.11
218	688323	瑞华泰	600	33,900.00	0.11
219	688484	南芯科技	595	33,611.55	0.10
220	688667	菱电电控	250	33,412.50	0.10
221	688607	康众医疗	653	33,303.00	0.10
222	688095	福昕软件	560	33,280.80	0.10
223	688163	赛伦生物	679	33,141.99	0.10
224	688621	阳光诺和	600	32,946.00	0.10
225	688685	迈信林	600	32,940.00	0.10
226	688577	浙海德曼	718	32,905.94	0.10

227	688115	思林杰	400	32,900.00	0.10
228	688698	伟创电气	626	32,833.70	0.10
229	688548	广钢气体	627	32,666.70	0.10
230	688523	航天环宇	623	32,645.20	0.10
231	688045	必易微	400	32,312.00	0.10
232	688073	毕得医药	600	32,292.00	0.10
233	688789	宏华数科	604	32,114.68	0.10
234	688601	力芯微	530	32,091.50	0.10
235	688336	三生国健	603	32,019.30	0.10
236	688580	伟思医疗	600	31,962.00	0.10
237	688655	迅捷兴	596	31,921.76	0.10
238	688499	利元亨	600	31,530.00	0.10
239	688249	晶合集成	530	31,285.90	0.10
240	688726	拉普拉斯	591	31,234.35	0.10
241	688778	厦钨新能	571	31,062.40	0.10
242	688581	安杰思	600	31,026.00	0.10
243	688228	开普云	400	30,936.00	0.10
244	688768	容知日新	600	30,924.00	0.10
245	688356	键凯科技	400	30,832.00	0.10
246	688218	江苏北人	559	30,722.64	0.10
247	688084	晶品特装	600	30,168.00	0.09
248	688598	金博股份	602	29,768.90	0.09
249	688106	金宏气体	711	29,492.28	0.09
250	688262	国芯科技	682	29,482.86	0.09
251	688563	航材股份	574	29,406.02	0.09
252	688091	上海谊众	718	28,863.60	0.09
253	688418	震有科技	600	28,848.00	0.09
254	688010	福光股份	590	28,691.70	0.09
255	688450	光格科技	428	28,671.72	0.09
256	688138	清溢光电	609	28,623.00	0.09
257	688056	莱伯泰科	440	28,402.00	0.09
258	688049	炬芯科技	600	28,146.00	0.09
258	688631	莱斯信息	600	28,146.00	0.09
259	688065	凯赛生物	586	28,040.10	0.09
260	689009	九号公司	728	27,773.20	0.09
261	688439	振华风光	600	27,720.00	0.09
262	688708	佳驰科技	544	27,635.20	0.09
263	688210	统联精密	677	27,425.27	0.09
264	688711	宏微科技	600	27,270.00	0.09
265	688281	华秦科技	541	27,174.43	0.08
266	688081	兴图新科	663	27,103.44	0.08
267	688593	新相微	692	26,932.64	0.08
268	688206	概伦电子	607	26,932.59	0.08

269	688107	安路科技	590	26,904.00	0.08
270	688297	中无人机	647	26,882.85	0.08
271	688799	华纳药厂	599	26,877.13	0.08
272	688061	灿瑞科技	541	26,871.47	0.08
273	688272	富吉瑞	600	26,640.00	0.08
274	688626	翔宇医疗	600	26,556.00	0.08
275	688039	当虹科技	707	26,385.24	0.08
276	688788	科思科技	586	26,358.28	0.08
277	688319	欧林生物	599	26,344.02	0.08
278	688595	芯海科技	600	26,316.00	0.08
279	688192	迪哲医药	655	26,154.15	0.08
280	688549	中巨芯	704	25,914.24	0.08
281	688102	斯瑞新材	549	25,901.82	0.08
282	688182	灿勤科技	600	25,842.00	0.08
283	688696	极米科技	400	25,816.00	0.08
284	688786	悦安新材	556	25,620.48	0.08
285	688584	上海合晶	711	25,560.45	0.08
286	688679	通源环境	599	25,211.91	0.08
287	688680	海优新材	600	25,200.00	0.08
288	688458	美芯晟	600	25,056.00	0.08
289	688388	嘉元科技	569	25,036.00	0.08
290	688166	博瑞医药	714	24,997.14	0.08
291	688320	禾川科技	600	24,870.00	0.08
292	688592	司南导航	600	24,864.00	0.08
293	688733	壹石通	600	24,810.00	0.08
294	688606	奥泰生物	600	24,648.00	0.08
295	688226	威腾电气	575	24,627.25	0.08
296	688690	纳微科技	557	24,563.70	0.08
297	688180	君实生物	724	24,485.68	0.08
298	688158	优刻得	653	24,004.28	0.07
299	688432	有研硅	600	23,982.00	0.07
300	688543	国科军工	600	23,670.00	0.07
301	688513	苑东生物	536	23,562.56	0.07
302	688259	创耀科技	600	23,472.00	0.07
303	688682	霍莱沃	600	23,340.00	0.07
304	688215	瑞晟智能	580	23,292.80	0.07
305	688273	麦澜德	600	23,244.00	0.07
306	688591	泰凌微	676	23,240.88	0.07
307	688069	德林海	621	23,200.56	0.07
308	688371	菲沃泰	595	23,199.05	0.07
309	688568	中科星图	554	22,974.38	0.07
310	688116	天奈科技	601	22,958.20	0.07
311	688135	利扬芯片	544	22,891.52	0.07

312	688093	世华科技	619	22,841.10	0.07
313	688126	沪硅产业	572	22,817.08	0.07
314	688479	友车科技	600	22,782.00	0.07
315	688683	莱尔科技	600	22,752.00	0.07
316	688520	神州细胞	663	22,681.23	0.07
317	688216	气派科技	536	22,517.36	0.07
318	688199	久日新材	651	22,479.03	0.07
319	688293	奥浦迈	538	22,429.22	0.07
320	688070	纵横股份	600	22,398.00	0.07
321	688023	安恒信息	600	22,032.00	0.07
322	688171	纬德信息	500	21,980.00	0.07
323	688358	祥生医疗	718	21,949.26	0.07
324	688648	中邮科技	600	21,930.00	0.07
325	688050	爱博医疗	600	21,870.00	0.07
326	688408	中信博	680	21,862.00	0.07
327	688636	智明达	600	21,738.00	0.07
328	688350	富淼科技	626	21,615.78	0.07
329	688391	钜泉科技	600	21,522.00	0.07
330	688191	智洋创新	601	21,455.70	0.07
331	688006	杭可科技	585	21,381.75	0.07
332	688087	英科再生	639	21,355.38	0.07
333	688671	碧兴物联	600	21,342.00	0.07
334	688231	隆达股份	580	21,303.40	0.07
335	688330	宏力达	627	21,211.41	0.07
336	688399	硕世生物	466	21,151.74	0.07
337	688302	海创药业	600	21,102.00	0.07
338	688363	华熙生物	588	21,032.76	0.07
339	688403	汇成股份	528	20,961.60	0.07
340	688657	浩辰软件	584	20,889.68	0.07
341	688348	昱能科技	600	20,868.00	0.07
342	688211	中科微至	600	20,652.00	0.06
343	688314	康拓医疗	600	20,328.00	0.06
344	688080	映翰通	470	20,327.50	0.06
345	688709	成都华微	533	20,301.97	0.06
346	688196	卓越新能	559	20,068.10	0.06
347	688600	皖仪科技	600	19,968.00	0.06
348	688283	坤恒顺维	600	19,866.00	0.06
349	688428	诺诚健华	696	19,815.12	0.06
350	688088	虹软科技	557	19,801.35	0.06
351	688558	国盛智科	600	19,716.00	0.06
352	688079	美迪凯	641	19,710.75	0.06
353	688212	澳华内镜	666	19,580.40	0.06
354	688156	路德科技	647	19,571.75	0.06

355	688117	圣诺生物	723	19,542.69	0.06
356	688767	博拓生物	599	19,473.49	0.06
357	688518	联赢激光	622	19,219.80	0.06
358	688435	英方软件	600	19,200.00	0.06
359	688539	高华科技	600	19,128.00	0.06
360	688269	凯立新材	600	19,026.00	0.06
361	688716	中研股份	600	18,858.00	0.06
362	688179	阿拉丁	679	18,815.09	0.06
363	688557	兰剑智能	600	18,618.00	0.06
364	688338	赛科希德	628	18,532.28	0.06
365	688265	南模生物	535	18,505.65	0.06
366	688618	三旺通信	600	18,462.00	0.06
367	688153	唯捷创芯	572	18,372.64	0.06
368	688208	道通科技	727	18,313.13	0.06
369	688100	威胜信息	598	18,292.82	0.06
370	688197	首药控股	545	18,208.45	0.06
371	688500	慧辰股份	400	18,132.00	0.06
372	688612	威迈斯	612	18,109.08	0.06
373	688633	星球石墨	600	17,838.00	0.06
374	688357	建龙微纳	600	17,682.00	0.06
375	688222	成都先导	549	17,628.39	0.06
376	688366	昊海生科	610	17,610.70	0.05
377	688178	万德斯	520	17,581.20	0.05
378	688152	麒麟信安	637	17,504.76	0.05
379	688075	安旭生物	588	17,498.88	0.05
380	688046	药康生物	707	17,109.40	0.05
381	688552	航天南湖	600	16,878.00	0.05
382	688062	迈威生物	595	16,808.75	0.05
383	688475	萤石网络	611	16,710.85	0.05
384	688252	天德钰	696	16,704.00	0.05
385	688255	凯尔达	600	16,680.00	0.05
386	688071	华依科技	456	16,616.64	0.05
387	688367	工大高科	498	16,583.40	0.05
388	688175	高凌信息	655	16,473.25	0.05
389	688311	盟升电子	625	16,368.75	0.05
390	688077	大地熊	616	16,317.84	0.05
391	688566	吉贝尔	628	16,070.52	0.05
392	688678	福立旺	663	16,024.71	0.05
393	688137	近岸蛋白	445	16,020.00	0.05
394	688157	松井股份	600	15,834.00	0.05
395	688321	微芯生物	600	15,798.00	0.05
396	688352	颀中科技	649	15,692.82	0.05
397	688398	赛特新材	600	15,546.00	0.05

398	688139	海尔生物	587	15,508.54	0.05
399	688335	复洁科技	643	15,457.72	0.05
400	688251	井松智能	600	15,378.00	0.05
401	688229	博睿数据	200	15,340.00	0.05
402	688221	前沿生物	674	15,097.60	0.05
403	688129	东来技术	568	14,875.92	0.05
404	688013	天臣医疗	600	14,802.00	0.05
405	688351	微电生理	651	14,751.66	0.05
406	688370	丛麟科技	700	14,644.00	0.05
407	688510	航亚科技	600	14,328.00	0.04
408	688387	信科移动	721	14,304.64	0.04
409	688377	迪威尔	600	14,148.00	0.04
410	688113	联测科技	400	14,040.00	0.04
411	688443	智翔金泰	600	13,950.00	0.04
412	688128	中国电研	587	13,935.38	0.04
413	688162	巨一科技	588	13,900.32	0.04
414	688136	科兴制药	669	13,854.99	0.04
415	688561	奇安信	577	13,836.46	0.04
416	688051	佳华科技	600	13,788.00	0.04
417	688246	嘉和美康	667	13,706.85	0.04
418	688589	力合微	588	13,512.24	0.04
419	688395	正弦电气	600	13,260.00	0.04
420	688193	仁度生物	239	13,216.70	0.04
421	688758	赛分科技	599	13,183.99	0.04
422	688060	云涌科技	400	13,156.00	0.04
423	688651	盛邦安全	400	12,888.00	0.04
424	688334	西高院	708	12,843.12	0.04
425	688232	新点软件	722	12,837.16	0.04
426	688207	格灵深瞳	638	12,823.80	0.04
427	688739	成大生物	657	12,804.93	0.04
428	688092	爱科科技	600	12,744.00	0.04
429	688420	美腾科技	600	12,642.00	0.04
430	688369	致远互联	600	12,606.00	0.04
431	688489	三未信安	554	12,575.80	0.04
432	688819	天能股份	564	12,520.80	0.04
433	688267	中触媒	633	12,470.10	0.04
434	688638	誉辰智能	400	12,468.00	0.04
435	688728	格科微	590	12,413.60	0.04
436	688108	赛诺医疗	657	12,174.21	0.04
437	688329	艾隆科技	600	12,126.00	0.04
438	688118	普元信息	600	12,072.00	0.04
439	688303	大全能源	692	12,061.56	0.04
440	688426	康为世纪	657	12,049.38	0.04

441	688173	希荻微	622	11,905.08	0.04
442	688576	西山科技	298	11,875.30	0.04
443	688360	德马科技	662	11,849.80	0.04
444	688133	泰坦科技	560	11,832.80	0.04
445	688161	威高骨科	557	11,685.86	0.04
446	688533	上声电子	559	11,660.74	0.04
447	688772	珠海冠宇	593	11,640.59	0.04
448	688021	奥福科技	600	11,616.00	0.04
449	688316	青云科技	215	11,610.00	0.04
450	688165	埃夫特	568	11,587.20	0.04
451	688355	明志科技	600	11,550.00	0.04
452	688501	青达环保	600	11,520.00	0.04
453	688737	中自科技	600	11,484.00	0.04
454	688299	长阳科技	685	11,446.35	0.04
455	688277	天智航	668	11,422.80	0.04
456	688298	东方生物	633	11,305.38	0.04
457	688339	亿华通	600	11,220.00	0.04
457	688695	中创股份	600	11,220.00	0.04
458	688292	浩瀚深度	600	11,160.00	0.03
459	688365	光云科技	704	11,102.08	0.03
460	688517	金冠电气	633	11,064.84	0.03
461	688004	博汇科技	600	10,920.00	0.03
462	688101	三达膜	659	10,893.27	0.03
463	688288	鸿泉技术	606	10,768.62	0.03
464	688393	安必平	600	10,668.00	0.03
465	688522	纳睿雷达	528	10,570.56	0.03
466	688455	科捷智能	564	10,524.24	0.03
467	688177	百奥泰	620	10,428.40	0.03
468	688382	益方生物	579	10,422.00	0.03
469	688289	圣湘生物	722	10,396.80	0.03
470	688653	康希通信	597	10,375.86	0.03
471	688058	宝兰德	493	10,313.56	0.03
472	688670	金迪克	600	10,164.00	0.03
473	688038	中科通达	600	10,092.00	0.03
474	688105	诺唯赞	579	10,045.65	0.03
475	688349	三一重能	659	10,003.62	0.03
476	688687	凯因科技	600	9,786.00	0.03
477	688697	纽威数控	720	9,784.80	0.03
478	688639	华恒生物	605	9,764.70	0.03
479	688619	罗普特	600	9,738.00	0.03
480	688620	安凯微	600	9,720.00	0.03
481	688569	铁科轨道	598	9,657.70	0.03
482	688718	唯赛勃	600	9,582.00	0.03

483	688078	龙软科技	452	9,514.60	0.03
484	688030	山石网科	600	9,474.00	0.03
485	688529	豪森智能	600	9,438.00	0.03
486	688015	交控科技	613	9,427.94	0.03
487	688026	洁特生物	600	9,426.00	0.03
488	688410	山外山	652	9,362.72	0.03
489	688512	慧智微	584	9,326.48	0.03
490	688681	科汇股份	663	9,268.74	0.03
491	688310	迈得医疗	600	9,222.00	0.03
492	688317	之江生物	600	9,120.00	0.03
493	688722	同益中	600	9,102.00	0.03
494	688562	航天软件	598	9,005.88	0.03
495	688750	金天钛业	541	8,996.83	0.03
496	688236	春立医疗	617	8,921.82	0.03
497	688067	爱威科技	442	8,906.30	0.03
498	688599	天合光能	623	8,796.76	0.03
499	688186	广大特材	571	8,650.65	0.03
500	688570	天玛智控	606	8,623.38	0.03
501	688151	华强科技	572	8,505.64	0.03
502	688057	金达莱	551	8,490.91	0.03
503	688613	奥精医疗	600	8,466.00	0.03
504	688488	艾迪药业	657	8,442.45	0.03
505	688276	百克生物	600	8,364.00	0.03
506	688658	悦康药业	649	8,346.14	0.03
507	688217	睿昂基因	400	8,264.00	0.03
508	688315	诺禾致源	657	8,219.07	0.03
509	688590	新致软件	641	7,967.63	0.02
510	688244	永信至诚	555	7,914.30	0.02
511	688132	邦彦技术	600	7,890.00	0.02
512	688707	振华新材	613	7,877.05	0.02
513	688096	京源环保	582	7,775.52	0.02
514	688327	云从科技	620	7,725.20	0.02
515	688466	金科环境	600	7,698.00	0.02
516	688526	科前生物	622	7,526.20	0.02
517	688586	江航装备	640	7,481.60	0.02
518	688556	高测股份	555	7,370.40	0.02
519	688567	孚能科技	695	7,297.50	0.02
520	688007	光峰科技	543	7,221.90	0.02
521	688176	亚虹医药	723	7,172.16	0.02
522	688560	明冠新材	600	7,110.00	0.02
523	688219	会通股份	547	7,078.18	0.02
524	688389	普门科技	723	7,078.17	0.02
525	688085	三友医疗	590	7,062.30	0.02

526	688306	均普智能	690	6,969.00	0.02
527	688616	西力科技	688	6,948.80	0.02
528	688296	和达科技	600	6,864.00	0.02
529	688203	海正生材	678	6,766.44	0.02
530	688609	九联科技	610	6,716.10	0.02
531	688225	亚信安全	532	6,607.44	0.02
532	688469	芯联集成	618	6,556.98	0.02
533	688089	嘉必优	600	6,366.00	0.02
534	688553	汇宇制药	591	6,282.33	0.02
535	688472	阿特斯	579	6,264.78	0.02
536	688659	元琛科技	600	6,264.00	0.02
537	688429	时创能源	600	6,114.00	0.02
538	688575	亚辉龙	686	6,009.36	0.02
539	688098	申联生物	685	5,884.15	0.02
540	688588	凌志软件	632	5,744.88	0.02
541	688565	力源科技	600	5,670.00	0.02
542	688660	电气风电	639	5,508.18	0.02
543	688528	秦川物联	600	5,484.00	0.02
544	688579	地纬智能	661	5,016.99	0.02
545	688571	杭华股份	562	4,917.50	0.02
546	688779	五矿新能	605	4,906.55	0.02
547	688148	芳源股份	571	4,899.18	0.02
548	688247	宣泰医药	627	4,715.04	0.01
549	688459	哈铁科技	558	4,648.14	0.01
550	688701	卓锦股份	599	4,510.47	0.01
551	688285	高铁电气	628	4,502.76	0.01
552	688602	康鹏科技	540	4,255.20	0.01
553	688505	复旦张江	569	4,199.22	0.01
554	688468	科美诊断	688	3,914.72	0.01
555	688597	煜邦电力	600	3,900.00	0.01
556	688280	精进电动	699	3,837.51	0.01
557	688055	龙腾光电	619	3,565.44	0.01
558	688238	和元生物	577	3,127.34	0.01
559	688373	盟科药业	689	3,121.17	0.01
560	688119	中钢洛耐	647	3,073.25	0.01
561	688223	晶科能源	633	3,006.75	0.01
562	688009	中国通号	630	2,998.80	0.01
563	688509	正元地信	618	2,645.04	0.01
564	688425	铁建重工	529	2,126.58	0.01
565	688538	和辉光电	652	1,695.20	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	4,536,522.07	1.49
2	688256	寒武纪	3,897,395.19	1.28
3	688802	沐曦股份	2,374,159.04	0.78
4	688795	摩尔线程	2,028,521.65	0.67
5	688981	中芯国际	1,804,132.25	0.59
6	688012	中微公司	1,710,675.62	0.56
7	688008	澜起科技	1,435,326.51	0.47
8	688111	金山办公	1,072,396.15	0.35
9	688521	芯原股份	952,967.85	0.31
10	688506	百利天恒	898,890.79	0.30
11	688271	联影医疗	815,926.04	0.27
12	688072	拓荆科技	810,818.99	0.27
13	688525	佰维存储	783,434.59	0.26
14	688775	影石创新	690,156.00	0.23
15	688082	盛美上海	635,972.90	0.21
16	688223	晶科能源	599,386.98	0.20
17	688396	华润微	586,243.26	0.19
18	688702	盛科通信	581,205.92	0.19
19	688375	国博电子	561,839.54	0.18
20	688183	生益电子	554,056.85	0.18

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	5,141,631.26	1.69
2	688256	寒武纪	4,482,287.77	1.48
3	688802	沐曦股份	2,327,050.02	0.77
4	688795	摩尔线程	1,916,487.25	0.63
5	688981	中芯国际	1,758,793.60	0.58
6	688012	中微公司	1,717,659.14	0.57
7	688008	澜起科技	1,674,608.84	0.55
8	688525	佰维存储	1,072,735.20	0.35
9	688521	芯原股份	979,875.50	0.32
10	688072	拓荆科技	811,450.00	0.27
11	688702	盛科通信	791,902.72	0.26
12	688111	金山办公	750,633.95	0.25
13	688506	百利天恒	711,816.02	0.23
14	688271	联影医疗	669,506.88	0.22
15	688183	生益电子	643,026.11	0.21
16	688223	晶科能源	593,895.00	0.20

17	688396	华润微	556,765.14	0.18
18	688172	燕东微	526,341.83	0.17
19	688126	沪硅产业	526,109.70	0.17
20	688120	华海清科	521,889.72	0.17

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	83,786,784.21
卖出股票收入（成交）总额	70,823,677.59

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

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	356,534.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,534.84

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	550,784.00	1.72	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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（%）

长盛上证 科创板综 合指数增 强 A	274	36,709.66	-	-	10,058,448.01	100.00
长盛上证 科创板综 合指数增 强 C	409	30,862.49	-	-	12,622,759.01	100.00
合计	683	33,208.21	-	-	22,681,207.02	100.00

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，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），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	长盛上证科创板综合指数 增强 A	0.00	0.0000
	长盛上证科创板综合指数 增强 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

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	长盛上证科创板综合指 数增强 A	0
	长盛上证科创板综合指 数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	长盛上证科创板综合指 数增强 A	0
	长盛上证科创板综合指 数增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛上证科创板综合指数增强 A	长盛上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 （2025 年 12 月 22	177,961,014.79	125,910,462.85

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	177,961,014.79	125,910,462.85
本报告期基金总申购份额	8,714,219.04	5,158,116.79
减: 本报告期基金总赎回份额	176,616,785.82	118,445,820.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,058,448.01	12,622,759.01

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议,公司副总经理郭堃同志不再担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”,专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本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,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期内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

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

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，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员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 (%)	
西部证券	2	154,610,461.80	100.00	38,655.77	100.00	-

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 (%)
西部证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式。本基金管理人负责选择证券公司，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券公司的选择标准如下：

- (1) 具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。
- (2) 具有较强的研究服务能力、有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公

募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要。

(4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下 T+0 估值的时效性要求。

2、证券公司的选择程序

(1) 基金管理人根据上述标准考察后确定选用证券公司。

(2) 基金管理人和被选中的证券公司签订协议。

3、本报告期内选择证券公司的变更情况：无。

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	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
2	长盛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、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 26 日
3	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 15 日
5	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
6	长盛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	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
7	关于长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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、长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金相关批准文件；

- 2、《长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日