

长城上证科创板综合指数型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 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 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	63
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	63

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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	66
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	67
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城上证科创板综合指数型证券投资基金	
基金简称	长城上证科创板综合指数	
基金主代码	023934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 28 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	35,408,967.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
下属分级基金的交 易代码	023934	023935
报告期末下属分级 基金的份额总额	23,675,035.29 份	11,733,932.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪上证科创板综合指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。 在条件允许的情况下，本基金也可以适当参与上证科创板综合指数所包含指数成份股以外的其他个股（非标的指数成份股及备选成份股），以更好地跟踪指数。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。 1、股票投资策略 （1）组合复制策略 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 （2）替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股等进行替代。 （3）本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李建军	任航
	联系电话	0755-29279005	010-66060069
	电子邮箱	lijj@ccfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-8868-666	95599
传真		0755-29279000	010-68121816
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路9号广电金融中心36 层DEF单元、38层、39层	北京市东城区建国门内大街69 号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路9号广电金融中心36 层、38层、39层	北京市西城区复兴门内大街28 号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		518046	100031
法定代表人		王军	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层、38 层、39 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
本期已实现收益	19,376,753.92	7,652,863.34
本期利润	30,301,287.98	11,763,005.40
加权平均基金份额本期利润	0.5708	0.5037
本期加权平均净值利润率	50.83%	44.70%
本期基金份额净值增长率	52.26%	52.08%
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	8,089,188.97	3,976,121.32
期末可供分配基金份额利润	0.3417	0.3389
期末基金资产净值	36,142,548.17	17,875,138.50
期末基金份额净值	1.5266	1.5234
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	52.66%	52.34%

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

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

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城上证科创板综合指数 A

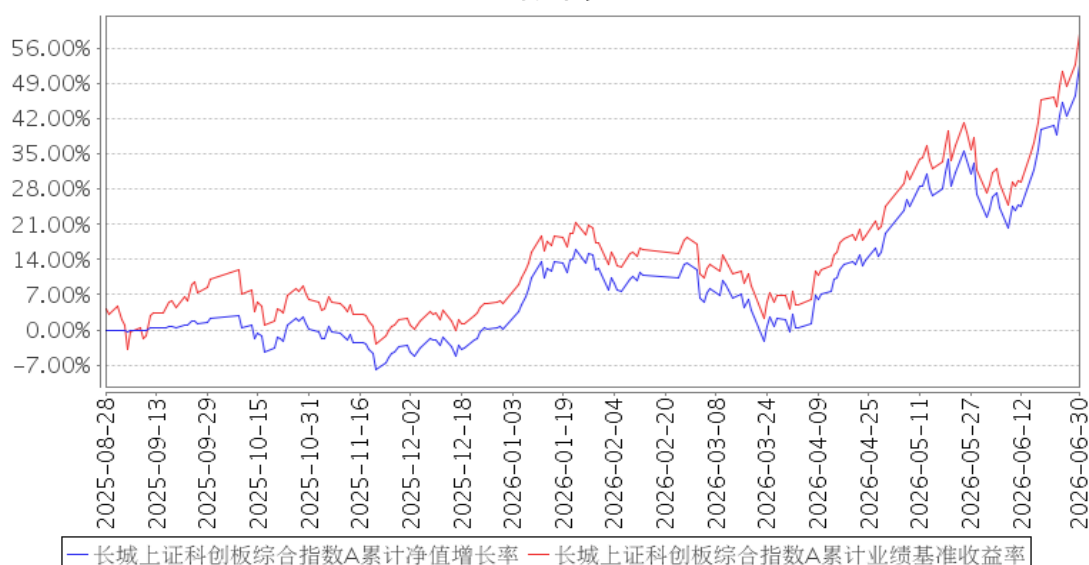
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	53.06%	2.23%	52.44%	2.24%	0.62%	-0.01%
过去六个月	52.26%	2.12%	50.92%	2.11%	1.34%	0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	52.66%	1.79%	58.96%	1.97%	-6.30%	-0.18%

长城上证科创板综合指数 C

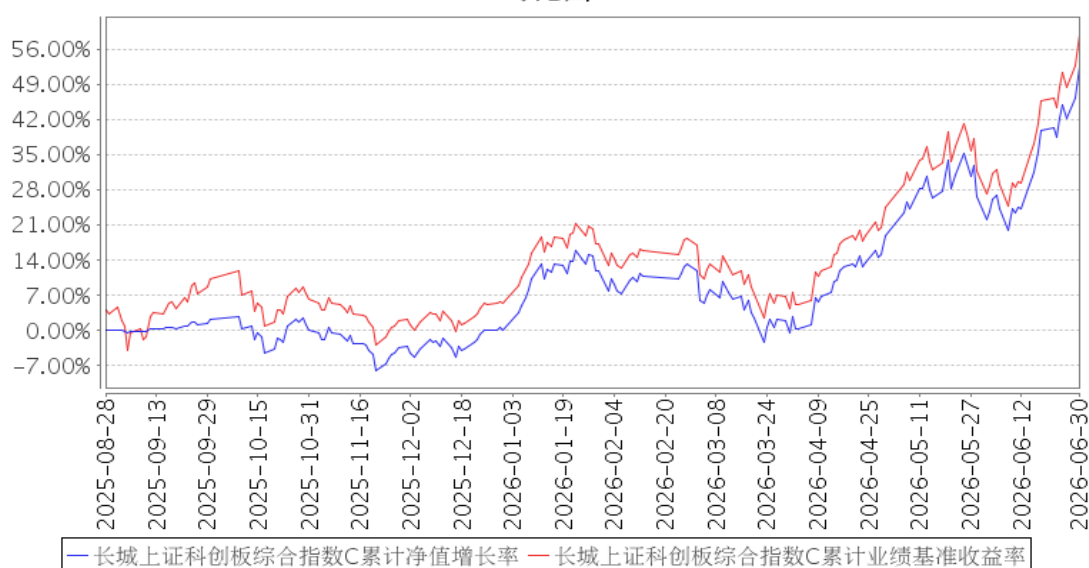
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	52.97%	2.23%	52.44%	2.24%	0.53%	-0.01%
过去六个月	52.08%	2.12%	50.92%	2.11%	1.16%	0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	52.34%	1.79%	58.96%	1.97%	-6.62%	-0.18%

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

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



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



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

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

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

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 128 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陶曙斌	本基金的基金经理	2025 年 8 月 28 日	-	18 年	男，中国籍，硕士。曾就职于德勤会计师事务所（2005 年 7 月-2008 年 4 月）、南方基金管理股份有限公司（2008 年 4 月-2015 年 12 月）、前海开源基金管理有限公司（2016 年 1 月-2020 年 12 月）、光大保德信基金管理有限公司（2021 年 1 月-2024 年 6 月）。2024 年 6 月加入长城基金管理有限公司。自 2025 年 8 月至 2026 年 3 月任“长城国证自由现金流指数型证券投资基金”基金经理。自 2025 年 1 月至今任“长城中证 A500 指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 6 月至今任“长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金”基金经理，自 2025 年 8 月至今任“长城上证科创板综合指数型证券投资基金”基金经理，自 2025 年 12

					月至今任“长城沪深 300 自由现金流指数型证券投资基金”基金经理，自 2026 年 3 月至今任“长城国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金”基金经理，自 2026 年 3 月至今任“长城国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金”（自 2026 年 3 月 17 日由“长城国证自由现金流指数型证券投资基金”变更而来）基金经理，自 2026 年 6 月至今任“长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”“长城中证电池主题指数型发起式证券投资基金”“长城上证科创板芯片设计主题指数型发起式证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，市场延续 9.24 行情以来的预期。整体风格表现分化较大，AI 科技相关资产占优。本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，本基金结合申购赎回情况、标的指数成份股调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪，以期为持有人提供与之相近的收益，并通过参与新股申购、转债套利等方式追求超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城上证科创板综合指数 A 基金份额净值增长率为 52.26%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；长城上证科创板综合指数 C 基金份额净值增长率为 52.08%，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

展望下半年，国内经济复苏企稳，流动性维持合理宽松，市场利率中枢预计中长期处于较低水平。海外美联储货币政策与地缘局势是主要外部扰动因素。A 股市场整体维持结构性行情为主的震荡格局，驱动力从提升估值转向企业盈利增长，资金将持续向业绩确定性强的标的集中。

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，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

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	2,857,897.13	14,078,400.87
结算备付金		2,845.32	50,402.69
存出保证金		74,564.51	167,874.09
交易性金融资产	6.4.7.2	51,851,907.68	260,368,600.22
其中：股票投资		51,023,936.56	254,214,324.38
基金投资		-	-
债券投资		827,971.12	6,154,275.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	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		-	2,148,981.02
应收股利		-	-
应收申购款		112,336.76	8,000.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		54,899,551.40	276,822,259.63
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		0.06	-
应付赎回款		766,082.51	5,634,804.10
应付管理人报酬		20,714.28	121,851.59
应付托管费		4,142.86	24,370.31
应付销售服务费		3,456.88	13,685.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24.91	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	87,443.23	88,672.92
负债合计		881,864.73	5,883,384.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	35,408,967.41	270,299,536.30
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,608,719.26	639,339.14
净资产合计		54,017,686.67	270,938,875.44
负债和净资产总计		54,899,551.40	276,822,259.63

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 35,408,967.41 份，其中长城上证科创板综合指数 A 类基金份额总额 23,675,035.29 份，基金份额净值 1.5266 元；长城上证科创板综合指数 C 类基金份额总额 11,733,932.12 份，基金份额净值 1.5234 元。

6.2 利润表

会计主体：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

本报告期：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		42,435,652.60
1. 利息收入		9,829.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,829.94
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）		27,386,094.20
其中：股票投资收益	6.4.7.14	27,230,000.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	68,423.58
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	87,670.00
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	15,034,676.12
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	5, 052. 34
减：二、营业总支出		371, 359. 22
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	219, 391. 90
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	43, 878. 43
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	33, 248. 17
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		5. 37
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	74, 835. 35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42, 064, 293. 38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42, 064, 293. 38
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		42, 064, 293. 38

6.3 净资产变动表

会计主体：长城上证科创板综合指数型证券投资基金

本报告期：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	270, 299, 536. 30	-	639, 339. 14	270, 938, 875. 44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	270, 299, 536. 30	-	639, 339. 14	270, 938, 875. 44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 234, 890, 568. 89	-	17, 969, 380. 12	-216, 921, 188. 77
(一)、综合收益总额	-	-	42, 064, 293. 38	42, 064, 293. 38

（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）	- 234,890,568.89	-	-24,094,913.26	-258,985,482.15
其中：1. 基金申购款	21,357,977.07	-	3,511,792.04	24,869,769.11
2. 基金赎回款	- 256,248,545.96	-	-27,606,705.30	-283,855,251.26
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	35,408,967.41	-	18,608,719.26	54,017,686.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>祝函</u>	<u>刘沛</u>	<u>李志朋</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城上证科创板综合指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]573 号《关于准予长城上证科创板综合指数型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 564,046,531.52 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70015735_H07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 8 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 564,131,282.18 份，其中认购资金利息折合 84,750.66

份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括上证科创板综合指数的成份股(含存托凭证)及备选成份股(含存托凭证)、其他股票(含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(含国债、央行票据、金融债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、同业存单、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

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

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

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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《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《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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《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	2,857,897.13
等于：本金	2,857,620.17
加：应计利息	276.96
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,857,897.13

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		33,275,323.67	-	51,023,936.56	17,748,612.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	820,656.00	4,470.12	827,971.12	2,845.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	820,656.00	4,470.12	827,971.12	2,845.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		34,095,979.67	4,470.12	51,851,907.68	17,751,457.89

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

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

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：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	13,059.47

其中：交易所市场	13,059.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	59,507.37
合计	87,443.23

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城上证科创板综合指数 A

项目	本期	
	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	208,064,404.08	208,064,404.08
本期申购	8,720,743.46	8,720,743.46
本期赎回（以“-”号填列）	-193,110,112.25	-193,110,112.25
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	23,675,035.29	23,675,035.29

长城上证科创板综合指数 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	62,235,132.22	62,235,132.22
本期申购	12,637,233.61	12,637,233.61
本期赎回（以“-”号填列）	-63,138,433.71	-63,138,433.71
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	11,733,932.12	11,733,932.12

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城上证科创板综合指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,528,146.29	-992,937.59	535,208.70
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,528,146.29	-992,937.59	535,208.70
本期利润	19,376,753.92	10,924,534.06	30,301,287.98
本期基金份额交易产生的变动数	-12,815,711.24	-5,553,272.56	-18,368,983.80
其中：基金申购款	1,355,543.58	121,140.52	1,476,684.10
基金赎回款	-14,171,254.82	-5,674,413.08	-19,845,667.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,089,188.97	4,378,323.91	12,467,512.88

长城上证科创板综合指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	401,565.78	-297,435.34	104,130.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	401,565.78	-297,435.34	104,130.44
本期利润	7,652,863.34	4,110,142.06	11,763,005.40
本期基金份额交易产生的变动数	-4,078,307.80	-1,647,621.66	-5,725,929.46
其中：基金申购款	1,817,010.35	218,097.59	2,035,107.94
基金赎回款	-5,895,318.15	-1,865,719.25	-7,761,037.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,976,121.32	2,165,085.06	6,141,206.38

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	9,462.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	64.23
其他	302.81
合计	9,829.94

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	27,230,000.62
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	27,230,000.62

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	263,101,511.42
减：卖出股票成本总额	235,667,095.57
减：交易费用	204,415.23
买卖股票差价收入	27,230,000.62

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,023.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	55,400.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	68,423.58

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,712,622.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,557,896.06
减：应计利息总额	99,320.80
减：交易费用	5.67
买卖债券差价收入	55,400.09

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：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	87,670.00
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	87,670.00

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	15,034,676.12
股票投资	15,058,683.96
债券投资	-24,007.84
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	15,034,676.12

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	5,052.34
合计	5,052.34

6.4.7.22 信用减值损失

注：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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	425.00
存托服务费	26.59
合计	74,835.35

6.4.7.24 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。

6.4.8 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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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	219,391.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	108,520.64
应支付基金管理人的净管理费	110,871.26

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

$H=E\times\text{管理费费率}\div\text{当年天数}$

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

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	43,878.43

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

$H=E\times\text{托管费费率}\div\text{当年天数}$

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

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		
	长城上证科创板综合 指数 A	长城上证科创板综合 指数 C	合计
	长城基金管理有限公司	-	15.64

中国农业银行	-	26,686.70	26,686.70
合计	-	26,702.34	26,702.34

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

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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	2,857,897.13	9,462.90

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

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

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	165	1,844.70	2,902.35	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	23	871.24	802.01	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	15	502.35	508.95	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	101	2,209.88	2,577.52	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	53	734.58	3,893.38	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	36	567.36	1,681.56	-
603459	红	2026	6 个月	新	17.70	84.32	53	938.10	4,468.96	-

	板科技	年 3 月 31 日		股锁定						
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	30	1,229.40	9,245.70	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	78	1,366.56	2,801.76	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	792	17,962.56	33,390.72	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	49	4,516.82	22,694.35	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	1,083	123,765.24	733,126.02	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	799	83,623.34	614,343.11	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	19	1,555.72	30,102.27	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	64	1,681.92	11,013.76	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	48	2,685.60	2,740.80	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	344	3,257.68	24,128.16	-
688820	盛	2026	6 个月	新	19.68	141.49	113	2,223.84	15,988.37	-

	合晶微	年 4 月 13 日		股锁定						
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118069	爱科转债	2026 年 6 月 11 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.09	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 18 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	60	6,000.00	6,000.34	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 23 日	1-6 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.04	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1-6 个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.09	-

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	909	209,614.29	799,492.77	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	478	15,206.86	68,832.00	-

688121	卓然股份	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	1,317	16,872.63	8,534.16	-
--------	------	----------------	--------	------	----------------	------	-------	-----------	----------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,857,897.13	-	-	-	-	-	2,857,897.13
结算备付金	2,845.32	-	-	-	-	-	2,845.32
存出保证金	74,564.51	-	-	-	-	-	74,564.51
交易性金融资产	-	-	805,185.53	-	22,785.59	51,023,936.56	51,851,907.68
应收申购款	-	-	-	-	-	112,336.76	112,336.76
资产总计	2,935,306.96	-	805,185.53	-	22,785.59	51,136,273.32	54,899,551.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	766,082.51	766,082.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,714.28	20,714.28
应付托管费	-	-	-	-	-	4,142.86	4,142.86
应付清算款	-	-	-	-	-	0.06	0.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,456.88	3,456.88
应交税费	-	-	-	-	-	24.91	24.91
其他负债	-	-	-	-	-	87,443.23	87,443.23
负债总计	-	-	-	-	-	881,864.73	881,864.73
利率敏感度缺口	2,935,306.96	-	805,185.53	-	22,785.59		
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	14,078,400.87	-	-	-	-	-	14,078,400.87
结算备付金	50,402.69	-	-	-	-	-	50,402.69
存出保证金	167,874.09	-	-	-	-	-	167,874.09
交易性金融资产	-	-	-6,060,578.63	-	93,697.21	254,214,324.38	260,368,600.22
应收申购款	-	-	-	-	-	8,000.74	8,000.74
应收清算款	-	-	-	-	-	2,148,981.02	2,148,981.02
资产总计	14,296,677.65	-	-6,060,578.63	-	93,697.21	256,371,306.14	276,822,259.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,634,804.	5,634,804.10

						10	
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	121,851.59	121,851.59
应付托管费	-	-	-	-	-	24,370.31	24,370.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,685.27	13,685.27
其他负债	-	-	-	-	-	88,672.92	88,672.92
负债总计	-	-	-	-	-	5,883,384.19	5,883,384.19
利率敏感度缺口	14,296,677.65	-6,060,578.63	-	93,697.21			

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,092.54	4,344.95
	市场利率上升 25 个基点	-1,089.58	-4,338.73

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。

本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	51,023,936.56	94.46	254,214,324.38	93.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	827,971.12	1.53	6,154,275.84	2.27
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	51,851,907.68	95.99	260,368,600.22	96.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,749,749.10	19,968,535.18
	沪深 300 指数下降 5%	-3,749,749.10	-19,968,535.18

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

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	48,641,452.91	248,034,719.48
第二层次	1,694,045.02	11,399,111.90
第三层次	1,516,409.75	934,768.84
合计	51,851,907.68	260,368,600.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

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

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	51,023,936.56	92.94
	其中：股票	51,023,936.56	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	827,971.12	1.51
	其中：债券	827,971.12	1.51
	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	2,860,742.45	5.21
8	其他各项资产	186,901.27	0.34
9	合计	54,899,551.40	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	40,754,243.86	75.45
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	8,991,098.43	16.64
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	710,911.86	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	150,128.25	0.28
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	50,606,382.40	93.68

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	387,906.76	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	29,647.40	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	417,554.16	0.77

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪	2,199	3,508,614.45	6.50
2	688041	海光信息	7,808	2,891,302.40	5.35
3	688012	中微公司	2,974	1,393,319.00	2.58
4	688008	澜起科技	3,824	1,185,057.60	2.19
5	688802	沐曦股份	1,374	1,090,615.61	2.02
6	688981	中芯国际	6,735	1,069,652.70	1.98
7	688795	摩尔线程	1,519	1,045,515.66	1.94
8	688525	佰维存储	1,671	826,693.83	1.53
9	688072	拓荆科技	909	799,492.77	1.48
10	688498	源杰科技	405	763,830.00	1.41
11	688082	盛美上海	1,637	707,184.00	1.31
12	688521	芯原股份	1,804	669,536.56	1.24
13	688146	中船特气	1,695	593,233.05	1.10
14	688702	盛科通信	1,443	562,755.57	1.04
15	688120	华海清科	1,553	500,345.54	0.93
16	688361	中科飞测	1,025	440,750.00	0.82
17	688396	华润微	4,428	431,951.40	0.80
18	688506	百利天恒	1,458	428,695.74	0.79
19	688347	华虹宏力	1,266	425,755.80	0.79
20	688126	沪硅产业	10,378	413,978.42	0.77
21	688172	燕东微	4,918	411,439.88	0.76
22	688249	晶合集成	6,758	398,924.74	0.74
23	688183	生益电子	2,728	361,187.20	0.67
24	688111	金山办公	1,650	351,532.50	0.65
25	688200	华峰测控	652	342,365.20	0.63
26	688766	普冉股份	429	328,871.40	0.61
27	688110	东芯股份	1,532	312,068.40	0.58
28	688629	华丰科技	1,639	307,328.89	0.57
29	688777	中控技术	2,557	300,447.50	0.56
30	688469	芯联集成	27,594	292,772.34	0.54
31	688409	富创精密	954	292,162.50	0.54
32	688313	仕佳光子	1,545	285,284.25	0.53
33	688519	南亚新材	743	282,369.72	0.52
34	688271	联影医疗	2,698	273,118.54	0.51
35	688017	绿的谐波	636	265,758.96	0.49
36	688234	天岳先进	1,490	258,529.90	0.48
37	688147	微导纳米	1,583	256,256.04	0.47
38	688048	长光华芯	510	256,020.00	0.47

39	688002	睿创微纳	1,635	252,918.15	0.47
40	688019	安集科技	737	250,182.02	0.46
41	688037	芯源微	556	244,111.80	0.45
42	688627	精智达	339	242,385.00	0.45
43	688548	广钢气体	4,394	228,927.40	0.42
44	688141	杰华特	1,445	221,807.50	0.41
45	688036	传音控股	3,688	217,407.60	0.40
46	688585	上纬新材	1,297	215,042.60	0.40
47	688387	信科移动	10,382	205,978.88	0.38
48	688375	国博电子	1,922	200,464.60	0.37
49	688187	时代电气	2,887	198,221.42	0.37
50	688411	海博思创	680	198,016.00	0.37
51	688047	龙芯中科	1,269	196,276.23	0.36
52	688630	芯碁微装	353	193,934.67	0.36
53	688300	联瑞新材	785	191,854.00	0.36
54	688775	影石创新	1,382	191,614.30	0.35
55	688549	中巨芯	5,040	185,522.40	0.34
56	688728	格科微	8,806	185,278.24	0.34
57	688027	国盾量子	354	178,419.54	0.33
58	688432	有研硅	4,288	171,391.36	0.32
59	688220	翱捷科技	1,376	171,064.32	0.32
60	688295	中复神鹰	2,817	170,541.18	0.32
61	688322	奥比中光	1,298	169,453.90	0.31
62	688545	兴福电子	1,262	167,921.72	0.31
63	688223	晶科能源	34,769	165,152.75	0.31
64	688331	荣昌生物	1,234	160,740.84	0.30
65	688336	三生国健	3,012	159,937.20	0.30
66	688578	艾力斯	1,443	157,575.60	0.29
67	688188	柏楚电子	1,476	157,489.20	0.29
68	688368	晶丰明源	715	154,811.80	0.29
69	688668	鼎通科技	398	148,573.40	0.28
70	688362	甬矽电子	1,540	148,456.00	0.27
71	688099	晶晨股份	1,388	142,825.20	0.26
72	688001	华兴源创	1,655	141,833.50	0.26
73	688536	思瑞浦	388	141,266.92	0.26
74	688213	思特威	1,302	139,405.14	0.26
75	688676	金盘科技	1,631	138,047.84	0.26
76	688009	中国通号	28,664	136,440.64	0.25
77	688122	西部超导	2,158	135,543.98	0.25
78	688403	汇成股份	3,413	135,496.10	0.25
79	688502	茂莱光学	194	134,558.40	0.25
80	688385	复旦微电	1,856	132,314.24	0.24
81	688472	阿特斯	12,143	131,387.26	0.24

82	688268	华特气体	490	131,075.00	0.24
83	688167	炬光科技	367	129,995.07	0.24
84	688127	蓝特光学	1,320	128,832.00	0.24
85	688449	联芸科技	1,483	127,997.73	0.24
86	688025	杰普特	266	125,020.00	0.23
87	688303	大全能源	7,114	123,997.02	0.23
88	688233	神工股份	576	123,505.92	0.23
89	688248	南网科技	1,784	123,417.12	0.23
90	688257	新锐股份	1,185	120,751.50	0.22
91	688052	纳芯微	417	120,225.27	0.22
92	688065	凯赛生物	2,461	117,758.85	0.22
93	688538	和辉光电	45,051	117,132.60	0.22
94	688235	百济神州	458	116,611.38	0.22
95	688301	奕瑞科技	938	116,312.00	0.22
96	688433	华曙高科	1,357	116,159.20	0.22
97	688652	京仪装备	562	112,495.54	0.21
98	688599	天合光能	7,876	111,209.12	0.21
99	688102	斯瑞新材	2,338	110,306.84	0.20
100	688692	达梦数据	448	109,441.92	0.20
101	688568	中科星图	2,630	109,066.10	0.20
102	688400	凌云光	1,637	108,369.40	0.20
103	688195	腾景科技	557	107,267.06	0.20
104	688266	泽璟制药	919	107,210.54	0.20
105	688123	聚辰股份	504	107,150.40	0.20
106	688205	德科立	507	105,552.33	0.20
107	688503	聚和材料	788	104,567.60	0.19
108	688617	惠泰医疗	572	103,852.32	0.19
109	688343	云天励飞	1,254	102,401.64	0.19
110	688388	嘉元科技	2,324	102,256.00	0.19
111	688372	伟测科技	544	101,184.00	0.19
112	688018	乐鑫科技	777	99,393.84	0.18
113	688333	铂力特	969	99,225.60	0.18
114	688531	日联科技	538	95,677.92	0.18
115	688608	恒玄科技	565	94,462.35	0.17
116	688297	中无人机	2,258	93,819.90	0.17
117	688308	欧科亿	509	92,541.29	0.17
118	688778	厦钨新能	1,690	91,936.00	0.17
119	688352	顾中科技	3,754	90,771.72	0.17
120	688097	博众精工	1,424	89,783.20	0.17
121	688180	君实生物	2,650	89,623.00	0.17
122	688150	莱特光电	1,306	89,617.72	0.17
123	688757	胜科纳米	1,306	87,110.20	0.16
124	688318	财富趋势	1,215	86,641.65	0.16

125	689009	九号公司	2,248	85,761.20	0.16
126	688390	固德威	790	85,722.90	0.16
127	688380	中微半导	1,293	85,221.63	0.16
128	688800	瑞可达	886	85,029.42	0.16
129	688582	芯动联科	1,301	84,565.00	0.16
130	688169	石头科技	885	84,048.45	0.16
131	688686	奥普特	499	84,026.61	0.16
132	688332	中科蓝讯	528	83,160.00	0.15
133	688507	索辰科技	308	83,061.44	0.15
134	688484	南芯科技	1,458	82,362.42	0.15
135	688615	合合信息	725	81,997.50	0.15
136	688700	东威科技	907	81,085.80	0.15
137	688625	呈和科技	953	80,442.73	0.15
138	688709	成都华微	2,097	79,874.73	0.15
139	688535	华海诚科	416	77,792.00	0.14
140	688279	峰昭科技	336	75,411.84	0.14
141	688475	萤石网络	2,738	74,884.30	0.14
142	688005	容百科技	2,435	74,511.00	0.14
143	688661	和林微纳	468	74,402.64	0.14
144	688563	航材股份	1,449	74,232.27	0.14
145	688819	天能股份	3,333	73,992.60	0.14
146	688059	华锐精密	366	73,093.86	0.14
147	688383	新益昌	388	72,959.52	0.14
148	688349	三一重能	4,794	72,772.92	0.13
149	688278	特宝生物	1,328	72,243.20	0.13
150	688028	沃尔德	462	72,011.94	0.13
151	688425	铁建重工	17,823	71,648.46	0.13
152	688359	三孚新科	361	71,636.84	0.13
153	688006	杭可科技	1,956	71,491.80	0.13
154	688772	珠海冠宇	3,569	70,059.47	0.13
155	688114	华大智造	1,368	69,877.44	0.13
156	688726	拉普拉斯	1,322	69,867.70	0.13
157	688523	航天环宇	1,325	69,430.00	0.13
158	688260	昀冢科技	478	68,832.00	0.13
159	688584	上海合晶	1,905	68,484.75	0.13
160	688559	海目星	816	68,478.72	0.13
161	688401	路维光电	711	68,241.78	0.13
162	688106	金宏气体	1,645	68,234.60	0.13
163	688020	方邦股份	272	67,891.20	0.13
164	688281	华秦科技	1,343	67,458.89	0.12
165	688275	万润新能	523	66,708.65	0.12
166	688662	富信科技	395	66,360.00	0.12
167	688708	佳驰科技	1,292	65,633.60	0.12

168	688596	正帆科技	830	65,619.80	0.12
169	688192	迪哲医药	1,642	65,565.06	0.12
170	688003	天准科技	515	65,559.50	0.12
171	688603	天承科技	312	64,880.40	0.12
172	688515	裕太微	260	64,677.60	0.12
173	688593	新相微	1,639	63,789.88	0.12
174	688055	龙腾光电	10,823	62,340.48	0.12
175	688143	长盈通	341	59,975.08	0.11
176	688206	概伦电子	1,351	59,943.87	0.11
177	688392	骄成超声	263	59,748.34	0.11
178	688353	华盛锂电	511	59,311.77	0.11
179	688158	优刻得	1,609	59,146.84	0.11
180	688258	卓易信息	496	58,795.84	0.11
181	688107	安路科技	1,285	58,596.00	0.11
182	688131	XD 皓元医	616	58,273.60	0.11
183	688319	欧林生物	1,315	57,833.70	0.11
184	688690	纳微科技	1,311	57,815.10	0.11
185	688520	神州细胞	1,689	57,780.69	0.11
186	688605	先锋精科	555	57,731.10	0.11
187	688516	奥特维	1,004	57,619.56	0.11
188	688031	星环科技	493	56,783.74	0.11
189	688691	灿芯股份	489	56,689.77	0.10
190	688208	道通科技	2,250	56,677.50	0.10
191	688182	灿勤科技	1,298	55,904.86	0.10
192	688363	XD 华熙生	1,559	55,765.43	0.10
193	688456	有研粉材	395	55,142.00	0.10
194	688561	奇安信	2,292	54,962.16	0.10
195	688779	五矿新能	6,631	53,777.41	0.10
196	688798	艾为电子	722	52,937.04	0.10
197	688337	普源精电	706	52,900.58	0.10
198	688261	东微半导	501	52,569.93	0.10
199	688125	安达智能	320	52,320.00	0.10
200	688378	奥来德	822	50,964.00	0.09
201	688416	恒烁股份	363	50,820.00	0.09
202	688530	欧莱新材	515	49,903.50	0.09
203	688116	天奈科技	1,302	49,736.40	0.09
204	688100	威胜信息	1,623	49,647.57	0.09
205	688677	海泰新光	484	48,946.92	0.09
206	688166	博瑞医药	1,395	48,838.95	0.09
207	688262	国芯科技	1,120	48,417.60	0.09
208	688029	南微医学	672	48,249.60	0.09
209	688090	瑞松科技	453	48,221.85	0.09
210	688153	唯捷创芯	1,494	47,987.28	0.09

211	688371	菲沃泰	1,202	46,865.98	0.09
212	688138	清溢光电	997	46,859.00	0.09
213	688088	虹软科技	1,302	46,286.10	0.09
214	688227	品高股份	446	45,799.74	0.08
215	688327	云从科技	3,601	44,868.46	0.08
216	688209	英集芯	1,537	44,695.96	0.08
217	688016	心脉医疗	504	44,674.56	0.08
218	688610	埃科光电	168	44,251.20	0.08
219	688190	云路股份	487	44,175.77	0.08
220	688381	帝奥微	825	44,137.50	0.08
221	688567	孚能科技	4,177	43,858.50	0.08
222	688376	美埃科技	376	43,728.80	0.08
223	688628	优利德	441	43,632.54	0.08
224	688698	伟创电气	825	43,271.25	0.08
225	688720	艾森股份	427	43,127.00	0.08
226	688032	禾迈股份	510	43,105.20	0.08
227	688063	派能科技	807	42,988.89	0.08
228	688717	艾罗能源	519	42,853.83	0.08
229	688155	先惠技术	526	42,548.14	0.08
230	688306	均普智能	4,175	42,167.50	0.08
231	688239	航宇科技	693	41,462.19	0.08
232	688222	成都先导	1,283	41,197.13	0.08
233	688612	威迈斯	1,380	40,834.20	0.08
234	688079	美迪凯	1,327	40,805.25	0.08
235	688321	微芯生物	1,537	40,469.21	0.07
236	688191	智洋创新	1,103	39,377.10	0.07
237	688598	金博股份	795	39,312.75	0.07
238	688660	电气风电	4,544	39,169.28	0.07
239	688231	隆达股份	1,057	38,823.61	0.07
240	688325	赛微微电	295	38,470.95	0.07
241	688035	德邦科技	416	38,188.80	0.07
242	688351	微电生理	1,681	38,091.46	0.07
243	688230	芯导科技	478	37,671.18	0.07
244	688112	鼎阳科技	510	37,464.60	0.07
245	688486	龙迅股份	587	37,321.46	0.07
246	688711	宏微科技	819	37,223.55	0.07
247	688135	利扬芯片	879	36,988.32	0.07
248	688083	中望软件	569	36,842.75	0.07
249	688382	益方生物	2,042	36,756.00	0.07
250	688312	燕麦科技	433	36,367.67	0.07
251	688165	埃夫特	1,782	36,352.80	0.07
252	688062	迈威生物	1,282	36,216.50	0.07
253	688556	高测股份	2,725	36,188.00	0.07

254	688663	新风光	408	36,091.68	0.07
255	688179	阿拉丁	1,298	35,967.58	0.07
256	688719	爱科赛博	463	35,651.00	0.07
257	688419	耐科装备	453	35,628.45	0.07
258	688518	联赢激光	1,145	35,380.50	0.07
259	688699	明微电子	429	35,156.55	0.07
260	688478	晶升股份	396	35,065.80	0.06
261	688170	德龙激光	364	34,947.64	0.06
262	688583	思看科技	407	34,908.39	0.06
263	688326	经纬恒润	490	34,731.20	0.06
264	688198	佰仁医疗	389	34,714.36	0.06
265	688307	中润光学	434	34,698.30	0.06
266	688689	银河微电	533	34,495.76	0.06
267	688160	步科股份	317	34,480.09	0.06
268	688439	振华风光	742	34,280.40	0.06
269	688550	瑞联新材	590	34,131.50	0.06
270	688678	福立旺	1,409	34,055.53	0.06
271	688418	震有科技	708	34,040.64	0.06
272	688323	瑞华泰	602	34,013.00	0.06
273	688611	杭州柯林	475	33,938.75	0.06
274	688789	宏华数科	628	33,390.76	0.06
275	688386	泛亚微透	368	33,061.12	0.06
276	688508	芯朋微	354	32,907.84	0.06
277	688046	药康生物	1,336	32,331.20	0.06
278	688328	深科达	337	32,250.90	0.06
279	688552	航天南湖	1,134	31,899.42	0.06
280	688252	天德钰	1,328	31,872.00	0.06
281	688669	聚石化学	297	31,779.00	0.06
282	688091	上海谊众	790	31,758.00	0.06
283	688788	科思科技	697	31,351.06	0.06
284	688128	中国电研	1,318	31,289.32	0.06
285	688733	壹石通	745	30,805.75	0.06
286	688480	赛恩斯	348	30,481.32	0.06
287	688443	智翔金泰	1,304	30,318.00	0.06
288	688221	前沿生物	1,348	30,195.20	0.06
289	688787	海天瑞声	224	30,116.80	0.06
290	688202	美迪西	372	30,024.12	0.06
291	688758	赛分科技	1,360	29,933.60	0.06
292	688485	九州一轨	467	29,916.02	0.06
293	688499	利元亨	568	29,848.40	0.06
294	688105	诺唯赞	1,715	29,755.25	0.06
295	688586	江航装备	2,541	29,704.29	0.05
296	688543	国科军工	752	29,666.40	0.05

297	688093	世华科技	800	29,520.00	0.05
298	688226	威腾电气	684	29,295.72	0.05
299	688068	热景生物	330	28,578.00	0.05
300	688379	华光新材	340	28,570.20	0.05
301	688697	纽威数控	2,091	28,416.69	0.05
302	688577	浙海德曼	615	28,185.45	0.05
303	688049	炬芯科技	600	28,146.00	0.05
304	688522	纳睿雷达	1,378	27,587.56	0.05
305	688710	益诺思	410	27,552.00	0.05
306	688277	天智航	1,600	27,360.00	0.05
307	688750	金天钛业	1,634	27,173.42	0.05
308	688139	海尔生物	1,026	27,106.92	0.05
309	688161	威高骨科	1,284	26,938.32	0.05
310	688513	苑东生物	611	26,859.56	0.05
311	688289	圣湘生物	1,863	26,827.20	0.05
312	688739	成大生物	1,371	26,720.79	0.05
313	688428	诺诚健华	938	26,704.86	0.05
314	688591	泰凌微	770	26,472.60	0.05
315	688173	希荻微	1,363	26,087.82	0.05
316	688286	敏芯股份	226	26,005.82	0.05
317	688290	景业智能	389	25,814.04	0.05
318	688479	友车科技	679	25,781.63	0.05
319	688218	江苏北人	469	25,776.24	0.05
320	688050	爱博医疗	704	25,660.80	0.05
321	688103	国力电子	343	25,522.63	0.05
322	688551	科威尔	361	25,367.47	0.05
323	688512	慧智微	1,588	25,360.36	0.05
324	688776	国光电气	413	25,333.42	0.05
325	688108	赛诺医疗	1,367	25,330.51	0.05
326	688667	菱电电控	189	25,259.85	0.05
327	688665	四方光电	382	25,097.40	0.05
328	688631	莱斯信息	535	25,096.85	0.05
329	688653	康希通信	1,442	25,061.96	0.05
330	688010	福光股份	514	24,995.82	0.05
331	688786	悦安新材	538	24,791.04	0.05
332	688799	华纳药厂	550	24,678.50	0.05
333	688219	会通股份	1,896	24,534.24	0.05
334	688685	迈信林	445	24,430.50	0.05
335	688621	阳光诺和	439	24,105.49	0.04
336	688365	光云科技	1,521	23,986.17	0.04
337	688087	英科再生	717	23,962.14	0.04
338	688305	科德数控	361	23,562.47	0.04
339	688253	英诺特	390	23,509.20	0.04

340	688069	德林海	622	23,237.92	0.04
341	688168	安博通	337	23,168.75	0.04
342	688185	康希诺	452	23,047.48	0.04
343	688553	汇宇制药	2,165	23,013.95	0.04
344	688011	新光光电	329	22,987.23	0.04
345	688181	八亿时空	367	22,974.20	0.04
346	688693	锆威特	220	22,869.00	0.04
347	688177	百奥泰	1,353	22,757.46	0.04
348	688626	翔宇医疗	513	22,705.38	0.04
349	688061	灿瑞科技	453	22,500.51	0.04
350	688345	博力威	380	22,070.40	0.04
351	688601	力芯微	361	21,858.55	0.04
352	688707	振华新材	1,701	21,857.85	0.04
353	688636	智明达	595	21,556.85	0.04
354	688721	龙图光罩	368	21,483.84	0.04
355	688570	天玛智控	1,508	21,458.84	0.04
356	688007	光峰科技	1,613	21,452.90	0.04
357	688210	统联精密	529	21,429.79	0.04
358	688623	双元科技	212	21,297.52	0.04
359	688408	中信博	659	21,186.85	0.04
360	688510	航亚科技	879	20,990.52	0.04
361	688539	高华科技	658	20,977.04	0.04
362	688291	金橙子	353	20,643.44	0.04
363	688620	安凯微	1,263	20,460.60	0.04
364	688450	光格科技	305	20,431.95	0.04
365	688366	昊海生科	704	20,324.48	0.04
366	688163	赛伦生物	414	20,207.34	0.04
367	688526	科前生物	1,661	20,098.10	0.04
368	688356	键凯科技	258	19,886.64	0.04
369	688176	亚虹医药	1,997	19,810.24	0.04
370	688320	禾川科技	474	19,647.30	0.04
371	688655	迅捷兴	365	19,549.40	0.04
372	688117	圣诺生物	713	19,272.39	0.04
373	688109	品茗科技	254	19,227.80	0.04
374	688562	航天软件	1,274	19,186.44	0.04
375	688566	吉贝尔	748	19,141.32	0.04
376	688095	福昕软件	321	19,077.03	0.04
377	688276	百克生物	1,356	18,902.64	0.03
378	688633	星球石墨	629	18,700.17	0.03
379	688595	芯海科技	426	18,684.36	0.03
380	688683	莱尔科技	492	18,656.64	0.03
381	688458	美芯晟	446	18,624.96	0.03
382	688658	悦康药业	1,441	18,531.26	0.03

383	688334	西高院	1,020	18,502.80	0.03
384	688580	伟思医疗	346	18,431.42	0.03
385	688609	九联科技	1,672	18,408.72	0.03
386	688232	新点软件	1,029	18,295.62	0.03
387	688101	三达膜	1,105	18,265.65	0.03
388	688505	复旦张江	2,424	17,889.12	0.03
389	688282	理工导航	306	17,809.20	0.03
390	688488	艾迪药业	1,383	17,771.55	0.03
391	688119	中钢洛耐	3,735	17,741.25	0.03
392	688199	久日新材	513	17,713.89	0.03
393	688575	亚辉龙	2,009	17,598.84	0.03
394	688315	诺禾致源	1,403	17,551.53	0.03
395	688299	长阳科技	1,050	17,545.50	0.03
396	688259	创耀科技	447	17,486.64	0.03
397	688207	格灵深瞳	867	17,426.70	0.03
398	688073	毕得医药	323	17,383.86	0.03
399	688151	华强科技	1,162	17,278.94	0.03
400	688216	气派科技	411	17,266.11	0.03
401	688448	磁谷科技	270	17,161.20	0.03
402	688348	昱能科技	493	17,146.54	0.03
403	688283	坤恒顺维	503	16,654.33	0.03
404	688293	奥浦迈	396	16,509.24	0.03
405	688391	钜泉科技	458	16,428.46	0.03
406	688377	迪威尔	690	16,270.20	0.03
407	688360	德马科技	905	16,199.50	0.03
408	688039	当虹科技	433	16,159.56	0.03
409	688225	亚信安全	1,282	15,922.44	0.03
410	688267	中触媒	802	15,799.40	0.03
411	688237	超卓航科	295	15,758.90	0.03
412	688716	中研股份	498	15,652.14	0.03
413	688075	安旭生物	524	15,594.24	0.03
414	688309	恒誉环保	255	15,524.40	0.03
415	688136	科兴制药	747	15,470.37	0.03
416	688607	康众医疗	303	15,453.00	0.03
417	688045	必易微	189	15,267.42	0.03
418	688768	容知日新	293	15,101.22	0.03
419	688236	春立医疗	1,044	15,096.24	0.03
420	688057	金达莱	976	15,040.16	0.03
421	688197	首药控股	448	14,967.68	0.03
422	688767	博拓生物	460	14,954.60	0.03
423	688679	通源环境	355	14,941.95	0.03
424	688186	广大特材	983	14,892.45	0.03
425	688085	三友医疗	1,243	14,878.71	0.03

426	688311	盟升电子	565	14,797.35	0.03
427	688273	麦澜德	380	14,721.20	0.03
428	688410	山外山	1,022	14,675.92	0.03
429	688682	霍莱沃	377	14,665.30	0.03
430	688398	赛特新材	564	14,613.24	0.03
431	688081	兴图新科	357	14,594.16	0.03
432	688350	富淼科技	422	14,571.66	0.03
433	688148	芳源股份	1,692	14,517.36	0.03
434	688159	有方科技	326	14,471.14	0.03
435	688389	普门科技	1,477	14,459.83	0.03
436	688680	海优新材	335	14,070.00	0.03
437	688648	中邮科技	382	13,962.10	0.03
438	688602	康鹏科技	1,763	13,892.44	0.03
439	688358	祥生医疗	453	13,848.21	0.03
440	688581	安杰思	263	13,599.73	0.03
441	688130	晶华微	483	13,581.96	0.03
442	688330	宏力达	401	13,565.83	0.03
443	688639	华恒生物	838	13,525.32	0.03
444	688339	亿华通	715	13,370.50	0.02
445	688298	东方生物	745	13,305.70	0.02
446	688429	时创能源	1,301	13,257.19	0.02
447	688571	杭华股份	1,513	13,238.75	0.02
448	688157	松井股份	500	13,195.00	0.02
449	688459	哈铁科技	1,568	13,061.44	0.02
450	688618	三旺通信	424	13,046.48	0.02
451	688755	汉邦科技	472	13,008.32	0.02
452	688129	XD 东来技	495	12,964.05	0.02
453	688023	安恒信息	350	12,852.00	0.02
454	688302	海创药业	364	12,801.88	0.02
455	688175	高凌信息	507	12,751.05	0.02
456	688171	纬德信息	285	12,528.60	0.02
457	688399	硕世生物	276	12,527.64	0.02
458	688511	天微电子	412	12,446.52	0.02
459	688228	开普云	160	12,374.40	0.02
460	688590	新致软件	988	12,280.84	0.02
461	688338	赛科希德	415	12,246.65	0.02
462	688255	凯尔达	436	12,120.80	0.02
463	688600	皖仪科技	363	12,080.64	0.02
464	688115	思林杰	146	12,008.50	0.02
465	688247	宣泰医药	1,593	11,979.36	0.02
466	688558	国盛智科	364	11,961.04	0.02
467	688196	卓越新能	333	11,954.70	0.02
468	688211	中科微至	345	11,874.90	0.02

469	688238	和元生物	2,182	11,826.44	0.02
470	688557	兰剑智能	381	11,822.43	0.02
471	688077	大地熊	446	11,814.54	0.02
472	688696	极米科技	183	11,810.82	0.02
473	688084	晶品特装	234	11,765.52	0.02
474	688588	凌志软件	1,285	11,680.65	0.02
475	688098	申联生物	1,347	11,570.73	0.02
476	688156	路德科技	382	11,555.50	0.02
477	688280	精进电动	2,094	11,496.06	0.02
478	688070	纵横股份	307	11,460.31	0.02
479	688133	泰坦科技	540	11,410.20	0.02
480	688269	凯立新材	356	11,288.76	0.02
481	688489	三未信安	491	11,145.70	0.02
482	688533	上声电子	533	11,118.38	0.02
483	688509	正元地信	2,595	11,106.60	0.02
484	688592	司南导航	266	11,023.04	0.02
485	688619	罗普特	672	10,906.56	0.02
486	688113	联测科技	310	10,881.00	0.02
487	688212	澳华内镜	368	10,819.20	0.02
488	688357	建龙微纳	365	10,756.55	0.02
489	688335	复洁科技	445	10,697.80	0.02
490	688722	同益中	703	10,664.51	0.02
491	688152	麒麟信安	388	10,662.24	0.02
492	688015	交控科技	689	10,596.82	0.02
493	688317	之江生物	686	10,427.20	0.02
494	688455	科捷智能	558	10,412.28	0.02
495	688606	奥泰生物	251	10,311.08	0.02
496	688373	盟科药业	2,276	10,310.28	0.02
497	688500	慧辰股份	227	10,289.91	0.02
498	688071	华依科技	282	10,276.08	0.02
499	688272	富吉瑞	231	10,256.40	0.02
500	688589	力合微	446	10,249.08	0.02
501	688569	铁科轨道	619	9,996.85	0.02
502	688030	山石网科	632	9,979.28	0.02
503	688367	工大高科	297	9,890.10	0.02
504	688178	万德斯	292	9,872.52	0.02
505	688501	青达环保	512	9,830.40	0.02
506	688096	京源环保	735	9,819.60	0.02
507	688285	高铁电气	1,367	9,801.39	0.02
508	688579	地纬智能	1,279	9,707.61	0.02
509	688355	明志科技	502	9,663.50	0.02
510	688656	浩欧博	98	9,483.46	0.02
511	688369	致远互联	451	9,475.51	0.02

512	688718	唯赛勃	593	9,470.21	0.02
513	688737	中自科技	494	9,455.16	0.02
514	688292	浩瀚深度	505	9,393.00	0.02
515	688162	巨一科技	395	9,337.80	0.02
516	688687	凯因科技	564	9,198.84	0.02
517	688657	浩辰软件	257	9,192.89	0.02
518	688314	康拓医疗	271	9,181.48	0.02
519	688435	英方软件	282	9,024.00	0.02
520	688560	明冠新材	753	8,923.05	0.02
521	688529	豪森智能	565	8,887.45	0.02
522	688251	井松智能	346	8,867.98	0.02
523	688056	莱伯泰科	134	8,649.70	0.02
524	688265	XD 南模生	250	8,647.50	0.02
525	688671	碧兴物联	241	8,572.37	0.02
526	688670	金迪克	505	8,554.70	0.02
527	688121	*ST 卓然	1,317	8,534.16	0.02
528	688215	瑞晟智能	212	8,513.92	0.02
529	688310	迈得医疗	549	8,438.13	0.02
530	688080	映翰通	194	8,390.50	0.02
531	688370	丛麟科技	394	8,242.48	0.02
532	688060	云涌科技	247	8,123.83	0.02
533	688038	中科通达	474	7,972.68	0.01
534	688246	嘉和美康	385	7,911.75	0.01
535	688203	海正生材	766	7,644.68	0.01
536	688651	盛邦安全	236	7,603.92	0.01
537	688316	青云科技	136	7,344.00	0.01
538	688597	煜邦电力	1,121	7,286.50	0.01
539	688468	科美诊断	1,258	7,158.02	0.01
540	688229	博睿数据	92	7,056.40	0.01
541	688137	近岸蛋白	196	7,056.00	0.01
542	688638	誉辰智能	225	7,013.25	0.01
543	688244	永信至诚	477	6,802.02	0.01
544	688288	鸿泉技术	381	6,770.37	0.01
545	688517	金冠电气	383	6,694.84	0.01
546	688573	信宇人	372	6,591.84	0.01
547	688118	普元信息	325	6,539.00	0.01
548	688026	洁特生物	416	6,535.36	0.01
549	688395	正弦电气	289	6,386.90	0.01
550	688013	天臣医疗	258	6,364.86	0.01
551	688576	西山科技	159	6,336.15	0.01
552	688089	嘉必优	582	6,175.02	0.01
553	688132	邦彦技术	460	6,049.00	0.01
554	688393	安必平	324	5,760.72	0.01

555	688092	爱科科技	271	5,756.04	0.01
556	688420	美腾科技	272	5,731.04	0.01
557	688616	西力科技	562	5,676.20	0.01
558	688189	ST 南新	942	5,633.16	0.01
559	688051	佳华科技	244	5,607.12	0.01
560	688613	奥精医疗	384	5,418.24	0.01
561	688695	中创股份	289	5,404.30	0.01
562	688659	元琛科技	516	5,387.04	0.01
563	688528	秦川物联	574	5,246.36	0.01
564	688681	科汇股份	371	5,186.58	0.01
565	688296	和达科技	440	5,033.60	0.01
566	688058	宝兰德	238	4,978.96	0.01
567	688004	博汇科技	272	4,950.40	0.01
568	688426	康为世纪	259	4,750.06	0.01
569	688217	睿昂基因	228	4,710.48	0.01
570	688793	倍轻松	292	4,704.12	0.01
571	688329	艾隆科技	228	4,607.88	0.01
572	688021	奥福科技	234	4,530.24	0.01
573	688078	龙软科技	212	4,462.60	0.01
574	688565	力源科技	439	4,148.55	0.01
575	688466	金科环境	316	4,054.28	0.01
576	688067	爱威科技	154	3,103.10	0.01
577	688701	卓锦股份	370	2,786.10	0.01
578	688193	仁度生物	46	2,543.80	0.00

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	688759	必贝特	2,218	70,931.64	0.13
2	688809	强一股份	89	55,447.00	0.10
3	688807	优迅股份	121	48,694.03	0.09
4	688781	视涯科技	792	33,390.72	0.06
5	688808	联讯仪器	19	30,102.27	0.06
6	688796	百奥赛图	271	29,647.40	0.05
7	688790	昂瑞微	194	25,963.02	0.05
8	688818	电科蓝天	344	24,128.16	0.04
9	688785	恒运昌	49	22,694.35	0.04
10	688820	盛合晶微	113	15,988.37	0.03
11	688805	健信超导	265	12,447.05	0.02
12	688813	泰金新能	64	11,013.76	0.02
13	688635	长进光子	30	9,245.70	0.02
14	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.01
15	603459	红板科技	53	4,468.96	0.01

16	603407	长裕集团	53	3,893.38	0.01
17	601112	振石股份	165	2,902.35	0.01
18	688712	北芯生命	78	2,801.76	0.01
19	688816	易思维	48	2,740.80	0.01
20	603352	至信股份	101	2,577.52	0.00
21	603435	嘉德利	36	1,681.56	0.00
22	603284	林平发展	23	802.01	0.00
23	603293	埃泰克	15	508.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688795	摩尔线程	1,658,985.19	0.61
2	688041	海光信息	1,451,395.12	0.54
3	688802	沐曦股份	1,138,439.86	0.42
4	688256	寒武纪	1,019,567.60	0.38
5	688012	中微公司	784,713.20	0.29
6	688981	中芯国际	569,138.62	0.21
7	688008	澜起科技	519,390.00	0.19
8	688411	海博思创	387,895.20	0.14
9	688271	联影医疗	280,524.40	0.10
10	688183	生益电子	274,960.28	0.10
11	688521	芯原股份	252,725.23	0.09
12	688111	金山办公	217,081.35	0.08
13	688375	国博电子	212,048.82	0.08
14	688036	传音控股	185,813.90	0.07
15	688082	盛美上海	182,905.43	0.07
16	688396	华润微	176,406.08	0.07
17	688525	佰维存储	173,437.79	0.06
18	688126	沪硅产业	173,182.95	0.06
19	688777	中控技术	159,654.52	0.06
20	688545	兴福电子	159,315.00	0.06

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

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	688256	寒武纪	14,869,082.73	5.49
2	688041	海光信息	14,260,845.11	5.26
3	688012	中微公司	6,601,586.96	2.44
4	688981	中芯国际	6,136,809.05	2.27

5	688008	澜起科技	4,308,072.34	1.59
6	688111	金山办公	3,669,047.64	1.35
7	688506	百利天恒	3,118,877.40	1.15
8	688271	联影医疗	2,709,090.07	1.00
9	688072	拓荆科技	2,625,700.42	0.97
10	688521	芯原股份	2,467,001.04	0.91
11	688082	盛美上海	2,305,515.75	0.85
12	688775	影石创新	2,201,104.42	0.81
13	688183	生益电子	2,061,670.58	0.76
14	688498	源杰科技	1,932,397.47	0.71
15	688525	佰维存储	1,919,204.88	0.71
16	688396	华润微	1,896,973.45	0.70
17	688036	传音控股	1,842,297.33	0.68
18	688375	国博电子	1,781,050.45	0.66
19	688249	晶合集成	1,771,065.15	0.65
20	688126	沪硅产业	1,712,844.03	0.63

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

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	17,418,023.79
卖出股票收入（成交）总额	263,101,511.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	805,185.53	1.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	22,785.59	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	827,971.12	1.53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例
----	-----	------	----	------	-----------

	码		(张)		(%)
1	019827	26 国债 01	8,000	805,185.53	1.49
2	118066	统联转债	50	6,837.15	0.01
3	118070	南芯转债	60	6,000.34	0.01
4	118067	上 26 转债	30	3,947.88	0.01
5	118072	鼎通转债	30	3,000.09	0.01

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
注：无。

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
注：无。

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
注：无。

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

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

7.11.2 本期国债期货投资评价
本报告期内，本基金国债期货投资情况符合既定的投资政策和投资目的。

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
本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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
本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	74,564.51

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	112,336.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,901.27

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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	799,492.77	1.48	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	733,126.02	1.36	新股锁定
3	688802	沐曦股份	614,343.11	1.14	新股锁定

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688781	视涯科技	33,390.72	0.06	新股锁定
2	688808	联讯仪器	30,102.27	0.06	新股锁定

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（%）
长城上证	592	39,991.61	-	-	23,675,035.29	100.00

科创板综合指数 A						
长城上证科创板综合指数 C	670	17,513.33	-	-	11,733,932.12	100.00
合计	1,262	28,057.82	-	-	35,408,967.41	100.00

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

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	长城上证科创板综合指数 A	1,707.18	0.0072
	长城上证科创板综合指数 C	-	-
	合计	1,707.18	0.0048

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	长城上证科创板综合指数 A	0
	长城上证科创板综合指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城上证科创板综合指数 A	0
	长城上证科创板综合指数 C	0
	合计	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城上证科创板综合指数 A	长城上证科创板综合指数 C
----	---------------	---------------

基金合同生效日 (2025 年 8 月 28 日) 基金份额总额	459,476,443.77	104,654,838.41
本报告期期初基金份额总额	208,064,404.08	62,235,132.22
本报告期基金总申购份额	8,720,743.46	12,637,233.61
减: 本报告期基金总赎回份额	193,110,112.25	63,138,433.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,675,035.29	11,733,932.12

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动：
(1) 自 2026 年 3 月 25 日起，邱春杨不再担任公司总经理，聘任祝函为公司总经理，同时解聘其公司督察长职务。在公司新任督察长正式任职之前，由祝函代为履行公司督察长职务。
(2) 自 2026 年 6 月 23 日起，李建军正式任职公司督察长，祝函不再代为履行督察长职务。
2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：
本报告期内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

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

注：本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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 (%)	
国泰海通	2	231,705,022.91	82.68	45,399.51	82.68	未变更
招商证券	2	33,956,165.57	12.12	6,653.34	12.12	未变更
长江证券	1	14,570,991.68	5.20	2,854.83	5.20	未变更
财信证券	2	-	-	-	-	未变更
长城证券	3	-	-	-	-	未变更
德邦证券	2	-	-	-	-	未变更
东方财富	2	-	-	-	-	未变更
东方证券	1	-	-	-	-	未变更
方正证券	1	-	-	-	-	未变更
光大证券	1	-	-	-	-	未变更
国海证券	2	-	-	-	-	未变更
国联民生证券	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券	1	-	-	-	-	未变更
国信证券	1	-	-	-	-	未变更

						更
华安证券	1	-	-	-	-	未变更
华金证券	2	-	-	-	-	未变更
申万宏源	1	-	-	-	-	未变更
世纪证券	1	-	-	-	-	未变更
西南证券	1	-	-	-	-	未变更
信达证券	1	-	-	-	-	未变更
粤开证券	2	-	-	-	-	未变更
中金公司	1	-	-	-	-	未变更
中泰证券	2	-	-	-	-	未变更
中信建投	1	-	-	-	-	未变更
中信证券	1	-	-	-	-	未变更
中银国际	1	-	-	-	-	未变更

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

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

1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

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

(5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

(1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；

(2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；

(3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

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(%)
国泰海通	6,071,960.70	61.43	-	-	-	-
招商证券	3,512,045.00	35.53	-	-	-	-
长江证券	300,231.00	3.04	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联民	-	-	-	-	-	-

生证券						
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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	长城基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 27 日
2	长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	在证监会规定报刊和网站披露	2026 年 3 月 30 日
3	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	在证监会规定报刊和网站披露	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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予长城上证科创板综合指数型证券投资基金注册的文件
- （二）《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城上证科创板综合指数型证券投资基金托管协议》
- （四）《长城上证科创板综合指数型证券投资基金招募说明书》
- （五） 法律意见书
- （六） 基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七） 基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八） 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日