

长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月20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03月24日（基金合同生效日）起至06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	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	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	53
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54

§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
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	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	59
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	60
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	长江上证科创板综合指数增强发起	
基金主代码	026179	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 月 24 日	
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,980,065.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长江上证科创板综合指数增强发起 A	长江上证科创板综合指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	026179	026180
报告期末下属分级基金的份额总额	14,089,759.97 份	1,890,305.43 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金,在力求对上证科创板综合指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括: 1、股票投资策略; 2、债券投资策略; 3、衍生品投资策略; 4、资产支持证券投资策略; 5、可转换债券、可交换债券投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及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		长江证券（上海）资产管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨	林盛
	联系电话	4001-166-866	010-58560666
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4001-166-866	95568
传真		021-65779500	010-57093382
注册地址		上海市虹口区新建路 200 号 B 栋 19 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200080	100031
法定代表人		张波	高迎欣

注：自 2026 年 8 月 4 日起，长江证券（上海）资产管理有限公司法定代表人变更为张波先生。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cjzcgl.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 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 03 月 24 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	长江上证科创板综合指数增强发起 A	长江上证科创板综合指数增强发起 C

本期已实现收益	902, 181. 05	125, 973. 62
本期利润	2, 678, 286. 06	397, 761. 61
加权平均基金份额本期利润	0. 1393	0. 1244
本期加权平均净值利润率	13. 61%	12. 18%
本期基金份额净值增长率	16. 21%	16. 08%
3. 1. 2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	789, 307. 30	103, 660. 29
期末可供分配基金份额利润	0. 0560	0. 0548
期末基金资产净值	16, 373, 301. 72	2, 194, 260. 74
期末基金份额净值	1. 1621	1. 1608
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	16. 21%	16. 08%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。（3）表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。（4）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（5）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满半年。

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

长江上证科创板综合指数增强发起 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	16. 22%	1. 05%	52. 44%	2. 24%	-36. 22%	-1. 19%
自基金合同生效起至今	16. 21%	1. 01%	55. 27%	2. 22%	-39. 06%	-1. 21%

长江上证科创板综合指数增强发起 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	16. 10%	1. 05%	52. 44%	2. 24%	-36. 34%	-1. 19%
自基金合同生效起至今	16. 08%	1. 01%	55. 27%	2. 22%	-39. 19%	-1. 21%

注：（1）本基金的业绩比较基准为上证科创板综合指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%；（2）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日。

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

长江上证科创板综合指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年03月24日-2026年06月30日)



长江上证科创板综合指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年03月24日-2026年06月30日)



注：（1）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年；（2）按照本基金的基金合同约定，基金管理人应自基金合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金基金合同第十二部分“二、投资范围”、“四、投资限制”的有关约定；

(3) 截至本报告期末，本基金尚处在建仓期。

§ 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

长江证券（上海）资产管理有限公司于 2014 年 9 月 16 日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江惠盈 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江楚财一年持有期混合型发起式证券投资基金、长江乐睿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长江安悦利率债债券型证券投资基金、长江长扬混合型发起式证券投资基金、长江长宏混合型发起式证券投资基金、长江 90 天持有期债券型证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江旭日混合型证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江医药健康精选混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金和长江货币管家货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
张帅	本基金的 基金经理	2026-03-24	-	9 年	国籍：中国。博士研究生，具备基金从业资格。曾任天翼电子商务有限公司财富管理部见习总裁，长江证券股份有限公司互联网金融总部金融产品工程师、证券投资部量化投资总监，长江证券（上海）资产管理有限公司综合管理部战略支持岗、量化投资部研究员。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
秦昌贵	本基金的 基金经 理、量化 投资部总 经理	2026-03-24	-	21 年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任长江证券有限责任公司衍生产品部研究员，长江证券股份有限公司资产管理总部产品开发部主管、量化投资部主管，长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理，创金合信基金管理有限公司量化投资部副总监、CTA 投资部总监。现任长江证券（上海）资产管理有限公司量化投资部总经理。截至本报告期末任长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证

					券投资基金、长江中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、长江中证全指指数增强型发起式证券投资基金、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；（2）证券从业的含义遵从中国证监会《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。

4.2 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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（1）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（2）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在 1%

数量级及以下。

（3）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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。

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 股在“十五五”开局、中东地缘升级、美联储换帅转鹰三重变量下，走出“一季度震荡分化，二季度 V 型修复”的节奏，结构性极致分化贯穿始终：科创 50 半年涨 64.25%、创业板指涨 35.58%，但全市场个股涨跌幅中位数-14.0%，逾百股半年涨超 200%，“AI 定胜负、结构大于总量”的格局基本锁定。节奏上，1 月融资保证金政策降温投机，主线切向“算电协同+资源品涨价”；3 月，中东冲突及霍尔木兹航运风险推高油价，美联储 3 月 18 日按兵不动，权益市场连续三周下挫；4 月，市场在惯性探底后经“业绩验证+政策托底”企稳；5 月，AI 算力链（光模块/半导体设备/PCB）业绩兑现驱动反弹加速，科创 50 领跑；6 月，地缘退潮叠加美联储新任主席沃什首秀删除“年内降息”、点阵图转鹰，科技内部分化加剧，停战备忘录签署后市场焦点回归 AI 业绩与“十五五”细则。国内托底三角（“十五五”科技自立+AI+”、4 月政治局稳资本市场、地产与地方债化解）对冲了海外美伊战事和联储转鹰，最终能源安全、科技自立、内需修复三条主线比 2025 年更鲜明。

报告期内，本基金通过多因子选股模型，对历史数据进行深入统计研究，综合考虑了大量信息，挖掘影响证券价格的各类因子，选取基本面类、量价类、基本面交叉类、量价交叉类、基本面量价交叉类等几大类对股票超额收益具有较强解释度的因子，动态筛选因子并进行因子合成，来构建 Alpha 多因子模型，从全市场可投资股票中精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，挖掘市场的 Alpha。在股票选择方面，我们重点关注上市公司的财务状况及股票的交易状况，优先选择在价值和成长方面较为平衡的个股进行配置，并尽量规避财务杠杆高、现金流缺乏、公司成长稳定性差及运营能力差的公司；同时利用交易指标刻画股票的投机情绪，规避短期投机情绪高的个股。投资管理上，根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整个股权重，在 Alpha 模型提供的收益

预测基础上，构建风险预测模型计算因子暴露风险，以及成本模型控制交易成本。组合优化模型在控制风险的前提下追求最大化预测收益的组合持仓结果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.1621 元，C 类基金份额净值为 1.1608 元。本报告期内，A 类基金份额净值增长率为 16.21%，同期业绩比较基准收益率为 55.27%；C 类基金份额净值增长率为 16.08%，同期业绩比较基准收益率为 55.27%。

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，A 股市场有望延续结构性慢牛、震荡上行的主基调，“K 型分化”或将取代牛熊思维。节奏上，7 月或是全年唯一的关键变盘窗口，短期波动或放大；7 至 8 月中报披露期间，AI 算力链将面临业绩兑现压力测试，叠加美伊 6 月 17 日谅解备忘录的 60 天谈判窗口将于 8 月中到期、中东供给端仍有脉冲可能，风险偏好或阶段性受压。7 月下旬，政治局会议是下半年第一个政策锚点，对 AI 基建、新型电网、算力网等方向的订单兑现预期有直接催化作用。海外流动性端，沃什首秀点阵图 18 人中 9 人支持 2026 年年内加息，与年初“9 月降息”的共识相比已明显转鹰，但若美国就业数据在三季度出现松动，市场或仍会博弈“单次降息+年内重回加息”的折中路径，人民币升值带动外资回流的逻辑未被完全破坏，只是弹性弱于 2025 年同期。对于后市，我们相对更为乐观。托底三角仍未松动，继续向下空间有限。未来我们将坚持利用量化模型批量处理的优势对股票进行筛选，在控制风险的前提下追求组合持仓预期收益的最大化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值，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。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和

估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末生效未满三年，暂不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 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：长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	3,416,657.55
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	15,418,744.00
其中：股票投资		15,418,744.00
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	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		1,501.97
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		18,836,903.52
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 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		246,233.19
应付管理人报酬		12,875.38
应付托管费		2,414.12
应付销售服务费		822.04
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	6.4.7.6	6,996.33
负债合计		269,341.06
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	15,980,065.40
未分配利润	6.4.7.8	2,587,497.06
净资产合计		18,567,562.46
负债和净资产总计		18,836,903.52

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 15,980,065.40 份。其中长江上证科创板综合指数增强发起 A 基金份额净值 1.1621 元，基金份额总额 14,089,759.97 份；长江上证科创板综合指数增强发起 C 基金份额净值 1.1608 元，基金份额总额 1,890,305.43 份。（2）本基金于 2026 年 03 月 24 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合 同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		3,145,885.67
1. 利息收入		8,521.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,521.29
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）		1,089,426.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,061,275.17
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.11	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.13	—
股利收益	6.4.7.14	28,151.35
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,047,893.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	44.86

减：二、营业总支出		69,838.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	49,308.70
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,245.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,509.94
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	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	7,773.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,076,047.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,076,047.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,076,047.67

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 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	-	-	-
二、本期期初净资产	24,413,642.83	-	24,413,642.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,433,577.43	2,587,497.06	-5,846,080.37
（一）、综合收益总额	-	3,076,047.67	3,076,047.67

(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)	-8,433,577.43	-488,550.61	-8,922,128.04
其中: 1. 基金申购款	78,139.34	2,740.18	80,879.52
2. 基金赎回款	-8,511,716.77	-491,290.79	-9,003,007.56
(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	15,980,065.40	2,587,497.06	18,567,562.46

注: 本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日, 截至本报告期末未满一年, 无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

张波	潘山	何永生
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

长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金(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]2541 号文《关于准予长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册, 由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江上证科创板综合指数增强型发起式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, 基金存续期限为不定期, 首次设立募集资金为 24,411,049.07 元, 认购资金在募集期间产生的利息 2,593.76 元, 合计为 24,413,642.83 元, 按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算, 折合基金份额为 24,413,642.83 份, 业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2026)0100009 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2026 年 03 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券(上海)资产管理有限公司, 基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江上证科创板综合指数增强型发起式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, 以标的指数(即上证科创板综合指数)的成份股及其备选成份股(含存托凭证)为主要投资对象。为更好地实现投资目标, 本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数

成份股及其备选成份股，含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债、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、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货，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的相关规定）。

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。

本基金投资于股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的资产比例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 20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券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。

如果法律法规或中国证监会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。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下简称“企业会计准则”），以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本基金持有的股票投资、债券投资及资产支持证券投资等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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金目前无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

衍生工具亦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，在资产负债表中以衍生金融资产/负债列示。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- ①本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- ②该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本

基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

（2）金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

本基金现无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。

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

（1）金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

（2）金融工具的后续计量

①以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益。

②以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

④以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（3）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

②该金融资产已转移，且本基金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；

③该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损

益：

- ①所转移金融资产的账面价值；
- ②因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（4）金融工具的减值

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会计处理并确认损失准备：

①预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企业面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

②预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

③核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件时，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- （1）本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的。
- （2）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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

处置交易性金融资产、衍生工具的投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。交易费用于交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；

如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金利润的构成：基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

(2) 基金可供分配利润：基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

(3) 基金收益分配原则

①基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

②在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告。《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

③本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成相应类别的基金份额，红利再投资的 A 类基金份额免收申购费；

④基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

⑤由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

⑥法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在不违反法律法规的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

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入账。

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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分

部为基础确定报告分部。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

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》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46

号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。存款利息收入不征收增值税；金融机构开展的质押式买入返售金融资产及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的 A 股上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司提出申请，由中国证券登记结算有限责任公司向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国证券登记结算有限责任公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(5) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对

于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

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 06 月 30 日
活期存款	1,526,834.49
等于：本金	1,526,667.16
加：应计利息	167.33
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	1,889,823.06
等于：本金	1,889,800.86
加：应计利息	22.20
减：坏账准备	-
合计	3,416,657.55

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪服务机构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 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,370,851.00	-	15,418,744.00	2,047,893.00
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	13,370,851.00	-	15,418,744.00	2,047,893.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	6,996.33
合计	6,996.33

6.4.7.7 实收基金

长江上证科创板综合指数增强发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	20,798,836.78	20,798,836.78
本期申购	77,754.31	77,754.31
本期赎回（以“-”号填列）	-6,786,831.12	-6,786,831.12
本期末	14,089,759.97	14,089,759.97

长江上证科创板综合指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,614,806.05	3,614,806.05
本期申购	385.03	385.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,724,885.65	-1,724,885.65
本期末	1,890,305.43	1,890,305.43

注：（1）本基金募集期间有效净认购资金合计为人民币 24,411,049.07 元，折合为基金份额共计 24,411,049.07 份（其中 A 类份额 20,796,354.11 份，C 类份额 3,614,694.96 份）。有效净认购资金于募集期间产生的利息为人民币 2,593.76 元，折合为基金份额 2,593.76 份（其中 A 类份额 2,482.67 份，C 类份额 111.09 份），已计入基金份额持有人账户。（2）上述申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

长江上证科创板综合指数增强发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	902,181.05	1,776,105.01	2,678,286.06
本期基金份额交易产生的变动数	-112,873.75	-281,870.56	-394,744.31
其中：基金申购款	622.36	2,082.85	2,705.21
基金赎回款	-113,496.11	-283,953.41	-397,449.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	789,307.30	1,494,234.45	2,283,541.75

长江上证科创板综合指数增强发起 C

单位：人民币元

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

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	125,973.62	271,787.99	397,761.61
本期基金份额交易产生的变动数	-22,313.33	-71,492.97	-93,806.30
其中：基金申购款	14.95	20.02	34.97
基金赎回款	-22,328.28	-71,512.99	-93,841.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	103,660.29	200,295.02	303,955.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	7,373.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,147.54
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	8,521.29

6.4.7.10 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 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	28,760,533.49
减：卖出股票成本总额	27,666,728.80
减：交易费用	32,529.52
买卖股票差价收入	1,061,275.17

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	28,151.35

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	28,151.35

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,047,893.00
——股票投资	2,047,893.00
——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	2,047,893.00

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	44.86
合计	44.86

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月
----	--

	30 日
审计费用	6,996.33
信息披露费	—
证券出借违约金	—
汇划手续费	377.62
开户费	400.00
合计	7,773.95

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期不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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人母公司、基金销售机构、证券经纪服务机构

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	69,798,113.29	100.00%

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	13,674.21	100.00%	-	-

注：（1）上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示，交易佣金的计算方式、佣金计算比率公允；（2）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	49,308.70
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,542.96
应支付基金管理人的净管理费	35,765.74

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(3) 本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,245.41

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

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

（2）基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

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 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长江上证科创板综合 指数增强发起 A	长江上证科创板综合 指数增强发起 C	合计
长江证券股份有限公司	-	1,095.70	1,095.70
长江证券（上海）资产管理有限公司	-	0.00	0.00
中国民生银行股份有限公司	-	2,414.24	2,414.24
合计	-	3,509.94	3,509.94

注：（1）本基金 A 类基金份额不收取基金销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

(2) 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

(3) 本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生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。

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

长江上证科创板综合指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期
	2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2026 年 03 月 24 日）持有的基金份额	10,001,458.48
报告期初持有的基金份额	—
报告期间申购/买入总份额	—

报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	10,001,458.48
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	70.98%

注：（1）基金管理人运用固有资金投资本基金，适用费率符合基金合同和招募说明书的相关约定；（2）申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额；（3）报告期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额；（4）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	1,526,834.49	7,373.75
长江证券股份有限公司	1,889,823.06	1,147.54

注：（1）上述银行存款由基金托管人中国民生银行股份有限公司保管，按约定利率计息；上述证券交易结算资金由证券经纪服务机构长江证券股份有限公司保管，按约定利率计息。（2）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	2026-06-29	筹划发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金	832.00	2026-07-13	890.99	200	147,170.00	166,400.00	-
688260	昀冢科技	2026-06-26	就股票交易波动	144.00	2026-07-01	132.00	686	50,335.23	98,784.00	-

			情 况 进 行 停 牌 核 查							
--	--	--	--------------------------------------	--	--	--	--	--	--	--

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为 0 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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投

资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。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、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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在基金运作周期内的每个开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

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均在证券交易所上市，持有资产流动性高，本基金可通过卖出资产方式应对流动性需求。本基金管理人每日预测本基金的流动性管理，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的检测和分析。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或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06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	3,416,657.55	-	-	-	3,416,657.55
交易性金融资产	-	-	-	15,418,744.00	15,418,744.00
应收申购款	-	-	-	1,501.97	1,501.97
资产总计	3,416,657.55	-	-	15,420,245.97	18,836,903.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	246,233.19	246,233.19
应付管理人报酬	-	-	-	12,875.38	12,875.38
应付托管费	-	-	-	2,414.12	2,414.12
应付销售服务费	-	-	-	822.04	822.04
其他负债	-	-	-	6,996.33	6,996.33

负债总计	-	-	-	269,341.06	269,341.06
利率敏感度缺口	3,416,657.55	-	-	15,150,904.91	18,567,562.46

注：（1）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。（2）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金本报告期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的股票和固定收益品种，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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种方法对基金进行风险度量，以及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	15,418,744.00	83.04
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	15,418,744.00	83.04

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变。	
	以下分析中，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
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 06 月 30 日
	业绩比较基准上涨 5%	321,634.74
	业绩比较基准下跌 5%	-321,634.74

注：（1）上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，组合业绩比较基准发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响；（2）本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年度末数据。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 06 月 30 日
第一层次	15,153,560.00
第二层次	265,184.00
第三层次	-
合计	15,418,744.00

注：本基金基金合同生效日为 2026 年 03 月 24 日，截至本报告期末未满一年，无上年

度末数据。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	15,418,744.00	81.85
	其中：股票	15,418,744.00	81.85
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	3,416,657.55	18.14
8	其他各项资产	1,501.97	0.01
9	合计	18,836,903.52	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	10,157,800.35	54.71
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	2,574,504.91	13.87
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	622,053.74	3.35
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	13,354,359.00	71.92

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	1,213,669.00	6.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,215.00	0.44
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	308,473.00	1.66
J	金融业	226,790.00	1.22
K	房地产业	79,720.00	0.43
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	74,706.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	78,812.00	0.42
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	2,064,385.00	11.12

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	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	698	1,113,693.90	6.00
2	688041	海光信息	2,055	760,966.50	4.10
3	688008	澜起科技	941	291,615.90	1.57
4	688981	中芯国际	1,727	274,282.14	1.48
5	688525	佰维存储	513	253,796.49	1.37
6	688521	芯原股份	649	240,869.86	1.30
7	688347	华虹宏力	600	201,780.00	1.09
8	688396	华润微	2,003	195,392.65	1.05
9	688120	华海清科	601	193,630.18	1.04
10	688249	晶合集成	3,223	190,253.69	1.02
11	688082	盛美上海	439	189,648.00	1.02
12	688037	芯源微	400	175,620.00	0.95
13	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.93
14	688469	芯联集成	15,753	167,139.33	0.90
15	688110	东芯股份	819	166,830.30	0.90
16	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.90
17	688002	睿创微纳	1,057	163,507.33	0.88

18	688301	奕瑞科技	1,213	150,412.00	0.81
19	688313	仕佳光子	800	147,720.00	0.80
20	688147	微导纳米	905	146,501.40	0.79
21	688141	杰华特	952	146,132.00	0.79
22	688536	思瑞浦	400	145,636.00	0.78
23	688676	金盘科技	1,662	140,671.68	0.76
24	688234	天岳先进	800	138,808.00	0.75
25	688019	安集科技	400	135,784.00	0.73
26	688248	南网科技	1,871	129,435.78	0.70
27	688689	银河微电	1,910	123,615.20	0.67
28	688409	富创精密	400	122,500.00	0.66
29	688652	京仪装备	600	120,102.00	0.65
30	688368	晶丰明源	550	119,086.00	0.64
31	688169	石头科技	1,244	118,142.68	0.64
32	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.62
33	688800	瑞可达	1,200	115,164.00	0.62
34	688001	华兴源创	1,334	114,323.80	0.62
35	688383	新益昌	600	112,824.00	0.61
36	688150	莱特光电	1,622	111,301.64	0.60
37	688319	欧林生物	2,518	110,741.64	0.60
38	688630	芯碁微装	200	109,878.00	0.59
39	688416	恒烁股份	780	109,200.00	0.59
40	688549	中巨芯	2,961	108,994.41	0.59
41	688198	佰仁医疗	1,200	107,088.00	0.58
42	688388	嘉元科技	2,432	107,008.00	0.58
43	688531	日联科技	600	106,704.00	0.57
44	688610	埃科光电	400	105,360.00	0.57
45	688200	华峰测控	200	105,020.00	0.57
46	688209	英集芯	3,588	104,339.04	0.56
47	688131	皓元医药	1,098	103,870.80	0.56
48	688155	先惠技术	1,264	102,244.96	0.55
49	688662	富信科技	600	100,800.00	0.54
50	688202	美迪西	1,238	99,918.98	0.54
51	688260	昀冢科技	686	98,784.00	0.53
52	688161	威高骨科	4,696	98,522.08	0.53
53	688690	纳微科技	2,228	98,254.80	0.53
54	688222	成都先导	3,047	97,839.17	0.53
55	688218	江苏北人	1,779	97,773.84	0.53
56	688173	希荻微	5,103	97,671.42	0.53
57	688305	科德数控	1,491	97,317.57	0.52
58	688277	天智航	5,687	97,247.70	0.52
59	688530	欧莱新材	1,000	96,900.00	0.52
60	688378	奥来德	1,562	96,844.00	0.52

61	688046	药康生物	3,949	95,565.80	0.51
62	688669	聚石化学	888	95,016.00	0.51
63	688710	益诺思	1,411	94,819.20	0.51
64	688332	中科蓝讯	600	94,500.00	0.51
65	688620	安凯微	5,830	94,446.00	0.51
66	688450	光格科技	1,408	94,321.92	0.51
67	688625	呈和科技	1,113	93,948.33	0.51
68	688353	华盛锂电	804	93,320.28	0.50
69	688059	华锐精密	467	93,264.57	0.50
70	688653	康希通信	5,365	93,243.70	0.50
71	688182	灿勤科技	2,153	92,729.71	0.50
72	688168	安博通	1,346	92,537.50	0.50
73	688050	爱博医疗	2,530	92,218.50	0.50
74	688253	英诺特	1,517	91,444.76	0.49
75	688392	骄成超声	400	90,872.00	0.49
76	688699	明微电子	1,107	90,718.65	0.49
77	688190	云路股份	1,000	90,710.00	0.49
78	688232	新点软件	5,097	90,624.66	0.49
79	688575	亚辉龙	10,194	89,299.44	0.48
80	688391	钜泉科技	2,476	88,814.12	0.48
81	688605	先锋精科	845	87,896.90	0.47
82	688606	奥泰生物	2,139	87,870.12	0.47
83	688511	天微电子	2,881	87,035.01	0.47
84	688419	耐科装备	1,104	86,829.60	0.47
85	688718	唯赛勃	5,415	86,477.55	0.47
86	688588	凌志软件	9,503	86,382.27	0.47
87	688199	久日新材	2,446	84,460.38	0.45
88	688671	碧兴物联	2,372	84,372.04	0.45
89	688696	极米科技	1,267	81,772.18	0.44
90	688096	京源环保	6,076	81,175.36	0.44
91	688628	优利德	817	80,833.98	0.44
92	688768	容知日新	1,563	80,557.02	0.43
93	688323	瑞华泰	1,376	77,744.00	0.42
94	688056	莱伯泰科	1,200	77,460.00	0.42
95	688045	必易微	952	76,902.56	0.41
96	688183	生益电子	468	61,963.20	0.33
97	688111	金山办公	284	60,506.20	0.33
98	688172	燕东微	587	49,108.42	0.26
99	688519	南亚新材	89	33,823.56	0.18
100	688271	联影医疗	328	33,203.44	0.18
101	688126	沪硅产业	744	29,678.16	0.16
102	688506	百利天恒	62	18,229.86	0.10
103	688195	腾景科技	80	15,406.40	0.08

104	688550	瑞联新材	167	9,660.95	0.05
105	688300	联瑞新材	39	9,531.60	0.05
106	688125	安达智能	47	7,684.50	0.04
107	688266	泽璟制药	64	7,466.24	0.04
108	688047	龙芯中科	47	7,269.49	0.04
109	688333	铂力特	49	5,017.60	0.03
110	688448	磁谷科技	70	4,449.20	0.02
111	688581	安杰思	72	3,723.12	0.02
112	688049	炬芯科技	76	3,565.16	0.02
113	688083	中望软件	55	3,561.25	0.02
114	688003	天准科技	25	3,182.50	0.02
115	688063	派能科技	59	3,142.93	0.02
116	688216	气派科技	74	3,108.74	0.02
117	688385	复旦微电	43	3,065.47	0.02
118	688523	航天环宇	55	2,882.00	0.02
119	688398	赛特新材	100	2,591.00	0.01
120	688112	鼎阳科技	34	2,497.64	0.01
121	688499	利元亨	42	2,207.10	0.01
122	688309	恒誉环保	36	2,191.68	0.01
123	688358	祥生医疗	71	2,170.47	0.01
124	688543	国科军工	48	1,893.60	0.01
125	688077	大地熊	67	1,774.83	0.01
126	688255	凯尔达	63	1,751.40	0.01
127	688631	莱斯信息	36	1,688.76	0.01
128	688360	德马科技	87	1,557.30	0.01
129	688558	国盛智科	43	1,412.98	0.01
130	688439	振华风光	30	1,386.00	0.01
131	688798	艾为电子	18	1,319.76	0.01
132	688100	威胜信息	42	1,284.78	0.01
133	688128	中国电研	54	1,281.96	0.01
134	688157	松井股份	48	1,266.72	0.01
135	688321	微芯生物	47	1,237.51	0.01
136	688311	盟升电子	46	1,204.74	0.01
137	688479	友车科技	31	1,177.07	0.01
138	688151	华强科技	79	1,174.73	0.01
139	688626	翔宇医疗	24	1,062.24	0.01
140	688722	同益中	68	1,031.56	0.01
141	688698	伟创电气	19	996.55	0.01
142	688075	安旭生物	30	892.80	0.00
143	688259	创耀科技	22	860.64	0.00
144	688152	麒麟信安	29	796.92	0.00
145	688269	凯立新材	25	792.75	0.00
146	688380	中微半导	12	790.92	0.00

147	688557	兰剑智能	25	775.75	0.00
148	688158	优刻得	20	735.20	0.00
149	688636	智明达	17	615.91	0.00
150	688621	阳光诺和	11	604.01	0.00
151	688268	华特气体	2	535.00	0.00
152	688683	莱尔科技	12	455.04	0.00
153	688051	佳华科技	19	436.62	0.00
154	688569	铁科轨道	26	419.90	0.00
155	688345	博力威	7	406.56	0.00
156	688500	慧辰股份	7	317.31	0.00
157	688377	迪威尔	3	70.74	0.00
158	688435	英方软件	1	32.00	0.00
159	688697	纽威数控	1	13.59	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	占基金资产净值比例(%)
1	002805	丰元股份	3,000	85,770.00	0.46
2	603223	恒通股份	6,300	82,215.00	0.44
3	301555	惠柏新材	1,800	81,738.00	0.44
4	300451	创业慧康	25,500	81,600.00	0.44
5	002103	广博股份	13,800	81,006.00	0.44
6	603283	赛腾股份	1,000	80,980.00	0.44
7	301280	珠城科技	1,600	80,912.00	0.44
8	300413	芒果超媒	5,500	80,465.00	0.43
9	002264	新华都	14,200	80,088.00	0.43
10	600206	有研新材	1,200	79,920.00	0.43
11	600641	先导基电	2,000	79,720.00	0.43
12	601127	赛力斯	1,300	79,625.00	0.43
13	603758	秦安股份	8,900	79,566.00	0.43
14	002097	山河智能	11,000	79,530.00	0.43
15	603896	寿仙谷	6,100	78,995.00	0.43
16	603686	福龙马	6,100	78,812.00	0.42
17	603156	养元饮品	1,600	78,512.00	0.42
18	600999	招商证券	3,700	78,070.00	0.42
19	601963	重庆银行	7,700	77,616.00	0.42
20	301252	同星科技	1,900	77,007.00	0.41
21	605186	健麾信息	2,400	75,264.00	0.41
22	603259	药明康德	600	74,706.00	0.40
23	600498	烽火通信	1,000	73,600.00	0.40
24	600176	中国巨石	1,000	72,880.00	0.39
25	600909	XD 华安证	6,400	71,104.00	0.38

26	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.36
27	603065	宿迁联盛	1,400	28,364.00	0.15

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	785,238.00	4.23
2	688041	海光信息	687,452.22	3.70
3	688082	盛美上海	403,548.39	2.17
4	688008	澜起科技	370,687.47	2.00
5	688361	中科飞测	363,427.00	1.96
6	688347	华虹宏力	351,211.52	1.89
7	688981	中芯国际	346,609.06	1.87
8	688072	拓荆科技	343,970.00	1.85
9	688183	生益电子	338,486.98	1.82
10	688120	华海清科	295,752.48	1.59
11	688313	仕佳光子	276,091.75	1.49
12	688536	思瑞浦	251,034.96	1.35
13	688627	精智达	250,810.85	1.35
14	688200	华峰测控	246,926.00	1.33
15	688498	源杰科技	242,424.00	1.31
16	688019	安集科技	241,426.80	1.30
17	688525	佰维存储	241,032.82	1.30
18	688409	富创精密	239,489.30	1.29
19	688396	华润微	237,921.70	1.28
20	688146	中船特气	228,057.12	1.23

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688627	精智达	314,242.92	1.69
2	688082	盛美上海	313,279.00	1.69
3	688146	中船特气	301,387.36	1.62

4	688361	中科飞测	300,270.70	1.62
5	688498	源杰科技	283,092.00	1.52
6	688183	生益电子	278,027.20	1.50
7	688507	索辰科技	263,188.64	1.42
8	688519	南亚新材	237,492.21	1.28
9	688072	拓荆科技	227,280.46	1.22
10	688008	澜起科技	224,601.00	1.21
11	688409	富创精密	220,693.18	1.19
12	688200	华峰测控	218,228.00	1.18
13	688777	中控技术	212,615.55	1.15
14	688347	华虹宏力	201,905.06	1.09
15	688187	时代电气	201,050.71	1.08
16	688585	上纬新材	197,241.11	1.06
17	688559	海目星	191,419.97	1.03
18	688331	荣昌生物	179,881.79	0.97
19	688120	华海清科	175,448.20	0.94
20	688668	鼎通科技	168,416.00	0.91

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“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	41,037,579.80
卖出股票收入（成交）总额	28,760,533.49

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“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

本基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,501.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,501.97

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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
长江上证科创	78	180,637.95	10,001,458.48	70.98%	4,088,301.49	29.02%

板综合 指数增 强发起 A						
长江上 证科创 板综合 指数增 强发起 C	49	38,577.66	0.00	0.00%	1,890,305.43	100.00%
合计	125	127,840.52	10,001,458.48	62.59%	5,978,606.92	37.41%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。（2）户均持有的基金份额合计=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	长江上证科创板综合 指数增强发起 A	—	—
	长江上证科创板综合 指数增强发起 C	100.01	0.0053%
	合计	100.01	0.0006%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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	长江上证科创板综合指数 增强发起 A	0
	长江上证科创板综合指数 增强发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长江上证科创板综合指数 增强发起 A	0
	长江上证科创板综合指数	0

	增强发起 C	
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,458.48	62.59%	10,001,458.48	62.59%	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,001,458.48	62.59%	10,001,458.48	62.59%	—

注：持有份额占基金总份额比例、发起份额占基金总份额比例的计算中，分母采用报告期末基金份额总额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江上证科创板综合指数增强发起 A	长江上证科创板综合指数增强发起 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 24 日）基金份额总额	20,798,836.78	3,614,806.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	77,754.31	385.03
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,786,831.12	1,724,885.65
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	14,089,759.97	1,890,305.43

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

本报告期内，本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

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，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

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，本基金托管人未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	69,798,113.29	100.00%	13,674.21	100.00%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2、本基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，委托其办理本基金的证券交易业务。证券公司的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好，经营行为规范。
- (2) 具备较强的合规风控能力。
- (3) 具备较强的交易服务能力。

3、受托办理证券交易的证券公司选择程序如下：本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与受托证券公司签订证券经纪服务协议。

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	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网站系统暂停服务的公告	规定报刊、网站	2026-01-09
2	长江证券（上海）资产管理有限公司关于设立审计委员会并撤销监事的公告	规定报刊、网站	2026-01-13
3	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票及相关风险提示的公告	规定报刊、网站	2026-03-04
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	规定报刊、网站	2026-03-18
5	长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊、网站	2026-03-25
6	长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	规定报刊、网站	2026-05-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260324-20260630	10,001,458.48	-	-	10,001,458.48	62.59%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回、延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项等，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金募集申请的注册文件

- 2、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- 3、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、长江上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为 www.cjzcgl.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司
二〇二六年八月三十一日