

长城上证科创板综合指数型证券投资基金清算报告

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

报告出具日：2026 年 10 月 13 日

报告公告日：2026 年 10 月 23 日

一、重要提示

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号文注册募集，于2025年8月28日成立并正式运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，截至2026年9月18日日终，本基金的基金资产净值已连续50个工作日低于5000万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金进入清算期的公告详见2026年9月19日刊登在长城基金管理有限公司网站（www.ccfund.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《关于长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金合同终止与基金财产清算的公告》。

本基金自2026年9月19日起进入财产清算期，由本基金基金管理人长城基金管理有限公司、本基金基金托管人中国农业银行股份有限公司、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和北京市中盛律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，北京市中盛律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

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
最后运作日基金份额总额	26,788,452.57份
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。

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	
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
最后运作日下属分级基金的份额总额	18,564,877.74 份	8,223,574.83 份

三、 基金运作情况

本基金经中国证监会证监许可[2025]573 号文注册募集，由基金管理人长城基金管理有限公司于 2025 年 8 月 13 日至 2025 年 8 月 26 日向社会公开募集，《基金合同》于 2025 年 8 月 28 日正式生效，募集规模为 564,131,282.18 份基金份额。

自 2025 年 8 月 28 日至 2026 年 9 月 18 日期间，本基金按《基金合同》正常运作。《基金合同》约定“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 50 个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”截至 2026 年 9 月 18 日日终，本基金的基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元，已触发《基金合同》中约定的基金合同终止事由，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会。本基金自 2026 年 9 月 19 日起进入财产清算期。

四、 财务会计报告

基金最后运作日资产负债表（经审计）

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 9 月 18 日

单位：人民币元

最后运作日：2026 年 9 月 18 日	
资产：	
银行存款	3,318,078.09
结算备付金	7,117.90
存出保证金	11,794.84
交易性金融资产	489,342.79
应收申购款	25,906.82
应收证券清算款	35,878,267.48
资产总计	39,730,507.92
负债：	
应付管理人报酬	9,636.29

应付托管费	1,927.26
应付销售服务费	1,662.40
应付赎回款	6,784,788.38
应交税费	21.58
其他负债	20,431.17
负债合计	6,818,467.08
净资产：	
实收基金	26,788,452.57
未分配利润	6,123,588.27
净资产合计	32,912,040.84
负债和净资产总计	39,730,507.92

注：于最后运作日 2026 年 9 月 18 日，基金份额总额 26,788,452.57 份，其中长城上证科创板综合指数 A 基金份额总额 18,564,877.74 份，基金份额净值 1.2296 元；长城上证科创板综合指数 C 基金份额总额 8,223,574.83 份，基金份额净值 1.2263 元。

五、 清算情况

自 2026 年 9 月 19 日至 2026 年 10 月 12 日止为第一次清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。

由于本基金于 2026 年 10 月 12 日（第一次清算结束日）仍持有流通受限资产，导致部分资产尚未变现，故需进行二次清算。本基金将于上述未变现资产全部变现后进入二次清算程序，并将清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用、缴纳税款并清偿债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行二次分配。

具体清算情况如下：

1、 清算费用

按照《长城上证科创板综合指数型证券投资基金合同》第十九部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的规定：清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、 资产处置情况

- （1） 本基金最后运作日银行存款人民币 3,318,078.09 元，储存于基金托管人中国农业银行股份有限公司的活期银行存款人民币 3,316,463.48 元和应计活期银行存款利息人民币 1,614.61 元；
- （2） 本基金最后运作日结算备付金人民币 7,117.90 元。其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的结算备付金本金人民币 7,108.80 元，应计利息人民币 9.10

元；

- (3) 本基金最后运作日存出保证金人民币 11,794.84 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的存出保证金本金人民币 11,760.57 元，应计利息人民币 34.27 元；
- (4) 本基金最后运作日交易性金融资产全部为股票，股票市值为人民币 489,342.79 元，均为未解除限售条件而无法变现的限售股，故需进行二次清算。
- (5) 本基金最后运作日应收申购款人民币 25,906.82 元，为 9 月 17 日提出的产品申购申请，已于 9 月 21 日入账。
- (6) 本基金最后运作日应收证券清算款人民币 35,878,267.48 元，为 9 月 18 日卖出股票的应收款项，已于 9 月 21 日入账。

3、 负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 9,636.29 元，该款项已于 2026 年 9 月 23 日支付。
- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,927.26 元，该款项已于 2026 年 9 月 23 日支付。
- (3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 1,662.40 元，该款项已于 2026 年 9 月 23 日支付。
- (4) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 6,784,788.38 元，该款项已于 2026 年 9 月 21 日-9 月 22 日支付。
- (5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 21.58，该款项已于 2026 年 10 月 8 日支付。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 20,431.17 元，包含应付交易佣金和预提审计费用。其中，应付交易佣金人民币 9,423.16 元，已于 2026 年 9 月 23 日支付；预提审计费为人民币 11,008.01 元，待获取相关凭据后支付。

4、 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日（2026 年 9 月 18 日）基金净资产	32,912,040.84
加：清算期间（2026 年 9 月 19 日至 2026 年 10 月 12 日）净收益	99,509.91
利息收入-银行存款利息收入	4,655.64

利息收入-结算备付金利息收入	1.68
利息收入-存出保证金利息收入	2.33
投资收益	94,850.26
加：清算期间公允价值变动（2026年9月19日至2026年10月12日）	-113,512.82
减：基金净赎回金额（2026年9月21日确认的投资者申请）	12,886,505.88
减：清算期间（2026年9月19日至2026年10月12日）费用	8,055.00
律师费	8,000.00
汇划费	55.00
二、2026年10月12日基金净资产	20,003,477.05
三、第一次清算划付金额	19,700,000.00

注1：第一次清算款划付金额以截至第一次清算结束日已变现情况为基准划付。

注2：根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。由于本基金截至第一次清算期结束日（2026年10月12日）持有流通受限股票（具体明细如下），本基金将于所持有的流通受限股票变现完成后进行基金财产的二次清算，二次清算将以实现变现金额并扣除相关费用后的金额为准，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

第一次清算结束日（2026年10月12日）本基金所持有的流通受限股票金额为人民币87,084.76元，具体明细如下：

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	股票数量 （股）	估值价格 （每股）	第一次清算结束日 估值金额	备注
1	603293	埃泰克	15.00	34.28	514.20	首发流通受限
2	603407	长裕集团	53.00	48.99	2,596.47	首发流通受限
3	603435	嘉德利	36.00	40.41	1,454.76	首发流通受限
4	688635	长进光子	30.00	209.62	6,288.60	首发流通受限
5	688781	视涯科技	792.00	37.74	29,890.08	首发流通受限
6	688808	联讯仪器	28.00	1,244.47	34,845.16	首发流通受限
7	688820	盛合晶微	113.00	101.73	11,495.49	首发流通受限
合计					87,084.76	

注：上表中“第一次清算结束日估值金额”项可能与实际变现金额不符，以实际变现金额为准。

5、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、 备查文件

1、备查文件目录

(1) 长城上证科创板综合指数型证券投资基金清算审计报告

(2) 北京市中盛律师事务所关于《长城上证科创板综合指数型证券投资基金清算报告》的法律意见

2、存放地点

基金管理人的办公场所：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

存放网址：www.ccfund.com.cn

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

长城上证科创板综合指数型证券投资基金基金财产清算小组

2026年10月23日