

国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

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。本中期报告已经全体独立董事签字同意。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月18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	6
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53

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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	55
10.8 其他重大事件	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联恒生港股通科技ETF
场内简称	恒生港股通科技ETF国联
基金主代码	159015
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2026年04月22日
基金管理人	国联基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	116,352,934.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2026年05月08日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略 2、存托凭证投资策略 3、债券投资策略 4、可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、股指期货投资策略 7、国债期货投资策略 8、股票期权投资策略 9、信用衍生品投资策略 10、融资交易策略 11、参与转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	恒生港股通科技主题指数收益率

风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，将面临汇率风险和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		国联基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健	帅芳
	联系电话	010-56517000	021-38677947
	电子邮箱	caojian@glfund.com	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-160-6000；010-56517299	021-38917599-5
传真		010-56517001	021-50872603
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		100011	200041
法定代表人		王瑶	朱健

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.glfund.com
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年04月22日（基金合同生效日） - 2026年06月30日）
本期已实现收益	-2,232,221.63
本期利润	-15,779,247.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0851
本期加权平均净值利润率	-8.81%
本期基金份额净值增长率	-11.34%
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	-13,195,873.63
期末可供分配基金份额利润	-0.1134
期末基金资产净值	103,157,060.37
期末基金份额净值	0.8866
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	-11.34%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

价值变动收益；

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

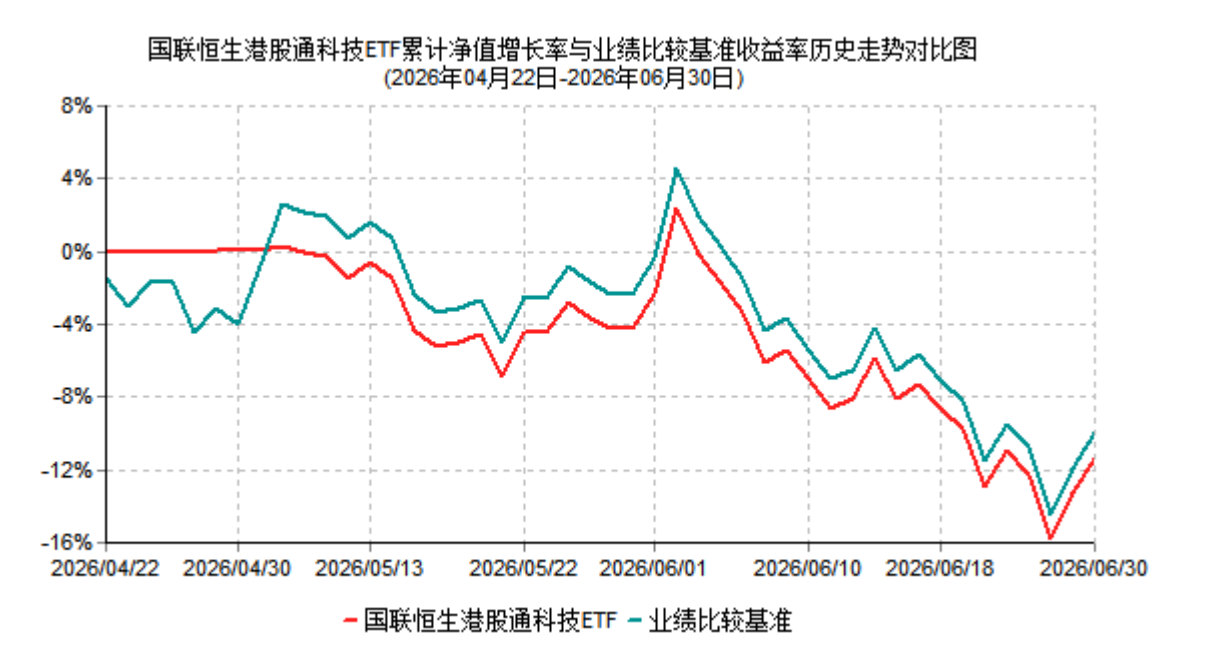
4、本基金合同生效日为2026年04月22日，本报告期为2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日。

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

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
自基金合同生效起至今	-11.34%	1.79%	-9.93%	2.07%	-1.41%	-0.28%

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



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，截至本报告期末仍在建仓期内，基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

§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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联民生证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2026年6月30日，国联基金管理有限公司共管理94只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基

金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金、国联沪深300指数增强型证券投资基金、国联稳健增益债券型证券投资基金、国联上证科创板综合指数增强型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联稳健添益债券型证券投资基金、国联中证800指数增强型证券投资基金、国联价值均衡混合型证券投资基金、国联稳健鑫益债券型证券投资基金、国联多元配置3个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联金如意3个月滚动持有债券型证券投资基金、国联汇富债券型证券投资基金、国联昭元债券型证券投资基金、国联创业板综合指数增强型证券投资基金、国联周期优选混合型发起式证券投资基金、国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈薪羽	国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基	2026-04-22	-	10	陈薪羽先生，中国国籍，毕业于北京大学概率论与数理统计专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限10年。2015年8月至2016年10月任中国人保寿险首席投资官秘书。2016年10月加入公司，现任多

	金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联中证500指数增强型证券投资基金、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金、国联中证A50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。				策略投资部基金经理。
梁勤之	国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联竞争优势股票	2026-04-22	-	10	梁勤之先生，中国国籍，毕业于香港中文大学金融学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限10年。2015年8月至2016年6月任懋業有限公司投资研究部投资分析师；2016年7月至2017年11月任香港大和资本市场有限公司

	型证券投资基金、国联中证港股通综合指数增强型证券投资基金、国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。				股票研究部研究助理；2017年12月至2020年12月任华商基金管理有限公司研究发展部研究员；2020年12月至2023年9月任中信证券股份有限公司权益投资部研究员。2023年10月加入公司，现任权益投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；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）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

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。

报告期内未出现涉及本基金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5%的情况。

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，恒生港股通科技下跌17.23%，本基金作为一只投资于恒生港股通科技指数的被动型产品，我们采取完全复制的被动投资策略，运用智能指数投资系统进行精细化管理，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，严格控制本基金的跟踪偏离度和跟踪误差，给投资者提供一个标准化的恒生港股通科技指数的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联恒生港股通科技ETF基金份额净值为0.8866元，本报告期内，基金份额净值增长率为-11.34%，同期业绩比较基准收益率为-9.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年A股整体震荡上行，呈现结构性“K型”分化，赚钱效应延续但趋势性明显减弱。宏观上来看，一季度GDP同比5.0%实现"开门红"，二季度回落至4.3%，受地产拖累，整体内需偏弱，CPI低位徘徊、制造业PMI在荣枯线附近波动。价格端则出现了积极信号，PPI受油价与"反内卷"推动年中由负转正、上行至接近4%，平减指数回升结束过去三年低物价状态，名义GDP增速回升至6%以上。全年实际GDP增速预计约4.7%左右，处于两会4.5%-5.0%目标区间。

上半年货币政策偏宽松，财政政策主要在内需上发力，出口在全球制造业周期回升与AI资本开支驱动下保持着一定韧性，A股企业盈利增速自年初低位回升，基本面进入“盈利消化估值”阶段。

上半年虽然增量资金持续入市，但权益市场却结构性分化异常显著，公募基金在科技与成长板块超权重配置现象逐步扩大，交易拥挤度的提升蕴含着部分估值溢价风险。展望2026年下半年，市场整体风险溢价并未触及高位，以AI为主线的宏大叙事与高景气度仍未结束，居民存款搬家、险资与公募发行回暖支撑起增量资金韧性，但边际上来看，赚估值的钱或将逐步切换为赚盈利的钱。

板块配置上，高景气方向继续关注AI算力与半导体国产链，周期端中关注煤炭、生猪与肉牛、航运等供需改善机会，同时用有色、化工及出海制造把握价格上行与外需弹性，低估值层面则跟踪港股通中的创新药与互联网平台。

本基金将积极应对各种因素对指数跟踪效果带来的冲击，努力将跟踪误差控制在基金合同规定的范围内，力争使投资者充分获得指数的长期收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在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

本托管人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，认为其真实、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：国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金
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	2,749,949.05
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	101,327,046.77
其中：股票投资		101,327,046.77
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		6,704,160.26
应收股利		233,814.96
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	65,454.63
资产总计		111,080,425.67
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		-
应付管理人报酬		51,410.44
应付托管费		10,282.11
应付销售服务费		-
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	7,861,672.75
负债合计		7,923,365.30
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	116,352,934.00
未分配利润	6.4.7.8	-13,195,873.63
净资产合计		103,157,060.37
负债和净资产总计		111,080,425.67

注：1、报告截止日2026年06月30日，基金份额总额116,352,934.00份，份额净值0.8866元。

2、本基金合同于2026年04月22日生效，本期财务报表的实际编制期间为2026年04月22日(基金合同生效日)至2026年06月30日，本报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年04月22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04月22日（基金合同 生效日）至2026年06月30
-----	-----	---

		日
一、营业总收入		-15,514,545.73
1.利息收入		140,204.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	140,204.71
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）		-3,019,317.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,604,157.58
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	18,164.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	566,676.25
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,547,025.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	911,592.04
减：二、营业总支出		264,701.30
1.管理人报酬		170,445.03
2.托管费		34,089.05
3.销售服务费		-
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	6.4.7.19	-
7.税金及附加		35.35
8.其他费用	6.4.7.20	60,131.87

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,779,247.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,779,247.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-15,779,247.03

注：本基金合同于2026年04月22日生效，本期财务报表的实际编制期间为2026年04月22日(基金合同生效日)至2026年06月30日，本报表及报表附注均无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年04月22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04月22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	255,352,934.00	-	255,352,934.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-139,000,000.00	-13,195,873.63	-152,195,873.63
（一）、综合收益总额	-	-15,779,247.03	-15,779,247.03
（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）	-139,000,000.00	2,583,373.40	-136,416,626.60
其中：1.基金申购款	50,000,000.00	-3,043,962.78	46,956,037.22
2.基金赎回	-189,000,000.00	5,627,336.18	-183,372,663.82

款			
（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	116,352,934.00	-13,195,873.63	103,157,060.37

注：本基金合同于2026年04月22日生效，本期财务报表的实际编制期间为2026年04月22日(基金合同生效日)至2026年06月30日，本报表及报表附注均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：

王瑶	周妹云	李克
-----	-----	-----
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

国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金（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[2026]397号《关于准予国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》批准，由国联基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》("基金合同")负责公开募集，于2026年4月22日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

本基金募集期为2026年4月13日至2026年4月17日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币255,354,145.81元，折合255,352,934.00份“国联恒生港股通科技ETF”基金份额。有效认购户数为2203户。其中，“国联恒生港股通科技ETF”已收到网上现金认购有效认购金额为人民币255,338,000.00元，折合255,338,000.00份“国联恒生港股通科技ETF”基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币16,145.81元，折合14,934.00份“国联恒生港股通科技ETF”基金份额（利息折算的基金份额保留至整数为，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产）。“国联恒生港股通科技ETF”网下现金认购有效认购金额为人民币零元，折合零份“国联恒生港股通科技ETF”基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币零元，折合零份“国联恒生港

股通科技ETF”基金份额（利息折算的基金份额保留至整数为，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产）。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金的标的指数为：恒生港股通科技主题指数。本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于部分非成份股（包含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、其他港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、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、股票期权、信用衍生品以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准为：恒生港股通科技主题指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年4月22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基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为2026年04月22日(基金合同生效日)至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

① 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

1) 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

② 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值；

(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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

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

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费（若有）等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 除本合同另有约定的情况外，本基金收益分配采取现金分红方式；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价,收益评价日核定的基金净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时,基金管理人可进行收益分配;

(5) 当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时,基于本基金的特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时,本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(6) 在符合上述基金分红条件的前提下,本基金可每月进行收益分配。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规定公告;

(7) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 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,本基金确定以下股票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,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令826号文《中华人民共和国增值税法实施条例》、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[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号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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号文《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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

自2026年1月1日至2027年12月31日，对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；

自2026年1月1日至2027年12月31日，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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、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。

3、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，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	368,227.13
等于：本金	368,084.65
加：应计利息	142.48
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	2,381,721.92
等于：本金	2,381,666.21
加：应计利息	55.71
减：坏账准备	-
合计	2,749,949.05

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易资金账户中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		114,874,072.17	-	101,327,046.77	-13,547,025.40
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		114,874,072.17	-	101,327,046.77	-13,547,025.40

注：股票投资的公允价值和股票投资的估值增值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	65,454.63
合计	65,454.63

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	33,494.06
应付ETF清算款	7,828,178.69
合计	7,861,672.75

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22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	255,352,934.00	255,352,934.00
本期申购	50,000,000.00	50,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-189,000,000.00	-189,000,000.00
本期末	116,352,934.00	116,352,934.00

注：本基金于2026年4月13日至2026年4月17日向社会公开募集，截至2026年4月22日（基金合同生效日）止，本基金共募集有效净认购资金255,338,000.00元，折合255,338,000.00份国联恒生港股通科技ETF基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币16,145.81元，折合14,934.00份国联恒生港股通科技ETF基金份额（利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产），以上收到的实收基金共计人民币255,354,145.81元，折合255,352,934.00份国联恒生港股通科技ETF基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

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
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,232,221.63	-13,547,025.40	-15,779,247.03
本期基金份额交易产生的变动数	363,144.92	2,220,228.48	2,583,373.40
其中：基金申购款	-66,602.13	-2,977,360.65	-3,043,962.78
基金赎回款	429,747.05	5,197,589.13	5,627,336.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,869,076.71	-11,326,796.92	-13,195,873.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	136,500.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,492.15
结算备付金利息收入	-
其他	1,211.81
合计	140,204.71

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,604,157.58
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	-3,604,157.58

6.4.7.10.2 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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	121,201,832.04
减：卖出股票成本总额	124,306,897.62
减：交易费用	499,092.00
买卖股票差价收入	-3,604,157.58

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
债券投资收益——利息收入	9,819.26
债券投资收益——买卖债券（债转股 及债券到期兑付）差价收入	8,344.99
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	18,164.25

6.4.7.12.2 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04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	39,827,438.20
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	39,631,783.00
减：应计利息总额	184,921.20
减：交易费用	2,389.01
买卖债券差价收入	8,344.99

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22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	566,676.25
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	566,676.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-13,547,025.40
——股票投资	-13,547,025.40
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-13,547,025.40

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	911,592.04
合计	911,592.04

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	5,732.30
信息披露费	24,803.10
证券出借违约金	-
固定注册登记费	24,545.37
开户费	400.00
其他	2,958.66
深港通_证券组合费	1,692.44
合计	60,131.87

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联民生证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
民生证券股份有限公司	基金管理人股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年04月22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
民生证券股份有限 公司	360,382,801.83	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年04月22日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
民生证券股份有限公司	79,274,300.00	100.00%

6.4.10.1.4 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04月22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
民生证券股份有限公司	92,485.17	100.00%	-	-

注：上述佣金计算符合监管部门对于公募基金佣金的相关规定。关联方为本产品提供证券交易以及研究服务（如有）。

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04月22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	170,445.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,938.34

应支付基金管理人的净管理费	141,506.69
---------------	------------

注：① 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%/当年天数；

② 客户维护费是指基金管理人 与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月22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	34,089.05

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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04月22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

国泰海通 证券股份 有限公司	368,227.13	136,500.75
民生证券 股份有限 公司-券商 保证金	2,381,666.21	2,492.15

注：（1）本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。
（2）本基金证券户的存款由民生证券股份有限公司保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：无。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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涉及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。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

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的发行人出现违约、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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示。如无表格，则本基金于本期末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12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6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不

计息，可赎回基金份额净值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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。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0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资 金	2,749,949.05	-	-	-	2,749,949.05
交易性 金融资 产	-	-	-	101,327,046.77	101,327,046.77
应收清 算款	-	-	-	6,704,160.26	6,704,160.26
应收股 利	-	-	-	233,814.96	233,814.96
其他资 产	-	-	-	65,454.63	65,454.63
资产总 计	2,749,949.05	-	-	108,330,476.62	111,080,425.67
负债					
应付管	-	-	-	51,410.44	51,410.44

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	10,282.11	10,282.11
其他负债	-	-	-	7,861,672.75	7,861,672.75
负债总计	-	-	-	7,923,365.30	7,923,365.30
利率敏感度缺口	2,749,949.05	-	-	100,407,111.32	103,157,060.37

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注： 利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	101,327,046.77	-	101,327,046.77
应收股利	126,405.0	87,201.96	-	213,606.96

	0			
资产合计	126,405.00	101,414,248.73	-	101,540,653.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	126,405.00	101,414,248.73	-	101,540,653.73

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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06月30日	
	所有外币均相对人民币升值5%	5,077,032.69	
	所有外币均相对人民币贬值5%	-5,077,032.69	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

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	101,327,046.77	98.23

资		
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	101,327,046.77	98.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察沪深300指数变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；	
	2、假定沪深300指数变化5%，其他市场变量不变；	
	3、Beta系数是根据组合在过去一年的净值数据和沪深300指数数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。	
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
	沪深300指数上升5%	4,643,985.23
	沪深300指数下降5%	-4,643,985.23

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。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，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是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	101,327,046.77
第二层次	-
第三层次	-
合计	101,327,046.77

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	101,327,046.77	91.22
	其中：股票	101,327,046.77	91.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,749,949.05	2.48
8	其他各项资产	7,003,429.85	6.30
9	合计	111,080,425.67	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为101,327,046.77元，占净值比例98.23%。

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

注：本基金本报告期末未持有指数投资境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

非日常生活消费品	22,346,093.48	21.66
日常消费品	480,490.55	0.47
金融	255,145.25	0.25
工业	2,138,821.75	2.07
信息技术	50,699,691.11	49.15
通讯业务	25,406,804.63	24.63
合计	101,327,046.77	98.23

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	42,100	15,716,047.46	15.24
2	09988	阿里巴巴-W	154,700	12,475,761.00	12.09
3	01810	小米集团-W	541,800	10,183,359.64	9.87
4	03690	美团-W	165,900	9,870,332.48	9.57
5	00981	中芯国际	125,500	9,744,870.44	9.45
6	01347	华虹宏力	41,000	7,663,390.36	7.43
7	00992	联想集团	348,000	6,957,919.31	6.74
8	01024	快手-W	155,400	5,614,863.07	5.44
9	00522	ASMPT	17,100	3,546,706.55	3.44
10	09660	地平线机器人-W	598,200	2,119,831.77	2.05
11	00020	商汤-W	1,752,000	2,039,077.46	1.98
12	02382	舜宇光学科技	35,800	1,896,739.49	1.84
13	09626	哔哩哔哩-W	16,260	1,859,949.45	1.80
14	09880	优必选	17,700	1,580,378.84	1.53
15	02018	瑞声科技	39,000	1,446,396.32	1.40

16	03888	金山软件	53,000	1,021,015.27	0.99
17	02577	英诺赛科	16,100	904,742.48	0.88
18	00268	金蝶国际	154,000	791,839.66	0.77
19	00763	中兴通讯	38,600	765,734.53	0.74
20	00285	比亚迪电子	40,500	735,887.67	0.71
21	01357	美图公司	186,500	607,442.16	0.59
22	02400	心动公司	15,200	587,487.22	0.57
23	06088	FITHONTE NG	94,000	580,486.71	0.56
24	03896	金山云	140,000	564,210.08	0.55
25	01729	汇聚科技	38,000	558,442.91	0.54
26	01797	东方甄选	24,500	480,490.55	0.47
27	00303	VTECHHOL DINGS	8,500	379,838.63	0.37
28	01415	高伟电子	16,000	326,018.93	0.32
29	09636	九方智投控 股	9,600	255,145.25	0.25
30	01384	滴普科技	1,600	52,641.08	0.05

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

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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	09988	阿里巴巴-W	36,331,946.71	35.22
2	00700	腾讯控股	33,350,484.81	32.33
3	01810	小米集团-W	29,851,171.41	28.94
4	03690	美团-W	24,763,583.45	24.01

5	00981	中芯国际	17,090,705.84	16.57
6	01024	快手-W	12,333,719.71	11.96
7	01347	华虹宏力	11,182,405.97	10.84
8	00992	联想集团	8,635,634.97	8.37
9	09660	地平线机器人-W	8,444,992.75	8.19
10	00522	ASMPT	8,003,113.74	7.76
11	00020	商汤-W	7,120,242.87	6.90
12	09626	哔哩哔哩-W	5,631,702.27	5.46
13	02382	舜宇光学科技	4,730,894.12	4.59
14	09880	优必选	3,883,424.59	3.76
15	02018	瑞声科技	2,901,680.10	2.81
16	00268	金蝶国际	2,715,115.21	2.63
17	03888	金山软件	2,570,720.57	2.49
18	03896	金山云	2,275,577.94	2.21
19	00285	比亚迪电子	2,244,802.39	2.18
20	00763	中兴通讯	2,150,996.29	2.09

注：“买入金额”按买入成交金额（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	09988	阿里巴巴-W	15,970,100.38	15.48
2	00700	腾讯控股	15,210,457.35	14.74
3	01810	小米集团-W	13,982,271.23	13.55
4	03690	美团-W	12,085,685.82	11.72
5	00981	中芯国际	8,839,091.89	8.57
6	00992	联想集团	8,161,597.36	7.91
7	01347	华虹宏力	6,434,106.40	6.24

8	01024	快手-W	5,777,937.01	5.60
9	00522	ASMPT	5,527,045.11	5.36
10	09660	地平线机器人-W	3,581,248.84	3.47
11	00020	商汤-W	3,250,347.47	3.15
12	02382	舜宇光学科技	2,958,929.19	2.87
13	09626	哔哩哔哩-W	2,642,781.42	2.56
14	09880	优必选	2,187,265.09	2.12
15	02018	瑞声科技	1,844,775.82	1.79
16	00268	金蝶国际	1,362,280.62	1.32
17	03888	金山软件	1,345,988.77	1.30
18	00285	比亚迪电子	1,228,895.62	1.19
19	00763	中兴通讯	1,178,772.13	1.14
20	02577	英诺赛科	1,093,927.25	1.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	239,180,969.79
卖出股票收入（成交）总额	121,201,832.04

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者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未超过基金合同规定的备选股票库。

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	6,704,160.26
3	应收股利	233,814.96
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	65,454.63
8	其他	-
9	合计	7,003,429.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有积极股票投资。

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，各比例的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

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
1,906	61,045.61	14,896,256.00	12.80%	101,456,678.00	87.20%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

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

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2026年04月22日)基金份额总额	255,352,934.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	50,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	189,000,000.00
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	116,352,934.00

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营以及涉及基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

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上会会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

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

注：本报告期内管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民生证券	6	360,382,801.83	100.00%	92,485.17	100.00%	新增5个交易单元。

注：①根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等法规及监管要求，公司制定了选择券商的标准，即为：

- 1、财务状况良好；
- 2、经营行为规范；
- 3、合规风控能力和交易能力较强；
- 4、研究能力较强，可为公司提供需要的研究支持。研究能力包括但不限于：
 - （1）有较强的宏观及行业研究能力。能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并进行路演、培训等。
 - （2）有较强的数据资源提供能力。拥有丰富的数据库资源，能够及时准确地为公司提供国内外宏观经济、政策、行业、公司等各层面的学术文献、研究报告、信息资讯、数据资源等。
 - （3）有提供特色定制服务的能力。能够根据不同类型基金投资的特点，提供专门的定制研究和定制服务（如专题研究、专题会议、专题路演、专题研讨等）。

②券商专用交易单元选择程序：

- 1、对提供服务的券商按照上述标准进行遴选及审批，确定合作券商；

- 2、本基金管理人与合作券商签订相关协议。
- ③本基金合同于2026年04月22日 生效，以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
民生证券	79,274,300.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-23
2	国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-30
3	国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-30
4	国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-05-08
5	关于国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-05-08
6	国联基金管理有限公司关于国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基	中国证监会指定报刊及网站	2026-05-23

	金暂停申购及赎回业务的公告		
7	国联基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-27
8	国联基金管理有限公司关于国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金暂停申购及赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-30

§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：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资 基金募集注册的文件
- （二）《国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- （三）《国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- （四）关于申请募集注册国联恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资 基金的法律意见
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日