

嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	60
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实上证科创板综合 ETF
场内简称	科综嘉实（扩位证券简称：科创综指 ETF 嘉实）
基金主代码	589300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 9 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,582,547.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 17 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		嘉实基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	潘琦
	联系电话	(010)65215588	0755-22168257
	电子邮箱	service@jsfund.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95511-3
传真		(010)65215588	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	广东省深圳市罗湖区深南东路

	家嘴环路 1318 号 1806A 单元	5047 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	100020	518001
法定代表人	经雷	谢永林

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	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	19,205,840.67
本期利润	38,525,871.70
加权平均基金份额本期利润	0.6805
本期加权平均净值利润率	41.79%
本期基金份额净值增长率	54.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,043,666.81
期末可供分配基金份额利润	0.7466
期末基金资产净值	91,193,485.76
期末基金份额净值	2.1931
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	119.89%

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

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

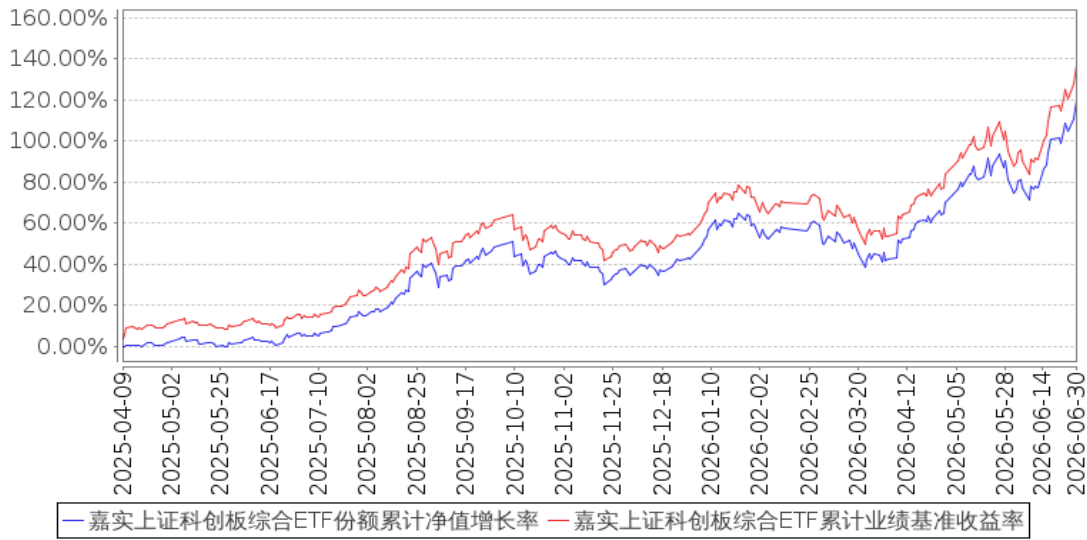
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	55.83%	2.33%	55.71%	2.36%	0.12%	-0.03%
过去六个月	54.37%	2.20%	53.99%	2.23%	0.38%	-0.03%
过去一年	106.14%	1.94%	104.94%	1.96%	1.20%	-0.02%
自基金合同生效起至今	119.89%	1.80%	137.34%	1.83%	-17.45%	-0.03%

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

嘉实上证科创板综合ETF份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2025年04月09日至2026年06月30日)



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 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、

北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、不动产基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚可	本基金、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实创业板增强策略 ETF、嘉实中证 A50ETF、嘉实中证 A50ETF 联接、嘉实上证综合增强策略 ETF、嘉实国证自由现金流 ETF、嘉实中证诚通国企数字经济 ETF、嘉实上证科创板综合 ETF 联接、嘉实上证科创	2025 年 4 月 9 日	-	6 年	2020 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部任研究员。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	板综合增强策略ETF、嘉实国证自由现金流ETF联接、嘉实上证科创板人工智能ETF发起联接、嘉实上证科创板200ETF基金经理				
--	--	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 3 次，其中 2 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交

易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪上证科创板综合指数，上证科创板综合指数由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，反映科创板上市公司证券包括分红收益的整体表现。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地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2026 年上半年，中国经济延续“稳中向新”态势。生产端工业保持韧性，高技术产业与装备制造业表现亮眼，AI 产业链带动效应持续，新质生产力加快培育。需求端投资结构持续优化，基建托底发力，消费稳步释放，出口发挥稳定锚作用。价格端积极变化增多，物价温和回升，企业盈利预期修复。服务业贡献提升，制造业高端化智能化升级明确。政策协同精准有力，总体运行在合理区间。美国上半年经济呈现“前高后低”格局。通胀粘性取代回落预期成为核心矛盾，核心物价持续处于高位。美联储新任主席释放鹰派信号，市场对政策路径的预期在降息、观望与加息之间反复摇摆；中东地缘冲突推升能源价格，进一步加剧通胀压力。欧元区上半年受能源冲击叠加内需疲软，制造业景气持续低迷，通胀快速反弹，欧洲央行在压力下近三年首次加息，成为本轮全球紧缩周期中率先行动的主要央行，利率与增长的两难困境进一步加剧。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.03%，年化跟踪误差为 0.70%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00% 的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.1931 元；本报告期基金份额净值增长率为 54.37%，业绩比较基准收益率为 53.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望在“结构分化”中走向“盈利修复”。外需与高技术制造保持韧性的同时，下半年财政支出有望加快落地，货币政策维持适度宽松，为内需回暖提供支撑。产业层面，AI 算力、半导体、高端装备等硬科技赛道受益全球产业周期上行和自主可控，业绩可见度持续提升。权益市场或将从“估值扩张”驱动切换至“业绩验证”驱动。风险上仍需关注海外加息预期扰动与贸易摩擦升温对外需和风险偏好的阶段性冲击。

本基金作为一只投资于上证科创板综合指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，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，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的上证科创板综合指数的投资工具。

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	754,995.94	1,088,786.93
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	90,522,659.90	109,565,927.96
其中：股票投资		90,494,220.97	109,534,343.77
基金投资		-	-
债券投资		28,438.93	31,584.19
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		91,277,655.84	110,654,714.89
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,225.99	12,570.32
应付托管费		3,408.68	4,190.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	70,535.40	127,726.00
负债合计		84,170.08	144,486.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	41,582,547.00	77,582,547.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	49,610,938.76	32,927,681.48
净资产合计		91,193,485.76	110,510,228.48
负债和净资产总计		91,277,655.84	110,654,714.89

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1931 元，基金份额总额 41,582,547.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 9 日（基金合 同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		38,685,865.18	15,305,023.36
1. 利息收入		777.03	42,190.57
其中：存款利息收入	6.4.7.13	777.03	42,190.57
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）		19,382,882.12	9,273,001.04
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,189,321.31	8,970,543.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	45,978.03	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	147,582.78	302,457.63
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	19,320,031.03	6,001,904.16
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以 “-” 号填列)	6. 4. 7. 21	-17,825.00	-12,072.41
减：二、营业总支出		159,993.48	114,010.14
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	68,647.45	53,072.78
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	22,882.45	17,690.92
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. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	68,463.58	43,246.44
三、利润总额 (亏损总额以 “-” 号填列)		38,525,871.70	15,191,013.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 “-” 号填列)		38,525,871.70	15,191,013.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,525,871.70	15,191,013.22

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	77,582,547.00	-	32,927,681.48	110,510,228.48
二、本期期初净资产	77,582,547.00	-	32,927,681.48	110,510,228.48
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-36,000,000.00	-	16,683,257.28	-19,316,742.72
(一)、综合收益总额	-	-	38,525,871.70	38,525,871.70
(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)	-36,000,000.00	-	-21,600,767.72	-57,600,767.72

其中：1. 基金申购款	20,000,000.00	-	13,234,632.66	33,234,632.66
2. 基金赎回款	-56,000,000.00	-	-34,835,400.38	-90,835,400.38
（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）	-	-	-241,846.70	-241,846.70
四、本期期末净资产	41,582,547.00	-	49,610,938.76	91,193,485.76
项目	上年度可比期间 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	445,582,547.00	-	-	445,582,547.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-316,000,000.00	-	8,640,893.77	-307,359,106.23
（一）、综合收益总额	-	-	15,191,013.22	15,191,013.22
（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）	-316,000,000.00	-	-6,550,119.45	-322,550,119.45
其中：1. 基金申购款	140,000,000.00	-	3,063,006.32	143,063,006.32
2. 基金赎回款	-456,000,000.00	-	-9,613,125.77	-465,613,125.77
（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	129,582,547.00	-	8,640,893.77	138,223,440.77

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：

经雷梁凯李袁

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

嘉实上证科创板综合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[2025]218号《关于准予嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2025年4月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为445,582,547.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《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[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》、财税[2023]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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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 6 月 30 日
活期存款	87,482.80
等于：本金	87,475.13
加：应计利息	7.67
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	667,513.14
等于：本金	667,491.90
加：应计利息	21.24
减：坏账准备	-
合计	754,995.94

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	56,746,774.33	-	90,494,220.97	33,747,446.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	25,000.00	1.53	28,438.93	3,437.40
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	25,000.00	1.53	28,438.93	3,437.40
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		56,771,774.33	1.53	90,522,659.90	33,750,884.04

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	68,434.29
其他	2,101.11
合计	70,535.40

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,582,547.00	77,582,547.00
本期申购	20,000,000.00	20,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-56,000,000.00	-56,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	41,582,547.00	41,582,547.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,485,325.17	2,442,356.31	32,927,681.48
本期期初	30,485,325.17	2,442,356.31	32,927,681.48
本期利润	19,205,840.67	19,320,031.03	38,525,871.70
本期基金份额交易产生的变动数	-18,405,652.33	-3,195,115.39	-21,600,767.72
其中：基金申购款	10,780,042.87	2,454,589.79	13,234,632.66
基金赎回款	-29,185,695.20	-5,649,705.18	-34,835,400.38
本期已分配利润	-241,846.70	-	-241,846.70
本期末	31,043,666.81	18,567,271.95	49,610,938.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	353.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	423.71
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	777.03

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,016,758.96
股票投资收益——赎回差价收入	16,172,562.35
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	19,189,321.31

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,372,636.78
减：卖出股票成本总额	8,344,343.01
减：交易费用	11,534.81

买卖股票差价收入	3,016,758.96
----------	--------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	90,835,400.38
减：现金支付赎回款总额	113,987.22
减：赎回股票成本总额	74,548,850.81
减：交易费用	-
赎回差价收入	16,172,562.35

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	6.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	45,971.34
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	45,978.03

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	285,551.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	238,907.49
减：应计利息总额	661.50
减：交易费用	11.46
买卖债券差价收入	45,971.34

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	147,582.78
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	147,582.78
----	------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	19,320,031.03
股票投资	19,321,176.83
债券投资	-1,145.80
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	19,320,031.03

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-17,825.00
合计	-17,825.00

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	8,926.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	29.29
合计	68,463.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 7 月 14 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0260 元。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实上证科创板综合 ETF 联接”）	本基金的联接基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	68,647.45	53,072.78

其中：应支付销售机构的客户维护费	5,050.66	9,484.03
应支付基金管理人的净管理费	63,596.79	43,588.75

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 0.15% 的年费率计提，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 × 0.15% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,882.45	17,690.92

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，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 × 0.05% / 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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

嘉实上证科创板综合ETF联接	27,051,000.00	65.05	49,990,700.00	64.44
----------------	---------------	-------	---------------	-------

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司_活期	87,482.80	353.32	811,040.48	38,201.13

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资 形式 发放总 额	本期利润分 配合计	备注
		场内	场外					
1	2026年 01月16 日	-	2026年 1月19 日	0.0190	109,406.84	-	109,406.84	-
2	2026年 04月15 日	-	2026年 4月16 日	0.0230	132,439.86	-	132,439.86	-
合计	-	-	-	0.0420	241,846.70	-	241,846.70	-

注：根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至2026年7月14日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每10份基金份额派发红利0.0260元。

6.4.12 期末（2026年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	额	
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	94	1,050.92	1,653.46	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股锁定	33.49	33.93	17	569.33	576.81	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股锁定	21.88	25.52	34	743.92	867.68	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股锁定	13.86	73.46	62	859.32	4,554.52	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股锁定	15.76	46.71	43	677.68	2,008.53	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股锁定	17.70	84.32	60	1,062.00	5,059.20	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定	40.98	308.19	42	1,721.16	12,943.98	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股锁定	17.52	35.92	417	7,305.84	14,978.64	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股锁定	22.68	42.16	905	20,525.40	38,154.80	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定	92.18	463.15	26	2,396.68	12,041.90	-
688790	昂	2025	9个月	新股	83.06	126.45	290	24,087.40	36,670.50	-

	瑞微	年 12 月 9 日		锁定						
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	345	39,426.60	233,544.30	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	24	1,965.12	38,023.92	-
688811	有研新材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	293	1,878.13	7,070.09	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	75	1,971.00	12,906.75	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	127	2,499.36	17,969.23	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118069	爱科转债	2026 年 6 月 12 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.09	-
118070	南芯转债	2026 年 6 月 22 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	90	9,000.00	9,000.51	-
118071	华峰转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.07	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 25 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.15	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项停牌	832.00	2026年7月13日	890.99	1,548	492,553.22	1,287,936.00	-
688260	昀冢科技	2026年6月26日	重大事项停牌	144.00	2026年7月1日	132.00	811	19,741.54	116,784.00	-
688121	卓然股份	2026年5月6日	重大事项停牌	6.48	2026年7月7日	5.18	883	10,954.94	5,721.84	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会合规与风险控制委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	28,438.93	31,584.19
未评级	—	—
合计	28,438.93	31,584.19

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	754,995.94	-	-	-	754,995.94
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	28,438.93	90,494,220.97	90,522,659.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	754,995.94	-	28,438.93	90,494,220.97	91,277,655.84
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
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	-	-	-	10,225.99	10,225.99
应付托管费	-	-	-	3,408.68	3,408.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	0.01	0.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	70,535.40	70,535.40
负债总计	-	-	-	84,170.08	84,170.08
利率敏感度缺口	754,995.94	-	28,438.93	90,410,050.89	91,193,485.76
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,088,786.93	-	-	-	1,088,786.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	31,584.19	109,534,343.77	109,565,927.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,088,786.93	-	31,584.19	109,534,343.77	110,654,714.89
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
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	-	-	-	12,570.32	12,570.32
应付托管费	-	-	-	4,190.09	4,190.09
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	-	-	-	127,726.00	127,726.00
负债总计	-	-	-	144,486.41	144,486.41
利率敏感度缺口	1,088,786.93	-	31,584.19	109,389,857.36	110,510,228.48

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	423.90	475.51
	市场利率上升 25 个基点	-416.59	-467.24

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，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。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，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，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 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	90,494,220.97	99.23	109,534,343.77	99.12
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	90,494,220.97	99.23	109,534,343.77	99.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	4,505,794.24	5,169,818.63
	业绩比较基准下降 5%	-4,505,794.24	-5,169,818.63

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	88,654,192.93	107,347,882.88
第二层次	1,429,442.66	1,991,584.05
第三层次	439,024.31	226,461.03
合计	90,522,659.90	109,565,927.96

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

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资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	90,494,220.97	99.14
	其中：股票	90,494,220.97	99.14
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	28,438.93	0.03

	其中：债券	28,438.93	0.03
	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	754,995.94	0.83
8	其他各项资产	—	—
9	合计	91,277,655.84	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	73,102,071.36	80.16
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	15,589,004.25	17.09
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	1,310,491.18	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	287,174.17	0.31
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	90,288,740.96	99.01
--	----	---------------	-------

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	205,480.01	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	205,480.01	0.23

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	3,650	5,823,757.50	6.39
2	688041	海光信息	13,859	5,131,987.70	5.63
3	688012	中微公司	5,512	2,582,372.00	2.83
4	688008	澜起科技	6,766	2,096,783.40	2.30
5	688795	摩尔线程	2,823	2,009,006.52	2.20

6	688802	沐曦股份	2,307	1,910,888.10	2.10
7	688981	中芯国际	11,953	1,898,375.46	2.08
8	688498	源杰科技	867	1,635,162.00	1.79
9	688525	佰维存储	2,694	1,332,802.62	1.46
10	688072	拓荆科技	1,548	1,287,936.00	1.41
11	688082	盛美上海	2,792	1,206,144.00	1.32
12	688521	芯原股份	3,084	1,144,595.76	1.26
13	688146	中船特气	3,128	1,094,768.72	1.20
14	688702	盛科通信	2,422	944,555.78	1.04
15	688120	华海清科	2,903	935,288.54	1.03
16	688361	中科飞测	1,994	857,420.00	0.94
17	688347	华虹宏力	2,424	815,191.20	0.89
18	688126	沪硅产业	19,642	783,519.38	0.86
19	688396	华润微	7,846	765,377.30	0.84
20	688172	燕东微	8,507	711,695.62	0.78
21	688249	晶合集成	11,999	708,300.97	0.78
22	688506	百利天恒	2,404	706,848.12	0.78
23	688183	生益电子	4,915	650,746.00	0.71
24	688200	华峰测控	1,188	623,818.80	0.68
25	688766	普冉股份	800	613,280.00	0.67
26	688111	金山办公	2,765	589,083.25	0.65
27	688777	中控技术	4,676	549,430.00	0.60
28	688409	富创精密	1,758	538,387.50	0.59
29	688110	东芯股份	2,608	531,249.60	0.58
30	688469	芯联集成	49,841	528,813.01	0.58
31	688313	仕佳光子	2,794	515,912.10	0.57
32	688519	南亚新材	1,321	502,032.84	0.55
33	688629	华丰科技	2,653	497,464.03	0.55
34	688271	联影医疗	4,863	492,281.49	0.54
35	688037	芯源微	1,109	486,906.45	0.53
36	688234	天岳先进	2,571	446,094.21	0.49
37	688147	微导纳米	2,724	440,961.12	0.48
38	688627	精智达	611	436,865.00	0.48
39	688002	睿创微纳	2,808	434,369.52	0.48
40	688048	长光华芯	845	424,190.00	0.47
41	688019	安集科技	1,222	414,820.12	0.45
42	688017	绿的谐波	990	413,681.40	0.45
43	688141	杰 华 特	2,693	413,375.50	0.45
44	688548	广钢气体	7,795	406,119.50	0.45
45	688630	芯碁微装	738	405,449.82	0.44
46	688387	信科移动	20,395	404,636.80	0.44
47	688036	传音控股	6,801	400,918.95	0.44
48	688585	上纬新材	2,311	383,163.80	0.42

49	688047	龙芯中科	2,382	368,423.94	0.40
50	688375	国博电子	3,515	366,614.50	0.40
51	688027	国盾量子	720	362,887.20	0.40
52	688187	时代电气	5,135	352,569.10	0.39
53	688502	茂莱光学	487	337,783.20	0.37
54	688300	联瑞新材	1,370	334,828.00	0.37
55	688536	思瑞浦	917	333,870.53	0.37
56	688728	格科微	15,501	326,141.04	0.36
57	688549	中巨芯	8,786	323,412.66	0.35
58	688295	中复神鹰	5,319	322,012.26	0.35
59	688775	影石创新	2,314	320,836.10	0.35
60	688322	奥比中光	2,406	314,103.30	0.34
61	688220	翱捷科技	2,500	310,800.00	0.34
62	688025	杰普特	631	296,570.00	0.33
63	688432	有研硅	7,372	294,658.84	0.32
64	688223	晶科能源	61,127	290,353.25	0.32
65	688578	艾力斯	2,627	286,868.40	0.31
66	688411	海博思创	970	282,464.00	0.31
67	688167	炬光科技	793	280,888.53	0.31
68	688336	三生国健	5,285	280,633.50	0.31
69	688331	荣昌生物	2,146	279,537.96	0.31
70	688545	兴福电子	2,094	278,627.64	0.31
71	688668	鼎通科技	741	276,615.30	0.30
72	688213	思特威	2,419	259,002.33	0.28
73	688188	柏楚电子	2,409	257,040.30	0.28
74	688099	晶晨股份	2,470	254,163.00	0.28
75	688009	中国通号	51,199	243,707.24	0.27
76	688122	西部超导	3,839	241,127.59	0.26
77	688472	阿特斯	21,643	234,177.26	0.26
78	688449	联芸科技	2,713	234,159.03	0.26
79	688403	汇成股份	5,841	231,887.70	0.25
80	688052	纳芯微	802	231,224.62	0.25
81	688248	南网科技	3,336	230,784.48	0.25
82	688127	蓝特光学	2,363	230,628.80	0.25
83	688676	金盘科技	2,716	229,882.24	0.25
84	688001	华兴源创	2,662	228,133.40	0.25
85	688362	甬矽电子	2,359	227,407.60	0.25
86	688303	大全能源	12,805	223,191.15	0.24
87	688385	复旦微电	3,118	222,282.22	0.24
88	688102	斯瑞新材	4,568	215,518.24	0.24
89	688538	和辉光电	82,219	213,769.40	0.23
90	688257	新锐股份	2,094	213,378.60	0.23
91	688301	奕瑞科技	1,719	213,156.00	0.23

92	688368	晶丰明源	982	212,622.64	0.23
93	688268	华特气体	775	207,312.50	0.23
94	688433	华曙高科	2,414	206,638.40	0.23
95	688065	凯赛生物	4,261	203,888.85	0.22
96	688568	中科星图	4,766	197,646.02	0.22
97	688599	天合光能	13,965	197,185.80	0.22
98	688507	索辰科技	722	194,708.96	0.21
99	688233	神工股份	901	193,192.42	0.21
100	688195	腾景科技	997	192,002.26	0.21
101	688503	聚和材料	1,420	188,434.00	0.21
102	688123	聚辰股份	883	187,725.80	0.21
103	688235	百济神州	728	185,356.08	0.20
104	688205	德科立	883	183,831.77	0.20
105	688400	凌云光	2,724	180,328.80	0.20
106	688652	京仪装备	888	177,750.96	0.19
107	688266	泽璟制药	1,519	177,206.54	0.19
108	688343	云天励飞	2,115	172,710.90	0.19
109	688372	伟测科技	924	171,864.00	0.19
110	688692	达梦数据	702	171,491.58	0.19
111	688352	硕中科技	7,026	169,888.68	0.19
112	688020	方邦股份	680	169,728.00	0.19
113	688603	天承科技	814	169,271.30	0.19
114	688018	乐鑫科技	1,319	168,726.48	0.19
115	688388	嘉元科技	3,812	167,728.00	0.18
116	688333	铂力特	1,635	167,424.00	0.18
117	688392	骄成超声	735	166,977.30	0.18
118	688097	博众精工	2,639	166,388.95	0.18
119	688535	华海诚科	889	166,243.00	0.18
120	688297	中无人机	3,988	165,701.40	0.18
121	688150	莱特光电	2,392	164,139.04	0.18
122	688515	裕太微	658	163,684.08	0.18
123	689009	九号公司	4,239	161,717.85	0.18
124	688308	欧科亿	887	161,265.47	0.18
125	688778	厦钨新能	2,936	159,718.40	0.18
126	688700	东威科技	1,763	157,612.20	0.17
127	688582	芯动联科	2,373	154,245.00	0.17
128	688380	中微半导	2,331	153,636.21	0.17
129	688757	胜科纳米	2,303	153,610.10	0.17
130	688180	君实生物	4,528	153,136.96	0.17
131	688800	瑞可达	1,590	152,592.30	0.17
132	688318	财富趋势	2,120	151,177.20	0.17
133	688608	恒玄科技	895	149,635.05	0.16
134	688332	中科蓝讯	950	149,625.00	0.16

135	688390	固德威	1,376	149,309.76	0.16
136	688169	石头科技	1,522	144,544.34	0.16
137	688617	惠泰医疗	791	143,613.96	0.16
138	688709	成都华微	3,762	143,294.58	0.16
139	688349	三一重能	9,420	142,995.60	0.16
140	688484	南芯科技	2,505	141,507.45	0.16
141	688584	上海合晶	3,921	140,959.95	0.15
142	688143	长盈通	793	139,472.84	0.15
143	688686	奥普特	824	138,753.36	0.15
144	688059	华锐精密	691	137,999.61	0.15
145	688596	正帆科技	1,738	137,406.28	0.15
146	688003	天准科技	1,064	135,447.20	0.15
147	688383	新益昌	711	133,696.44	0.15
148	688563	航材股份	2,607	133,556.61	0.15
149	688661	和林微纳	831	132,112.38	0.14
150	688531	日联科技	742	131,957.28	0.14
151	688359	三孚新科	662	131,367.28	0.14
152	688106	金宏气体	3,166	131,325.68	0.14
153	688772	珠海冠宇	6,674	131,010.62	0.14
154	688006	杭可科技	3,567	130,373.85	0.14
155	688278	特宝生物	2,383	129,635.20	0.14
156	688005	容百科技	4,223	129,223.80	0.14
157	688028	沃尔德	823	128,281.01	0.14
158	688425	铁建重工	31,730	127,554.60	0.14
159	688819	天能股份	5,744	127,516.80	0.14
160	688625	呈和科技	1,509	127,374.69	0.14
161	688475	萤石网络	4,653	127,259.55	0.14
162	688279	峰岬科技	556	124,788.64	0.14
163	688726	拉普拉斯	2,360	124,726.00	0.14
164	688114	华大智造	2,434	124,328.72	0.14
165	688523	航天环宇	2,348	123,035.20	0.13
166	688662	富信科技	730	122,640.00	0.13
167	688610	埃科光电	464	122,217.60	0.13
168	688559	海目星	1,445	121,264.40	0.13
169	688615	合合信息	1,070	121,017.00	0.13
170	688708	佳驰科技	2,302	116,941.60	0.13
171	688260	昀冢科技	811	116,784.00	0.13
172	688605	先锋精科	1,118	116,294.36	0.13
173	688055	龙腾光电	19,851	114,341.76	0.13
174	688206	概伦电子	2,547	113,010.39	0.12
175	688131	皓元医药	1,180	111,628.00	0.12
176	688281	华秦科技	2,191	110,053.93	0.12
177	688090	瑞松科技	1,030	109,643.50	0.12

178	688516	奥特维	1,900	109,041.00	0.12
179	688107	安路科技	2,390	108,984.00	0.12
180	688192	迪哲医药	2,725	108,809.25	0.12
181	688690	纳微科技	2,402	105,928.20	0.12
182	688593	新相微	2,715	105,667.80	0.12
183	688319	欧林生物	2,398	105,464.04	0.12
184	688376	美埃科技	896	104,204.80	0.11
185	688353	华盛锂电	893	103,650.51	0.11
186	688456	有研粉材	731	102,047.60	0.11
187	688401	路维光电	1,051	100,874.98	0.11
188	688208	道通科技	3,961	99,777.59	0.11
189	688363	华熙生物	2,787	99,690.99	0.11
190	688275	万润新能	768	97,958.40	0.11
191	688182	灿勤科技	2,274	97,941.18	0.11
192	688561	奇安信	4,032	96,687.36	0.11
193	688798	艾为电子	1,310	96,049.20	0.11
194	688158	优刻得	2,606	95,796.56	0.11
195	688779	五矿新能	11,543	93,613.73	0.10
196	688416	恒烁股份	664	92,960.00	0.10
197	688258	卓易信息	782	92,698.28	0.10
198	688520	神州细胞	2,683	91,785.43	0.10
199	688325	赛微微电	698	91,026.18	0.10
200	688031	星环科技	782	90,070.76	0.10
201	688691	灿芯股份	773	89,613.89	0.10
202	688378	奥来德	1,416	87,792.00	0.10
203	688100	威胜信息	2,864	87,609.76	0.10
204	688530	欧莱新材	897	86,919.30	0.10
205	688138	清溢光电	1,844	86,668.00	0.10
206	688166	博瑞医药	2,475	86,649.75	0.10
207	688669	聚石化学	783	83,781.00	0.09
208	688088	虹软科技	2,356	83,755.80	0.09
209	688262	国芯科技	1,935	83,650.05	0.09
210	688261	东微半导	793	83,209.49	0.09
211	688125	安达智能	499	81,586.50	0.09
212	688116	天奈科技	2,133	81,480.60	0.09
213	688677	海泰新光	799	80,802.87	0.09
214	688337	普源精电	1,059	79,350.87	0.09
215	688153	唯捷创芯	2,457	78,918.84	0.09
216	688222	成都先导	2,382	76,486.02	0.08
217	688327	云从科技	6,135	76,442.10	0.08
218	688079	美迪凯	2,471	75,983.25	0.08
219	688567	孚能科技	7,221	75,820.50	0.08
220	688381	帝奥微	1,417	75,809.50	0.08

221	688371	菲沃泰	1,930	75,250.70	0.08
222	688306	均普智能	7,440	75,144.00	0.08
223	688209	英集芯	2,581	75,055.48	0.08
224	688720	艾森股份	742	74,942.00	0.08
225	688063	派能科技	1,393	74,205.11	0.08
226	688717	艾罗能源	897	74,065.29	0.08
227	688612	威迈斯	2,472	73,146.48	0.08
228	688029	南微医学	1,015	72,877.00	0.08
229	688227	品高股份	703	72,191.07	0.08
230	688583	思看科技	841	72,132.57	0.08
231	688202	美迪西	889	71,751.19	0.08
232	688486	龙迅股份	1,127	71,654.66	0.08
233	688663	新风光	801	70,856.46	0.08
234	688016	心脉医疗	799	70,823.36	0.08
235	688190	云路股份	773	70,118.83	0.08
236	688312	燕麦科技	833	69,963.67	0.08
237	688170	德龙激光	727	69,799.27	0.08
238	688660	电气风电	8,060	69,477.20	0.08
239	688699	明微电子	846	69,329.70	0.08
240	688321	微芯生物	2,621	69,010.93	0.08
241	688032	禾迈股份	806	68,123.12	0.07
242	688191	智洋创新	1,900	67,830.00	0.07
243	688508	芯朋微	728	67,674.88	0.07
244	688035	德邦科技	734	67,381.20	0.07
245	688231	隆达股份	1,834	67,362.82	0.07
246	688628	优利德	679	67,180.26	0.07
247	688062	迈威生物	2,373	67,037.25	0.07
248	688112	鼎阳科技	893	65,599.78	0.07
249	688556	高测股份	4,910	65,204.80	0.07
250	688198	佰仁医疗	716	63,895.84	0.07
251	688478	晶升股份	721	63,844.55	0.07
252	688307	中润光学	795	63,560.25	0.07
253	688165	埃夫特	3,113	63,505.20	0.07
254	688787	海天瑞声	472	63,460.40	0.07
255	688379	华光新材	754	63,358.62	0.07
256	688351	微电生理	2,781	63,017.46	0.07
257	688698	伟创电气	1,190	62,415.50	0.07
258	688155	先惠技术	771	62,366.19	0.07
259	688239	航宇科技	1,041	62,283.03	0.07
260	688667	菱电电控	466	62,280.90	0.07
261	688382	益方生物	3,418	61,524.00	0.07
262	688693	锆威特	589	61,226.55	0.07
263	688518	联赢激光	1,967	60,780.30	0.07

264	688160	步科股份	553	60,149.81	0.07
265	688386	泛亚微透	662	59,474.08	0.07
266	688230	芯导科技	753	59,343.93	0.07
267	688179	阿拉丁	2,136	59,188.56	0.06
268	688328	深科达	617	59,046.90	0.06
269	688485	九州一轨	918	58,807.08	0.06
270	688083	中望软件	903	58,469.25	0.06
271	688046	药康生物	2,409	58,297.80	0.06
272	688480	赛恩斯	655	57,371.45	0.06
273	688305	科德数控	877	57,241.79	0.06
274	688678	福立旺	2,359	57,017.03	0.06
275	688252	天德钰	2,369	56,856.00	0.06
276	688419	耐科装备	720	56,628.00	0.06
277	688543	国科军工	1,431	56,452.95	0.06
278	688598	金博股份	1,138	56,274.10	0.06
279	688719	爱科赛博	730	56,210.00	0.06
280	688128	中国电研	2,363	56,097.62	0.06
281	688093	世华科技	1,510	55,719.00	0.06
282	688181	八亿时空	890	55,714.00	0.06
283	688788	科思科技	1,227	55,190.46	0.06
284	688323	瑞华泰	970	54,805.00	0.06
285	688326	经纬恒润	772	54,719.36	0.06
286	688586	江航装备	4,677	54,674.13	0.06
287	688552	航天南湖	1,942	54,628.46	0.06
288	688105	诺唯赞	3,094	53,680.90	0.06
289	688711	宏微科技	1,181	53,676.45	0.06
290	688550	瑞联新材	924	53,453.40	0.06
291	688710	益诺思	795	53,424.00	0.06
292	688439	振华风光	1,154	53,314.80	0.06
293	688758	赛分科技	2,419	53,242.19	0.06
294	688697	纽威数控	3,903	53,041.77	0.06
295	688656	浩欧博	542	52,449.34	0.06
296	688135	利扬芯片	1,237	52,052.96	0.06
297	688789	宏华数科	973	51,734.41	0.06
298	688721	龙图光罩	882	51,491.16	0.06
299	688068	热景生物	594	51,440.40	0.06
300	688689	银河微电	794	51,387.68	0.06
301	688551	科威尔	731	51,367.37	0.06
302	688139	海尔生物	1,937	51,175.54	0.06
303	688611	杭州柯林	716	51,158.20	0.06
304	688776	国光电气	827	50,728.18	0.06
305	688418	震有科技	1,055	50,724.40	0.06
306	688221	前沿生物	2,239	50,153.60	0.05

307	688522	纳睿雷达	2,504	50,130.08	0.05
308	688443	智翔金泰	2,146	49,894.50	0.05
309	688109	品茗科技	655	49,583.50	0.05
310	688161	威高骨科	2,362	49,554.76	0.05
311	688011	新光光电	704	49,188.48	0.05
312	688289	圣湘生物	3,365	48,456.00	0.05
313	688499	利元亨	902	47,400.10	0.05
314	688290	景业智能	712	47,248.32	0.05
315	688739	成大生物	2,424	47,243.76	0.05
316	688655	迅捷兴	881	47,186.36	0.05
317	688103	国力电子	633	47,101.53	0.05
318	688601	力芯微	775	46,926.25	0.05
319	688591	泰凌微	1,361	46,791.18	0.05
320	688448	磁谷科技	730	46,398.80	0.05
321	688173	希荻微	2,424	46,395.36	0.05
322	688685	迈信林	845	46,390.50	0.05
323	688168	安博通	672	46,200.00	0.05
324	688665	四方光电	696	45,727.20	0.05
325	688750	金天钛业	2,733	45,449.79	0.05
326	688277	天智航	2,639	45,126.90	0.05
327	688733	壹石通	1,088	44,988.80	0.05
328	688253	英诺特	745	44,908.60	0.05
329	688108	赛诺医疗	2,423	44,898.19	0.05
330	688479	友车科技	1,169	44,386.93	0.05
331	688786	悦安新材	958	44,144.64	0.05
332	688049	炬芯科技	941	44,142.31	0.05
333	688512	慧智微	2,758	44,045.26	0.05
334	688226	威腾电气	1,028	44,029.24	0.05
335	688428	诺诚健华	1,540	43,843.80	0.05
336	688010	福光股份	901	43,815.63	0.05
337	688653	康希通信	2,509	43,606.42	0.05
338	688091	上海谊众	1,047	42,089.40	0.05
339	688219	会通股份	3,248	42,029.12	0.05
340	688291	金橙子	718	41,988.64	0.05
341	688218	江苏北人	761	41,824.56	0.05
342	688045	必易微	514	41,520.92	0.05
343	688282	理工导航	713	41,496.60	0.05
344	688163	赛伦生物	838	40,902.78	0.04
345	688345	博力威	701	40,714.08	0.04
346	688177	百奥泰	2,388	40,166.16	0.04
347	688286	敏芯股份	346	39,814.22	0.04
348	688626	翔宇医疗	897	39,701.22	0.04
349	688408	中信博	1,231	39,576.65	0.04

350	688309	恒誉环保	642	39,084.96	0.04
351	688237	超卓航科	727	38,836.34	0.04
352	688799	华纳药厂	864	38,767.68	0.04
353	688707	振华新材	3,007	38,639.95	0.04
354	688050	爱博医疗	1,060	38,637.00	0.04
355	688553	汇宇制药	3,602	38,289.26	0.04
356	688620	安凯微	2,358	38,199.60	0.04
357	688623	二元科技	379	38,074.34	0.04
358	688365	光云科技	2,414	38,068.78	0.04
359	688450	光格科技	568	38,050.32	0.04
360	688293	奥浦迈	912	38,021.28	0.04
361	688356	键凯科技	489	37,692.12	0.04
362	688621	阳光诺和	684	37,558.44	0.04
363	688007	光峰科技	2,797	37,200.10	0.04
364	688185	康希诺	727	37,069.73	0.04
365	688210	统联精密	912	36,945.12	0.04
366	688768	容知日新	713	36,748.02	0.04
367	688679	通源环境	867	36,492.03	0.04
368	688069	德林海	976	36,463.36	0.04
369	688607	康众医疗	714	36,414.00	0.04
370	688510	航亚科技	1,516	36,202.08	0.04
371	688570	天玛智控	2,542	36,172.66	0.04
372	688513	苑东生物	819	36,003.24	0.04
373	688061	灿瑞科技	722	35,861.74	0.04
374	688115	思林杰	436	35,861.00	0.04
375	688228	开普云	460	35,576.40	0.04
376	688562	航天软件	2,362	35,571.72	0.04
377	688087	英科再生	1,056	35,291.52	0.04
378	688580	伟思医疗	647	34,465.69	0.04
379	688259	创耀科技	881	34,464.72	0.04
380	688609	九联科技	3,123	34,384.23	0.04
381	688320	禾川科技	824	34,154.80	0.04
382	688232	新点软件	1,919	34,119.82	0.04
383	688658	悦康药业	2,647	34,040.42	0.04
384	688631	莱斯信息	725	34,009.75	0.04
385	688577	浙海德曼	741	33,960.03	0.04
386	688276	百克生物	2,418	33,706.92	0.04
387	688595	芯海科技	768	33,684.48	0.04
388	688636	智明达	929	33,657.67	0.04
389	688117	圣诺生物	1,243	33,598.29	0.04
390	688176	亚虹医药	3,375	33,480.00	0.04
391	688095	福昕软件	559	33,221.37	0.04
392	688648	中邮科技	902	32,968.10	0.04

393	688683	莱尔科技	858	32,535.36	0.04
394	688334	西高院	1,787	32,416.18	0.04
395	688119	中钢洛耐	6,815	32,371.25	0.04
396	688216	气派科技	769	32,305.69	0.04
397	688526	科前生物	2,660	32,186.00	0.04
398	688539	高华科技	1,001	31,911.88	0.03
399	688101	三达膜	1,920	31,737.60	0.03
400	688488	艾迪药业	2,453	31,521.05	0.03
401	688696	极米科技	487	31,430.98	0.03
402	688199	久日新材	907	31,318.71	0.03
403	688151	华强科技	2,093	31,122.91	0.03
404	688505	复旦张江	4,198	30,981.24	0.03
405	688377	迪威尔	1,308	30,842.64	0.03
406	688366	昊海生科	1,067	30,804.29	0.03
407	688315	诺禾致源	2,460	30,774.60	0.03
408	688084	晶品特装	604	30,369.12	0.03
409	688348	昱能科技	867	30,154.26	0.03
410	688073	毕得医药	559	30,085.38	0.03
411	688207	格灵深瞳	1,493	30,009.30	0.03
412	688196	卓越新能	833	29,904.70	0.03
413	688225	亚信安全	2,404	29,857.68	0.03
414	688600	皖仪科技	892	29,685.76	0.03
415	688575	亚辉龙	3,377	29,582.52	0.03
416	688081	兴图新科	716	29,270.08	0.03
417	688299	长阳科技	1,699	28,390.29	0.03
418	688566	吉贝尔	1,105	28,276.95	0.03
419	688458	美芯晟	677	28,271.52	0.03
420	688211	中科微至	819	28,189.98	0.03
421	688682	霍莱沃	712	27,696.80	0.03
422	688350	富淼科技	799	27,589.47	0.03
423	688273	麦澜德	706	27,350.44	0.03
424	688360	德马科技	1,510	27,029.00	0.03
425	688606	奥泰生物	657	26,989.56	0.03
426	688197	首药控股	805	26,895.05	0.03
427	688500	慧辰股份	589	26,699.37	0.03
428	688410	山外山	1,853	26,609.08	0.03
429	688070	纵横股份	709	26,466.97	0.03
430	688767	博拓生物	810	26,333.10	0.03
431	688391	钜泉科技	733	26,292.71	0.03
432	688272	富吉瑞	591	26,240.40	0.03
433	688212	澳华内镜	891	26,195.40	0.03
434	688330	宏力达	774	26,184.42	0.03
435	688159	有方科技	588	26,101.32	0.03

436	688511	天微电子	863	26,071.23	0.03
437	688283	坤恒顺维	787	26,057.57	0.03
438	688023	安恒信息	709	26,034.48	0.03
439	688039	当虹科技	696	25,974.72	0.03
440	688618	三旺通信	836	25,723.72	0.03
441	688269	凯立新材	810	25,685.10	0.03
442	688085	三友医疗	2,145	25,675.65	0.03
443	688148	芳源股份	2,988	25,637.04	0.03
444	688056	莱伯泰科	390	25,174.50	0.03
445	688080	映翰通	582	25,171.50	0.03
446	688175	高凌信息	999	25,124.85	0.03
447	688581	安杰思	481	24,872.51	0.03
448	688057	金达莱	1,611	24,825.51	0.03
449	688389	普门科技	2,531	24,778.49	0.03
450	688716	中研股份	786	24,703.98	0.03
451	688171	纬德信息	559	24,573.64	0.03
452	688680	海优新材	585	24,570.00	0.03
453	688186	广大特材	1,621	24,558.15	0.03
454	688215	瑞晟智能	606	24,336.96	0.03
455	688602	康鹏科技	3,055	24,073.40	0.03
456	688399	硕世生物	530	24,056.70	0.03
457	688302	海创药业	684	24,056.28	0.03
458	688558	国盛智科	731	24,020.66	0.03
459	688429	时创能源	2,342	23,864.98	0.03
460	688639	华恒生物	1,462	23,596.68	0.03
461	688255	凯尔达	844	23,463.20	0.03
462	688311	盟升电子	895	23,440.05	0.03
463	688459	哈铁科技	2,808	23,390.64	0.03
464	688367	工大高科	699	23,276.70	0.03
465	688316	青云科技	431	23,274.00	0.03
466	688075	安旭生物	777	23,123.52	0.03
467	688136	科兴制药	1,110	22,988.10	0.03
468	688236	春立医疗	1,586	22,933.56	0.03
469	688157	松井股份	868	22,906.52	0.03
470	688571	杭华股份	2,614	22,872.50	0.03
471	688592	司南导航	549	22,750.56	0.02
472	688633	星球石墨	765	22,743.45	0.02
473	688671	碧兴物联	636	22,622.52	0.02
474	688267	中触媒	1,140	22,458.00	0.02
475	688657	浩辰软件	623	22,284.71	0.02
476	688557	兰剑智能	707	21,938.21	0.02
477	688130	晶华微	780	21,933.60	0.02
478	688338	赛科希德	742	21,896.42	0.02

479	688265	南模生物	632	21,860.88	0.02
480	688576	西山科技	547	21,797.95	0.02
481	688588	凌志软件	2,391	21,734.19	0.02
482	688071	华依科技	589	21,463.16	0.02
483	688129	东来技术	814	21,318.66	0.02
484	688358	祥生医疗	696	21,276.72	0.02
485	688238	和元生物	3,866	20,953.72	0.02
486	688398	赛特新材	793	20,546.63	0.02
487	688156	路德科技	677	20,479.25	0.02
488	688755	汉邦科技	741	20,421.96	0.02
489	688357	建龙微纳	692	20,393.24	0.02
490	688098	申联生物	2,366	20,323.94	0.02
491	688339	亿华通	1,078	20,158.60	0.02
492	688489	三未信安	876	19,885.20	0.02
493	688152	麒麟信安	722	19,840.56	0.02
494	688133	泰坦科技	933	19,714.29	0.02
495	688247	宣泰医药	2,619	19,694.88	0.02
496	688298	东方生物	1,099	19,628.14	0.02
497	688113	联测科技	553	19,410.30	0.02
498	688722	同益中	1,275	19,341.75	0.02
499	688509	正元地信	4,512	19,311.36	0.02
500	688589	力合微	840	19,303.20	0.02
501	688178	万德斯	570	19,271.70	0.02
502	688335	复洁科技	800	19,232.00	0.02
503	688280	精进电动	3,479	19,099.71	0.02
504	688137	近岸蛋白	530	19,080.00	0.02
505	688077	大地熊	713	18,887.37	0.02
506	688651	盛邦安全	585	18,848.70	0.02
507	688569	铁科轨道	1,152	18,604.80	0.02
508	688229	博睿数据	242	18,561.40	0.02
509	688590	新致软件	1,482	18,421.26	0.02
510	688251	井松智能	708	18,146.04	0.02
511	688579	地纬智能	2,360	17,912.40	0.02
512	688373	盟科药业	3,873	17,544.69	0.02
513	688096	京源环保	1,291	17,247.76	0.02
514	688162	巨一科技	711	16,808.04	0.02
515	688370	丛麟科技	801	16,756.92	0.02
516	688314	康拓医疗	491	16,635.08	0.02
517	688013	天臣医疗	673	16,602.91	0.02
518	688435	英方软件	516	16,512.00	0.02
519	688455	科捷智能	883	16,476.78	0.02
520	688292	浩瀚深度	883	16,423.80	0.02
521	688619	罗普特	993	16,116.39	0.02

522	688426	康为世纪	872	15,992.48	0.02
523	688060	云涌科技	485	15,951.65	0.02
524	688015	交控科技	1,035	15,918.30	0.02
525	688355	明志科技	825	15,881.25	0.02
526	688285	高铁电气	2,193	15,723.81	0.02
527	688317	之江生物	1,029	15,640.80	0.02
528	688246	嘉和美康	757	15,556.35	0.02
529	688030	山石网科	982	15,505.78	0.02
530	688369	致远互联	734	15,421.34	0.02
531	688517	金冠电气	878	15,347.44	0.02
532	688533	上声电子	720	15,019.20	0.02
533	688687	凯因科技	916	14,939.96	0.02
534	688737	中自科技	769	14,718.66	0.02
535	688051	佳华科技	636	14,615.28	0.02
536	688718	唯赛勃	907	14,484.79	0.02
537	688193	仁度生物	261	14,433.30	0.02
538	688501	青达环保	750	14,400.00	0.02
539	688468	科美诊断	2,459	13,991.71	0.02
540	688670	金迪克	825	13,975.50	0.02
541	688529	豪森智能	883	13,889.59	0.02
542	688310	迈得医疗	858	13,187.46	0.01
543	688597	煜邦电力	2,023	13,149.50	0.01
544	688395	正弦电气	585	12,928.50	0.01
545	688058	宝兰德	617	12,907.64	0.01
546	688560	明冠新材	1,088	12,892.80	0.01
547	688329	艾隆科技	621	12,550.41	0.01
548	688038	中科通达	743	12,497.26	0.01
549	688288	鸿泉技术	694	12,332.38	0.01
550	688026	洁特生物	782	12,285.22	0.01
551	688573	信宇人	669	11,854.68	0.01
552	688004	博汇科技	649	11,811.80	0.01
553	688078	龙软科技	559	11,766.95	0.01
554	688244	永信至诚	823	11,735.98	0.01
555	688118	普元信息	573	11,528.76	0.01
556	688021	奥福科技	590	11,422.40	0.01
557	688203	海正生材	1,121	11,187.58	0.01
558	688793	倍轻松	690	11,115.90	0.01
559	688132	邦彦技术	834	10,967.10	0.01
560	688420	美腾科技	517	10,893.19	0.01
561	688393	安必平	609	10,828.02	0.01
562	688613	奥精医疗	758	10,695.38	0.01
563	688695	中创股份	571	10,677.70	0.01
564	688092	爱科科技	501	10,641.24	0.01

565	688638	誉辰智能	337	10,504.29	0.01
566	688681	科汇股份	733	10,247.34	0.01
567	688466	金科环境	781	10,020.23	0.01
568	688189	ST 南新	1,673	10,004.54	0.01
569	688616	西力科技	954	9,635.40	0.01
570	688067	爱威科技	478	9,631.70	0.01
571	688089	嘉必优	901	9,559.61	0.01
572	688296	和达科技	833	9,529.52	0.01
573	688659	元琛科技	897	9,364.68	0.01
574	688528	秦川物联	875	7,997.50	0.01
575	688565	力源科技	814	7,692.30	0.01
576	688217	睿昂基因	328	6,776.48	0.01
577	688701	卓锦股份	888	6,686.64	0.01
578	688121	卓然股份	883	5,721.84	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688781	视涯科技	905	38,154.80	0.04
2	688808	联讯仪器	24	38,023.92	0.04
3	688790	昂瑞微	290	36,670.50	0.04
4	688820	盛合晶微	127	17,969.23	0.02
5	688712	北芯生命	417	14,978.64	0.02
6	688635	长进光子	42	12,943.98	0.01
7	688813	泰金新能	75	12,906.75	0.01
8	688785	恒运昌	26	12,041.90	0.01
9	688811	有研复材	293	7,070.09	0.01
10	603459	红板科技	60	5,059.20	0.01
11	603407	长裕集团	62	4,554.52	0.00
12	603435	嘉德利	43	2,008.53	0.00
13	601112	振石股份	94	1,653.46	0.00
14	603352	至信股份	34	867.68	0.00
15	603293	埃泰克	17	576.81	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688795	摩尔线程	2,101,401.27	1.90
2	688802	沐曦股份	1,926,334.95	1.74
3	688411	海博思创	503,409.40	0.46
4	688041	海光信息	220,128.93	0.20
5	688019	安集科技	203,151.10	0.18
6	688766	普冉股份	188,033.08	0.17

7	688545	兴福电子	187,917.83	0.17
8	688166	博瑞医药	180,058.56	0.16
9	688615	合合信息	156,463.79	0.14
10	688048	长光华芯	155,172.00	0.14
11	688017	绿的谐波	151,152.23	0.14
12	688608	恒玄科技	147,104.73	0.13
13	688668	鼎通科技	139,163.71	0.13
14	688205	德科立	122,744.38	0.11
15	688200	华峰测控	105,931.24	0.10
16	688617	惠泰医疗	104,032.53	0.09
17	688372	伟测科技	103,368.76	0.09
18	688072	拓荆科技	101,740.80	0.09
19	688037	芯源微	99,720.64	0.09
20	688652	京仪装备	97,118.20	0.09

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	481,820.00	0.44
2	688041	海光信息	422,172.09	0.38
3	688027	国盾量子	255,547.32	0.23
4	688256	寒武纪	217,792.00	0.20
5	688635	长进光子	206,640.00	0.19
6	688166	博瑞医药	190,620.82	0.17
7	688270	ST 臻镭	190,224.96	0.17
8	688195	腾景科技	172,347.00	0.16
9	688981	中芯国际	166,413.24	0.15
10	688167	炬光科技	160,564.00	0.15
11	688808	联讯仪器	156,422.24	0.14
12	688692	达梦数据	151,632.00	0.14
13	688627	精智达	131,230.00	0.12
14	688008	澜起科技	116,344.00	0.11
15	688025	杰普特	105,583.77	0.10
16	688235	百济神州	97,852.60	0.09
17	688820	盛合晶微	86,565.02	0.08
18	688785	恒运昌	85,790.00	0.08
19	688279	峰昭科技	80,496.46	0.07
20	688125	安达智能	76,034.00	0.07

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	12,427,727.97
卖出股票收入（成交）总额	11,372,636.78

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”

均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	28,438.93	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,438.93	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118068	迪威转债	60	9,438.11	0.01
2	118070	南芯转债	90	9,000.51	0.01
3	118072	鼎通转债	50	5,000.15	0.01
4	118071	华峰转债	40	4,000.07	0.00
5	118069	爱科转债	10	1,000.09	0.00

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

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

无。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	1,287,936.00	1.41	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	233,544.30	0.26	新股锁定

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688781	视涯科技	38,154.80	0.04	新股锁定
2	688808	联讯仪器	38,023.92	0.04	新股锁定
3	688790	昂瑞微	36,670.50	0.04	新股锁定
4	688820	盛合晶微	17,969.23	0.02	新股锁定
5	688712	北芯生命	14,978.64	0.02	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

8.1.1 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 (%)
525	79,204.85	32,973,247.00	79.30	8,609,300.00	20.70

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实上证科创板综合交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金	27,051,000.00	65.05

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，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

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2025 年 4 月 9 日) 基金份额 总额	445,582,547.00
本报告期期初基金份额总额	77,582,547.00
本报告期基金总申购份额	20,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	56,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,582,547.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

（1）基金管理人的重大人事变动情况
2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。
（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况
2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。
--

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

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话

受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	—

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

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 (%)	
方正证券股份有限公司	3	23,392,846.04	100.00	4,348.36	100.00	—
平安银行股份有限公司	1	—	—	—	—	—

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- （1）经营行为规范；
- （2）财务状况良好；
- （3）合规风控能力较强；
- （4）交易服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：平安银行股份有限公司新增交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
方正证券股份有限公司	285,998.14	100.00	-	-	-	-
平安银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第一次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 14 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金委托中证指数有限公司计算基金份额参考净值（IOPV）的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 26 日
3	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第一次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 13 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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(%)
联接基金	1	2026-01-01 至 2026-06-30	49,990,700.00	30,977,400.00	53,917,100.00	27,051,000.00	65.05
产品特有风险							

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 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，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日