

嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放 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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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增强策略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增强策略 ETF
场内简称	科综增强（扩位证券简称：科创综指增强 ETF 嘉实）
基金主代码	588670
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 6 月 5 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,792,000.00 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 6 月 13 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数，实现基金资产的长期增值。本基金力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以上证科创板综合指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。具体投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
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。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	刘强
	联系电话	(010)65215588	025-83387812
	电子邮箱	service@jsfund.cn	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		400-600-8800	95597
传真		(010)65215588	025-83387215
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆	江苏省南京市江东中路 228 号

	家嘴环路 1318 号 1806A 单元	
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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	100020	210009
法定代表人	经雷	王会清

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	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	15,076,562.01
本期利润	39,420,189.95
加权平均基金份额本期利润	0.8143
本期加权平均净值利润率	49.15%
本期基金份额净值增长率	59.40%
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	31,785,238.81
期末可供分配基金份额利润	0.7606
期末基金资产净值	95,385,585.61
期末基金份额净值	2.2824
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	128.24%

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

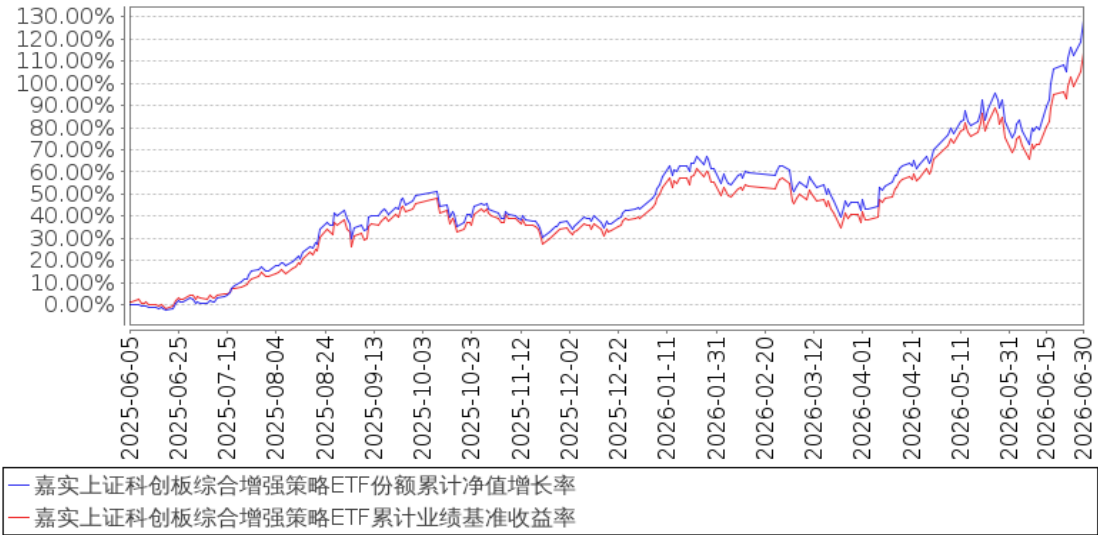
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	60.24%	2.45%	55.71%	2.36%	4.53%	0.09%
过去六个月	59.40%	2.30%	53.99%	2.23%	5.41%	0.07%
过去一年	121.64%	1.98%	104.94%	1.96%	16.70%	0.02%
自基金合同生效起至今	128.24%	1.93%	113.87%	1.91%	14.37%	0.02%

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增强策略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06月05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		
龙昌伦	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实中证500指数增强、嘉实量化精选股票、嘉实创业板增强策略ETF、嘉实中证1000指数增强发起式、嘉实中证A100指数增强发起式基金经理	2025 年 6 月 5 日	-	12 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投研体系。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
尚可	本基金、嘉实新兴科技100ETF、嘉实新兴科技	2025 年 6 月 5 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。

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、嘉实上证科创板综合 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增强策略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

报告期内，A 股市场在政策托底、流动性充裕及 AI 等新产业景气高增的共同驱动下，呈现出极致分化的结构性行情。主要指数上行但涨幅差异巨大，市场活跃度创历史新高，上半年日均成交额约 2.74 万亿元，同比接近翻倍。其中科技与高端制造板块成为市场上涨主线，科创 50 和创业板指分别上涨 64.25% 和 35.58%，大幅跑赢同期其他宽基指数，显示投资者对科技成长板块景气度的极强信心。相较之下，上证 50 下跌 1.38%，上证指数仅上涨 3.16%，大盘价值蓝筹风格表现明显偏弱。

宏观层面，经济整体在复杂外部环境下展现出韧性与分化并存的特征。上半年经济呈开局良好与结构性分化并行的复杂图景，一季度开局平稳，二季度增长动能较一季度有所放缓，内需偏弱、外需与新动能成为主要支撑。内需修复基础尚不牢固，居民消费谨慎，社会消费增速持续回落；固定资产投资走弱，传统制造与地产链条仍是主要拖累。外需在波动中展现出较强韧性，依

托完备产业链优势，高新技术产品成为出口核心驱动力。政策层面，财政与货币协同发力但相比过往更重节奏与结构，宏观政策整体保持定力，为下半年预留发力空间。

从行业表现来看，2026 年上半年 A 股市场不同行业表现差异极为鲜明，在 AI 产业周期与国产替代共振下走出极致分化行情。市场风格从防御彻底转向进取，成长风格大幅跑赢价值风格，硬科技成为绝对主线，AI 算力、光通信、半导体设备等方向对资金产生虹吸效应。行业方面，电子、通信、机械设备等涨幅居前，商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料等则表现靠后。

报告期内，本基金作为一只跟踪科创综指增强策略的投资管理产品，我们在组合管理中积极应对基金申购赎回等因素对跟踪效果带来的冲击，力争给投资者提供一个以科创综指为基准的增强策略投资工具。

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 2.2824 元；本报告期基金份额净值增长率为 59.40%，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

展望未来，国内经济预计仍将延续外需相对较强、内需修复偏缓的结构特征，企业盈利改善的速度取决于稳增长政策的落地、居民与企业需求的恢复节奏，以及外部贸易环境的变化。与此同时，财政与货币协同发力，流动性环境总体有望保持合理充裕。而地缘政治、海外货币政策走向及外需波动仍可能对市场形成阶段性扰动。

权益市场的主要驱动力预计将由上半年的流动性与估值扩张，逐步转向基本面兑现。经历了上半年的极致分化后，市场整体估值有所抬升，波动或将继续维持偏高水平，但结构性行情的格局有望延续。在此背景下，市场风格有望从前期的科技主线的极致分化，向更多板块和主题扩散，演变成风格再平衡的结构特征。科技成长等高景气方向仍具备中长期产业逻辑，但考虑到上半年科技板块涨幅较大、行业估值与交易拥挤度有所提升，投资主线更有可能从上半年强势的算力基础设施进一步沿产业链上下游进行景气扩散。整体而言，下半年需要更加重视业绩与估值的匹配。业绩兑现能力将成为标的主要上行驱动力，而景气成长和低估值价值的哑铃布局有望是下半年的主流操作思路。

本基金将继续在控制指数跟踪误差的同时力争创造更多的超额收益，与此同时，继续管理好产品流动性，为投资者提供增强策略投资工具。

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，本基金未实施利润分配，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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2026 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实上证科创板综合增强策略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	492,054.72	868,928.70
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	94,981,928.91	79,192,294.83
其中：股票投资		94,955,927.91	79,182,294.68
基金投资		-	-
债券投资		26,001.00	10,000.15
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		95,473,983.63	80,061,223.53
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		-	107,983.35
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		33,166.27	36,740.06
应付托管费		6,633.24	7,348.01
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	48,598.50	18,000.00
负债合计		88,398.02	170,071.42
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	41,792,000.00	55,792,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	53,593,585.61	24,099,152.11
净资产合计		95,385,585.61	79,891,152.11
负债和净资产总计		95,473,983.63	80,061,223.53

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2824 元，基金份额总额 41,792,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实上证科创板综合增强策略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 6 月 5 日(基金合 同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		39,707,253.59	9,847,591.31
1. 利息收入		1,387.00	64,360.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,387.00	64,360.05
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）		15,338,501.98	4,254,211.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	15,203,639.18	3,366,184.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	28,183.56	-
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	106,679.24	888,027.28
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	24,343,627.94	5,533,959.73
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	23,736.67	-4,939.88
减：二、营业总支出		287,063.64	202,984.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	198,714.79	156,303.61

2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	39, 742. 93	31, 260. 71
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	48, 605. 92	15, 420. 22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39, 420, 189. 95	9, 644, 606. 77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39, 420, 189. 95	9, 644, 606. 77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		39, 420, 189. 95	9, 644, 606. 77

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实上证科创板综合增强策略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	55, 792, 000. 00	-	24, 099, 152. 11	79, 891, 152. 11
二、本期期初净资产	55, 792, 000. 00	-	24, 099, 152. 11	79, 891, 152. 11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14, 000, 000. 00	-	29, 494, 433. 50	15, 494, 433. 50
（一）、综合收益总额	-	-	39, 420, 189. 95	39, 420, 189. 95
（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）	-14, 000, 000. 00	-	-9, 925, 756. 45	-23, 925, 756. 45
其中：1. 基金申购款	4, 000, 000. 00	-	2, 638, 919. 02	6, 638, 919. 02
2. 基金赎回款	-18, 000, 000. 00	-	-12, 564, 675. 47	-30, 564, 675. 47

（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	41,792,000.00	-	53,593,585.61	95,385,585.61
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 5 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	535,792,000.00	-	-	535,792,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-300,000,000.0 0	-	7,020,926.33	-292,979,073.67
（一）、综合收益总额	-	-	9,644,606.77	9,644,606.77
（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）	-300,000,000.0 0	-	-2,623,680.44	-302,623,680.44
其中：1. 基金申购款	2,000,000.00	-	-27,087.66	1,972,912.34
2. 基金赎回款	-302,000,000.0 0	-	-2,596,592.78	-304,596,592.78
（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	235,792,000.00	-	7,020,926.33	242,812,926.33

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
基金管理人负责人

梁凯
主管会计工作负责人

李袁
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增强策略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[2024]699号《关于准予嘉实上证科创板100增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》和证监许可[2025]939号《关于准予嘉实上证科创板100增强策略交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》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增强策略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增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2025年6月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为535,792,000.00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,基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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	164,940.27
等于：本金	164,876.17
加：应计利息	64.10
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	327,114.45
等于：本金	327,105.50
加：应计利息	8.95
减：坏账准备	-
合计	492,054.72

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		65,747,545.49	-	94,955,927.91	29,208,382.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	26,000.00	1.00	26,001.00	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,000.00	1.00	26,001.00	0.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	65,773,545.49	1.00	94,981,928.91	29,208,382.42

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	48,598.50
合计	48,598.50

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	55,792,000.00	55,792,000.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-18,000,000.00	-18,000,000.00
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	41,792,000.00	41,792,000.00

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	24,783,768.16	-684,616.05	24,099,152.11
本期期初	24,783,768.16	-684,616.05	24,099,152.11

本期利润	15,076,562.01	24,343,627.94	39,420,189.95
本期基金份额交易产生的变动数	-8,075,091.36	-1,850,665.09	-9,925,756.45
其中：基金申购款	2,456,019.04	182,899.98	2,638,919.02
基金赎回款	-10,531,110.40	-2,033,565.07	-12,564,675.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,785,238.81	21,808,346.80	53,593,585.61

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	1,140.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	246.51
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,387.00

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	10,723,403.35
股票投资收益——赎回差价收入	4,480,235.83
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	15,203,639.18

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	207,158,355.83
减：卖出股票成本总额	196,227,783.62
减：交易费用	207,168.86
买卖股票差价收入	10,723,403.35

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	30,564,675.47

减：现金支付赎回款总额	-76,133.20
减：赎回股票成本总额	26,160,572.84
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,480,235.83

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	4.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,178.81
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	28,183.56

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	62,185.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,000.00
减：应计利息总额	3.91
减：交易费用	2.49
买卖债券差价收入	28,178.81

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	106,679.24
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	106,679.24

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	24,343,627.94
股票投资	24,343,627.94

债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	24,343,627.94

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	23,736.67
合计	23,736.67

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	39,671.58
证券出借违约金	—
存托服务费	7.42
合计	48,605.92

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

无。

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金托管人的关联方

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 6 月 5 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	198,714.79	156,303.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	43,535.83	-
应支付基金管理人的净管理费	155,178.96	156,303.61

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，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. 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 6 月 5 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	39,742.93	31,260.71

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，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

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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 6 月 5 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
华泰证券股份有限公司_活期	164,940.27	1,140.49	1,086,503.96	31,644.53

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

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
华泰联合证券有 限责任公司	603293	埃泰克	网下申购	143	4,789.07
上年度可比期间 2025 年 6 月 5 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	77	860.86	1,354.43	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	15	502.35	508.95	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	29	634.52	740.08	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	53	734.58	3,893.38	-
603435	嘉德	2026 年 5	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	37	583.12	1,728.27	-

	利	月 15 日								
603459	红 板 科 技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 锁定	17.70	84.32	51	902.70	4,300.32	-
688635	长 进 光 子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 锁定	40.98	308.19	36	1,475.28	11,094.84	-
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 锁定	17.52	35.92	342	5,991.84	12,284.64	-
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股 锁定	22.68	42.16	747	16,941.96	31,493.52	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 锁定	92.18	463.15	21	1,935.78	9,726.15	-
688790	昂 瑞 微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股 锁定	83.06	126.45	261	21,678.66	33,003.45	-
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	19	1,555.72	30,102.27	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 锁定	6.41	24.13	248	1,589.68	5,984.24	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 锁定	26.28	172.09	60	1,576.80	10,325.40	-
688820	盛 合	2026 年 4	6 个月	新股 锁定	19.68	141.49	113	2,223.84	15,988.37	-

	晶微	月 13 日								
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
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	100	10,000.00	10,000.57	-
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	50	5,000.00	5,000.09	-
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	110	11,000.00	11,000.34	-

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	1,854	766,178.96	1,542,528.00	-
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	847	41,784.51	121,968.00	-

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 risk 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	26,001.00	10,000.15
未评级	-	-
合计	26,001.00	10,000.15

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	492,054.72	-	-	-	492,054.72
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	26,001.00	94,955,927.91	94,981,928.91
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	492,054.72	-	26,001.00	94,955,927.91	95,473,983.63
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	-	-	-	33,166.27	33,166.27
应付托管费	-	-	-	6,633.24	6,633.24
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	-	-	-	48,598.50	48,598.50
负债总计	-	-	-	88,398.02	88,398.02
利率敏感度缺口	492,054.72	-	26,001.00	94,867,529.89	95,385,585.61
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	868,928.70	-	-	-	868,928.70
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	10,000.15	79,182,294.68	79,192,294.83
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	868,928.70	-	10,000.15	79,182,294.68	80,061,223.53
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	-	-	-	107,983.35	107,983.35
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	36,740.06	36,740.06
应付托管费	-	-	-	7,348.01	7,348.01
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	-	-	-	18,000.00	18,000.00
负债总计	-	-	-	170,071.42	170,071.42
利率敏感度缺口	868,928.70	-	10,000.15	79,012,223.26	79,891,152.11

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	377.59	146.56
	市场利率上升 25 个基点	-371.25	-144.08

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	94,955,927.91	99.55	79,182,294.68	99.11
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	94,955,927.91	99.55	79,182,294.68	99.11

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	4,911,980.35	3,811,711.00

	5%		
	业绩比较基准下降	-4,911,980.35	-3,811,711.00
	5%		

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	92,885,359.30	77,529,240.98
第二层次	1,690,497.00	1,452,143.51
第三层次	406,072.61	210,910.34
合计	94,981,928.91	79,192,294.83

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	94,955,927.91	99.46
	其中：股票	94,955,927.91	99.46
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	26,001.00	0.03
	其中：债券	26,001.00	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	492,054.72	0.52
8	其他各项资产	—	—
9	合计	95,473,983.63	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	77,451,373.13	81.20
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	14,505,106.23	15.21
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	2,667,351.18	2.80
N	水利、环境和公共设施管理业	120,872.06	0.13
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	94,744,702.60	99.33

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	22,815.00	0.02
C	制造业	172,528.31	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,882.00	0.02
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	211,225.31	0.22

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	688041	海光信息	14,286	5,290,105.80	5.55
2	688256	寒武纪	3,039	4,848,876.45	5.08
3	688012	中微公司	5,992	2,807,252.00	2.94
4	688008	澜起科技	7,481	2,318,361.90	2.43
5	688981	中芯国际	14,214	2,257,467.48	2.37
6	688795	摩尔线程	2,779	1,977,480.96	2.07
7	688802	沐曦股份	2,378	1,969,697.40	2.06
8	688072	拓荆科技	1,854	1,542,528.00	1.62
9	688498	源杰科技	771	1,454,106.00	1.52
10	688525	佰维存储	2,790	1,380,296.70	1.45
11	688082	盛美上海	3,050	1,317,600.00	1.38
12	688521	芯原股份	3,325	1,234,040.50	1.29
13	688146	中船特气	3,221	1,127,317.79	1.18
14	688347	华虹宏力	2,976	1,000,828.80	1.05
15	688702	盛科通信	2,542	991,354.58	1.04
16	688120	华海清科	2,982	960,740.76	1.01
17	688361	中科飞测	2,045	879,350.00	0.92
18	688126	沪硅产业	21,499	857,595.11	0.90
19	688172	燕东微	9,876	826,226.16	0.87
20	688396	华润微	8,197	799,617.35	0.84
21	688249	晶合集成	12,254	723,353.62	0.76
22	688183	生益电子	5,332	705,956.80	0.74
23	688200	华峰测控	1,322	694,182.20	0.73
24	688766	普冉股份	901	690,706.60	0.72
25	688777	中控技术	5,868	689,490.00	0.72
26	688001	华兴源创	8,023	687,571.10	0.72
27	688506	百利天恒	2,280	670,388.40	0.70
28	688110	东芯股份	3,237	659,376.90	0.69
29	688469	芯联集成	58,110	616,547.10	0.65
30	688111	金山办公	2,844	605,914.20	0.64
31	688668	鼎通科技	1,611	601,386.30	0.63
32	688409	富创精密	1,933	591,981.25	0.62
33	688548	广钢气体	11,212	584,145.20	0.61
34	688627	精智达	804	574,860.00	0.60
35	688519	南亚新材	1,484	563,979.36	0.59
36	688037	芯源微	1,245	546,617.25	0.57

37	688048	长光华芯	1,075	539,650.00	0.57
38	688234	天岳先进	3,106	538,922.06	0.56
39	688313	仕佳光子	2,843	524,959.95	0.55
40	688002	睿创微纳	3,385	523,625.65	0.55
41	688017	绿的谐波	1,198	500,596.28	0.52
42	688629	华丰科技	2,656	498,026.56	0.52
43	688669	聚石化学	4,583	490,381.00	0.51
44	688179	阿拉丁	17,652	489,136.92	0.51
45	688147	微导纳米	2,992	484,344.96	0.51
46	688630	芯碁微装	872	479,068.08	0.50
47	688019	安集科技	1,382	469,133.72	0.49
48	688319	欧林生物	10,665	469,046.70	0.49
49	688331	荣昌生物	3,542	461,380.92	0.48
50	688559	海目星	5,488	460,552.96	0.48
51	688432	有研硅	11,505	459,854.85	0.48
52	688671	碧兴物联	12,797	455,189.29	0.48
53	688585	上纬新材	2,657	440,530.60	0.46
54	688387	信科移动	22,184	440,130.56	0.46
55	688141	杰华特	2,691	413,068.50	0.43
56	688271	联影医疗	4,027	407,653.21	0.43
57	688025	杰普特	862	405,140.00	0.42
58	688102	斯瑞新材	8,541	402,964.38	0.42
59	688300	联瑞新材	1,648	402,771.20	0.42
60	688047	龙芯中科	2,570	397,501.90	0.42
61	688036	传音控股	6,741	397,381.95	0.42
62	688336	三生国健	7,370	391,347.00	0.41
63	688187	时代电气	5,602	384,633.32	0.40
64	688143	长盈通	2,135	375,503.80	0.39
65	688400	凌云光	5,665	375,023.00	0.39
66	688375	国博电子	3,593	374,749.90	0.39
67	688578	艾力斯	3,417	373,136.40	0.39
68	688549	中巨芯	10,008	368,394.48	0.39
69	688099	晶晨股份	3,502	360,355.80	0.38
70	688231	隆达股份	9,745	357,933.85	0.38
71	688295	中复神鹰	5,775	349,618.50	0.37
72	688728	格科微	16,448	346,065.92	0.36
73	688222	成都先导	10,694	343,384.34	0.36
74	688411	海博思创	1,173	341,577.60	0.36
75	688368	晶丰明源	1,568	339,503.36	0.36
76	688503	聚和材料	2,552	338,650.40	0.36
77	688449	联芸科技	3,866	333,674.46	0.35
78	688127	蓝特光学	3,327	324,715.20	0.34
79	688220	翱捷科技	2,553	317,388.96	0.33

80	688046	药康生物	13,084	316,632.80	0.33
81	688027	国盾量子	625	315,006.25	0.33
82	688301	奕瑞科技	2,535	314,340.00	0.33
83	688028	沃尔德	2,008	312,986.96	0.33
84	688545	兴福电子	2,350	312,691.00	0.33
85	688167	炬光科技	870	308,162.70	0.32
86	688700	东威科技	3,445	307,983.00	0.32
87	688372	伟测科技	1,640	305,040.00	0.32
88	688536	思瑞浦	832	302,922.88	0.32
89	688322	奥比中光	2,318	302,614.90	0.32
90	688308	欧科亿	1,638	297,804.78	0.31
91	688188	柏楚电子	2,666	284,462.20	0.30
92	688248	南网科技	4,075	281,908.50	0.30
93	688097	博众精工	4,428	279,185.40	0.29
94	688690	纳微科技	6,225	274,522.50	0.29
95	688131	皓元医药	2,872	271,691.20	0.28
96	688213	思特威	2,474	264,891.18	0.28
97	688676	金盘科技	3,109	263,145.76	0.28
98	688472	阿特斯	24,171	261,530.22	0.27
99	688266	泽璟制药	2,197	256,302.02	0.27
100	688362	甬矽电子	2,658	256,231.20	0.27
101	688268	华特气体	955	255,462.50	0.27
102	688603	天承科技	1,215	252,659.25	0.26
103	688385	复旦微电	3,534	251,938.86	0.26
104	688343	云天励飞	3,073	250,941.18	0.26
105	688018	乐鑫科技	1,956	250,211.52	0.26
106	688433	华曙高科	2,914	249,438.40	0.26
107	688507	索辰科技	919	247,835.92	0.26
108	688052	纳芯微	849	244,775.19	0.26
109	688006	杭可科技	6,671	243,825.05	0.26
110	688257	新锐股份	2,391	243,642.90	0.26
111	688450	光格科技	3,610	241,833.90	0.25
112	688535	华海诚科	1,262	235,994.00	0.25
113	688235	百济神州	924	235,259.64	0.25
114	688800	瑞可达	2,425	232,727.25	0.24
115	688677	海泰新光	2,281	230,677.53	0.24
116	688502	茂莱光学	327	226,807.20	0.24
117	688401	路维光电	2,360	226,512.80	0.24
118	688233	神工股份	1,052	225,569.84	0.24
119	688065	凯赛生物	4,698	224,799.30	0.24
120	688593	新相微	5,763	224,295.96	0.24
121	688392	骄成超声	974	221,273.32	0.23
122	688205	德科立	1,061	220,889.59	0.23

123	688652	京仪装备	1,095	219,186.15	0.23
124	688568	中科星图	5,255	217,924.85	0.23
125	688448	磁谷科技	3,395	215,786.20	0.23
126	688202	美迪西	2,658	214,527.18	0.22
127	688538	和辉光电	82,493	214,481.80	0.22
128	688223	晶科能源	44,898	213,265.50	0.22
129	688123	聚辰股份	989	210,261.40	0.22
130	688518	联赢激光	6,741	208,296.90	0.22
131	688531	日联科技	1,171	208,250.64	0.22
132	688291	金橙子	3,462	202,457.76	0.21
133	688195	腾景科技	1,046	201,438.68	0.21
134	688281	华秦科技	3,949	198,358.27	0.21
135	688428	诺诚健华	6,941	197,610.27	0.21
136	688003	天准科技	1,548	197,060.40	0.21
137	688221	前沿生物	8,743	195,843.20	0.21
138	688180	君实生物	5,720	193,450.40	0.20
139	688388	嘉元科技	4,349	191,356.00	0.20
140	688733	壹石通	4,613	190,747.55	0.20
141	688628	优利德	1,921	190,063.74	0.20
142	688333	铂力特	1,849	189,337.60	0.20
143	688719	爱科赛博	2,431	187,187.00	0.20
144	688227	品高股份	1,811	185,971.59	0.19
145	688661	和林微纳	1,127	179,170.46	0.19
146	688059	华锐精密	897	179,139.87	0.19
147	688708	佳驰科技	3,525	179,070.00	0.19
148	688352	颀中科技	7,380	178,448.40	0.19
149	688170	德龙激光	1,838	176,466.38	0.19
150	688390	固德威	1,625	176,328.75	0.18
151	688778	厦钨新能	3,171	172,502.40	0.18
152	688580	伟思医疗	3,231	172,115.37	0.18
153	688135	利扬芯片	4,067	171,139.36	0.18
154	688711	宏微科技	3,736	169,801.20	0.18
155	688182	灿勤科技	3,929	169,222.03	0.18
156	688199	久日新材	4,893	168,955.29	0.18
157	688332	中科蓝讯	1,072	168,840.00	0.18
158	688349	三一重能	11,041	167,602.38	0.18
159	688380	中微半导	2,540	167,411.40	0.18
160	688596	正帆科技	2,108	166,658.48	0.17
161	688150	莱特光电	2,426	166,472.12	0.17
162	688307	中润光学	2,058	164,537.10	0.17
163	688193	仁度生物	2,970	164,241.00	0.17
164	688757	胜科纳米	2,462	164,215.40	0.17
165	688788	科思科技	3,621	162,872.58	0.17

166	688662	富信科技	961	161,448.00	0.17
167	688114	华大智造	3,114	159,063.12	0.17
168	688253	英诺特	2,631	158,596.68	0.17
169	688117	圣诺生物	5,857	158,314.71	0.17
170	688479	友车科技	4,155	157,765.35	0.17
171	688005	容百科技	5,129	156,947.40	0.16
172	688173	希荻微	8,199	156,928.86	0.16
173	688692	达梦数据	636	155,368.44	0.16
174	688512	慧智微	9,600	153,312.00	0.16
175	688158	优刻得	4,134	151,965.84	0.16
176	688758	赛分科技	6,898	151,824.98	0.16
177	688106	金宏气体	3,655	151,609.40	0.16
178	688625	呈和科技	1,787	150,840.67	0.16
179	688338	赛科希德	5,036	148,612.36	0.16
180	688376	美埃科技	1,268	147,468.40	0.15
181	688484	南芯科技	2,604	147,099.96	0.15
182	688556	高测股份	11,038	146,584.64	0.15
183	688709	成都华微	3,847	146,532.23	0.15
184	688599	天合光能	10,365	146,353.80	0.15
185	688678	福立旺	6,038	145,938.46	0.15
186	688216	气派科技	3,405	143,044.05	0.15
187	688697	纽威数控	10,510	142,830.90	0.15
188	688478	晶升股份	1,611	142,654.05	0.15
189	688035	德邦科技	1,533	140,729.40	0.15
190	688515	裕太微	552	137,315.52	0.14
191	688090	瑞松科技	1,282	136,468.90	0.14
192	688786	悦安新材	2,957	136,258.56	0.14
193	688726	拉普拉斯	2,570	135,824.50	0.14
194	688045	必易微	1,663	134,337.14	0.14
195	688523	航天环宇	2,560	134,144.00	0.14
196	688359	三孚新科	670	132,954.80	0.14
197	688516	奥特维	2,301	132,054.39	0.14
198	688653	康希通信	7,584	131,809.92	0.14
199	688073	毕得医药	2,447	131,697.54	0.14
200	688663	新风光	1,484	131,274.64	0.14
201	688391	钜泉科技	3,657	131,176.59	0.14
202	688584	上海合晶	3,633	130,606.35	0.14
203	688475	萤石网络	4,772	130,514.20	0.14
204	688350	富淼科技	3,657	126,276.21	0.13
205	688130	晶华微	4,475	125,837.00	0.13
206	688416	恒烁股份	898	125,720.00	0.13
207	688122	西部超导	1,997	125,431.57	0.13
208	688230	芯导科技	1,568	123,574.08	0.13

209	688260	昀冢科技	847	121,968.00	0.13
210	688686	奥普特	720	121,240.80	0.13
211	688279	峰昭科技	540	121,197.60	0.13
212	688605	先锋精科	1,157	120,351.14	0.13
213	688055	龙腾光电	20,779	119,687.04	0.13
214	688353	华盛锂电	1,008	116,998.56	0.12
215	688383	新益昌	609	114,516.36	0.12
216	688107	安路科技	2,485	113,316.00	0.12
217	688166	博瑞医药	3,206	112,242.06	0.12
218	688610	埃科光电	422	111,154.80	0.12
219	688206	概伦电子	2,464	109,327.68	0.11
220	688530	欧莱新材	1,114	107,946.60	0.11
221	688615	合合信息	953	107,784.30	0.11
222	688169	石头科技	1,096	104,087.12	0.11
223	688779	五矿新能	12,730	103,240.30	0.11
224	688798	艾为电子	1,405	103,014.60	0.11
225	688551	科威尔	1,465	102,945.55	0.11
226	688378	奥来德	1,651	102,362.00	0.11
227	688098	申联生物	11,896	102,186.64	0.11
228	688456	有研粉材	716	99,953.60	0.10
229	688125	安达智能	608	99,408.00	0.10
230	688112	鼎阳科技	1,353	99,391.38	0.10
231	688275	万润新能	773	98,596.15	0.10
232	688312	燕麦科技	1,152	96,756.48	0.10
233	688356	键凯科技	1,244	95,887.52	0.10
234	688659	元琛科技	9,140	95,421.60	0.10
235	688105	诺唯赞	5,438	94,349.30	0.10
236	688485	九州一轨	1,412	90,452.72	0.09
237	688721	龙图光罩	1,527	89,146.26	0.09
238	688192	迪哲医药	2,223	88,764.39	0.09
239	688419	耐科装备	1,122	88,245.30	0.09
240	688337	普源精电	1,155	86,544.15	0.09
241	688138	清溢光电	1,829	85,963.00	0.09
242	688381	帝奥微	1,579	84,476.50	0.09
243	688209	英集芯	2,859	83,139.72	0.09
244	688323	瑞华泰	1,449	81,868.50	0.09
245	688261	东微半导	760	79,746.80	0.08
246	688371	菲沃泰	2,043	79,656.57	0.08
247	688561	奇安信	3,230	77,455.40	0.08
248	688550	瑞联新材	1,338	77,403.30	0.08
249	688598	金博股份	1,519	75,114.55	0.08
250	688508	芯朋微	806	74,925.76	0.08
251	688772	珠海冠宇	3,703	72,689.89	0.08

252	688720	艾森股份	704	71,104.00	0.07
253	688191	智洋创新	1,925	68,722.50	0.07
254	688379	华光新材	787	66,131.61	0.07
255	688386	泛亚微透	685	61,540.40	0.06
256	688079	美迪凯	1,933	59,439.75	0.06
257	688305	科德数控	865	56,458.55	0.06
258	688328	深科达	588	56,271.60	0.06
259	688710	益诺思	815	54,768.00	0.06
260	688699	明微电子	660	54,087.00	0.06
261	688168	安博通	688	47,300.00	0.05
262	688693	锆威特	452	46,985.40	0.05
263	688093	世华科技	1,221	45,054.90	0.05
264	688620	安凯微	2,494	40,402.80	0.04
265	688286	敏芯股份	346	39,814.22	0.04
266	688345	博力威	645	37,461.60	0.04
267	688115	思林杰	375	30,843.75	0.03
268	688057	金达莱	1,974	30,419.34	0.03
269	688600	皖仪科技	894	29,752.32	0.03
270	688056	莱伯泰科	380	24,529.00	0.03
271	688486	龙迅股份	280	17,802.40	0.02
272	688318	财富趋势	200	14,262.00	0.01
273	688403	汇成股份	325	12,902.50	0.01
274	688309	恒誉环保	200	12,176.00	0.01
275	688327	云从科技	964	12,011.44	0.01
276	688563	航材股份	200	10,246.00	0.01
277	688262	国芯科技	219	9,467.37	0.01
278	688081	兴图新科	217	8,870.96	0.01
279	688226	威腾电气	200	8,566.00	0.01
280	688009	中国通号	1,773	8,439.48	0.01
281	688116	天奈科技	200	7,640.00	0.01
282	688363	华熙生物	200	7,154.00	0.01
283	688100	威胜信息	200	6,118.00	0.01
284	688612	威迈斯	200	5,918.00	0.01
285	688219	会通股份	200	2,588.00	0.00
286	688609	九联科技	200	2,202.00	0.00
287	688571	杭华股份	200	1,750.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688790	昂瑞微	261	33,003.45	0.03
2	688781	视涯科技	747	31,493.52	0.03
3	688808	联讯仪器	19	30,102.27	0.03
4	603993	洛阳钼业	1,300	22,815.00	0.02

5	688820	盛合晶微	113	15,988.37	0.02
6	600900	长江电力	600	15,882.00	0.02
7	688712	北芯生命	342	12,284.64	0.01
8	688635	长进光子	36	11,094.84	0.01
9	688813	泰金新能	60	10,325.40	0.01
10	688785	恒运昌	21	9,726.15	0.01
11	688811	有研复材	248	5,984.24	0.01
12	603459	红板科技	51	4,300.32	0.00
13	603407	长裕集团	53	3,893.38	0.00
14	603435	嘉德利	37	1,728.27	0.00
15	601112	振石股份	77	1,354.43	0.00
16	603352	至信股份	29	740.08	0.00
17	603293	埃泰克	15	508.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	2,142,476.57	2.68
2	688795	摩尔线程	2,124,840.00	2.66
3	688036	传音控股	2,045,729.51	2.56
4	688802	沐曦股份	2,020,990.29	2.53
5	688778	厦钨新能	2,003,320.43	2.51
6	688523	航天环宇	1,824,204.10	2.28
7	688082	盛美上海	1,663,309.95	2.08
8	688981	中芯国际	1,560,185.85	1.95
9	688336	三生国健	1,490,325.77	1.87
10	688255	凯尔达	1,425,047.48	1.78
11	688120	华海清科	1,412,297.45	1.77
12	688188	柏楚电子	1,360,308.46	1.70
13	688008	澜起科技	1,319,845.49	1.65
14	688775	影石创新	1,313,506.66	1.64
15	688472	阿特斯	1,277,347.70	1.60
16	688458	美芯晟	1,260,200.97	1.58
17	688577	浙海德曼	1,256,042.29	1.57
18	688041	海光信息	1,250,680.62	1.57
19	688516	奥特维	1,250,006.06	1.56
20	688578	艾力斯	1,224,973.98	1.53

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	688577	浙海德曼	2,053,577.35	2.57
2	688255	凯尔达	2,050,472.10	2.57

3	688111	金山办公	1,922,967.91	2.41
4	688458	美芯晟	1,920,403.17	2.40
5	688778	厦钨新能	1,888,427.04	2.36
6	688207	格灵深瞳	1,789,739.18	2.24
7	688238	和元生物	1,707,614.05	2.14
8	688215	瑞晟智能	1,684,015.01	2.11
9	688516	奥特维	1,655,972.49	2.07
10	688162	巨一科技	1,639,071.18	2.05
11	688070	纵横股份	1,633,386.03	2.04
12	688282	理工导航	1,620,123.66	2.03
13	688661	和林微纳	1,468,821.17	1.84
14	688036	传音控股	1,458,137.43	1.83
15	688523	航天环宇	1,421,204.42	1.78
16	688265	南模生物	1,401,997.16	1.75
17	688498	源杰科技	1,399,471.42	1.75
18	688004	博汇科技	1,394,284.01	1.75
19	688610	埃科光电	1,390,485.91	1.74
20	688543	国科军工	1,380,432.50	1.73

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	207,345,196.61
卖出股票收入（成交）总额	207,158,355.83

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）	26,001.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,001.00	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	118072	鼎通转债	110	11,000.34	0.01
2	118070	南芯转债	100	10,000.57	0.01
3	118071	华峰转债	50	5,000.09	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

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
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	1,542,528.00	1.62	重大事项停牌
2	688795	摩尔线程	233,544.30	0.24	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	688790	昂瑞微	33,003.45	0.03	新股锁定
2	688781	视涯科技	31,493.52	0.03	新股锁定
3	688808	联讯仪器	30,102.27	0.03	新股锁定
4	688820	盛合晶微	15,988.37	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

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（%）
1,017	41,093.41	13,036,199.00	31.19	28,755,801.00	68.81

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 6 月 5 日）基金份额总额	535,792,000.00
本报告期期初基金份额总额	55,792,000.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	41,792,000.00

§ 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

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）不存在重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）相关从业人员不存在受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信证券股份有限公司	6	414,314,031.33	100.00	77,043.57	100.00	-

华泰证券股份有限公司	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：华泰证券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(%)
中信证券股份有限公司	62,185.21	100.00	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	上海证券报、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 23 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、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 10 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2026 年 6 月 26 日

		金电子披露网站	
--	--	---------	--

§ 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 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增强策略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增强策略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增强策略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增强策略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增强策略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