

东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人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06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	68
10.8 其他重大事件	69
§11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	科创综指ETF东财
场内简称	科创综指ETF东财
基金主代码	589060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年03月19日
基金管理人	东财基金管理有限公司
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	62,137,860.00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03月27日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即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。 但在因特殊情形导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 特殊情形包括但不限于：1、法律法规的限制；2、标的指数成份股流动性严重不足；3、标的指数的成份

	股长期停牌；4、标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；5、标的指数成份股派发现金股息；6、指数成份股定期或临时调整；7、标的指数编制方法发生变化；8、其他基金管理人认定不适合投资的股票或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		东财基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	潘琦
	联系电话	021-23526999	0755-22168257
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	95511-3
传真		021-23526940	0755-82080387
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	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		200030	518001
法定代表人		戴彦	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	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告置备地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

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01月01日 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	42,629,488.43
本期利润	69,452,546.87
加权平均基金份额本期利润	0.6706
本期加权平均净值利润率	43.26%
本期基金份额净值增长率	54.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)
期末可供分配利润	45,082,945.06
期末可供分配基金份额利润	0.7255
期末基金资产净值	131,198,676.77
期末基金份额净值	2.1114
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)
基金份额累计净值增长率	111.14%

- 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（例如：基金的申购赎回费等），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	56.34%	2.34%	55.44%	2.36%	0.90%	-0.02%
过去六个月	54.83%	2.21%	53.71%	2.23%	1.12%	-0.02%
过去一年	106.29%	1.95%	104.19%	1.96%	2.10%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	111.14%	1.93%	97.18%	1.95%	13.96%	-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



注：1、本基金基金合同于2025年3月19日生效。

2、按本基金基金合同约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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

东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2026年6月30日，公司旗下管理62只证券投资基金--东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、东财量化精选混合型发起式证券投资基金、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、东财中证银行指数型发起式证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、东财中证新能源指数增强型证券投资基金、东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞利债券型证券投资基金、东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、东财

中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财启和混合型证券投资基金、东财北证50成份指数增强型发起式证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞兴债券型证券投资基金、东财新兴产业锐选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板100指数型证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金、东财中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
吴逸	本基金基金经理	2025-03-19	-	16年	上海财经大学金融数学与金融工程硕士。曾任天治基金管理有限公司产品创新及量化投资部总监助理、东财基金管理有限公司筹备组量化投资负责人、东财基金管理有限公司研究部总监，现任东财基金管理有限公司总经理助理、量化投资部总监、指数投资部总监、基金经理。
姚楠燕	本基金基金经理助理	2025-03-19	-	9年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、东财基金管理有限公司筹备组成员，现任东财

					基金管理有限公司基金经 理兼基金经理助理。
--	--	--	--	--	--------------------------

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本基金跟踪的标的指数为上证科创板综合价格指数，该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，反映上海证券交易所科创板上市公司证券的整体表现。

报告期内，本基金在运作过程中严格遵守法律法规和基金合同的要求，对基金采取完全被动复制的方式跟踪指数，控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差，力争获取与标的指数相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，科创综指ETF东财份额净值为2.1114元，报告期内基金份额净值增长率为54.83%，同期业绩比较基准收益率为53.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，中国经济延续平稳向新态势，GDP同比增长4.7%，二季度名义GDP增速回升至5.9%，GDP平减指数三年来首次转正；CPI同比上涨1.0%，PPI同比上涨1.5%，城镇调查失业率平均5.2%。

需求端呈现分化。上半年社零同比增长1.3%，其中服务零售额增长5.3%，6月单月增速回升至1.0%。固定资产投资同比下降5.7%，但高技术制造业投资持续高增，航空、航天器及设备制造业投资增长23.3%。出口表现超预期，货物进出口总额同比增长16.9%，高技术产品出口增长39%，集成电路出口增长96.1%。

新质生产力加速壮大，上半年高技术制造业增加值同比增长13.3%，装备制造业增长9.3%，集成电路产量增长23.1%，新动能对经济增长贡献率超四成。

A股方面，上半年极致分化。上证指数、深证成指、沪深300分别上涨3.16%、19.82%、7.55%，科创50大涨64.25%领跑。行业冰火两重天，电子（+86.29%）、通信（+73.59%）、建筑材料（+46.26%）涨幅居前；商贸零售（-29.42%）、农林牧渔（-25.26%）、美容护理（-24.86%）跌幅居前。

展望下半年，中央政治局会议明确实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，新一轮上涨行情有望延续，市场结构性机会或将继续聚焦科技创新、高端制造、数字经济，流动性保持合理充裕，估值修复空间进一步打开。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金

资产净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布基金份额净值。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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：东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,378,512.19	941,108.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	129,920,809.78	254,566,779.45
其中：股票投资		129,920,809.78	254,566,779.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		131,299,321.97	255,507,888.27
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		-	132,204.93

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,116.36	35,847.42
应付托管费		5,038.77	11,949.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	80,490.07	130,000.00
负债合计		100,645.20	310,001.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	62,137,860.00	187,137,860.00
未分配利润	6.4.7.8	69,060,816.77	68,060,026.77
净资产合计		131,198,676.77	255,197,886.77
负债和净资产总计		131,299,321.97	255,507,888.27

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值人民币2.1114元，基金份额总额62,137,860.00份。

6.2 利润表

会计主体：东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年03月19日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		69,690,486.82	2,614,053.96
1.利息收入		1,143.18	43,020.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,143.18	43,020.17
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）		42,868,698.79	-1,380,574.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	42,642,386.80	-2,018,223.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	226,311.99	637,649.68
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	26,823,058.44	3,962,241.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,413.59	-10,633.17
减：二、营业总支出		237,939.95	178,950.74
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	120,435.44	97,079.89
2.托管费	6.4.10.2.2	40,145.11	32,359.97
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	77,359.40	49,510.88

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,452,546.87	2,435,103.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,452,546.87	2,435,103.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		69,452,546.87	2,435,103.22

注：本基金基金合同生效日为2025年3月19日，上年度实际可比期间为2025年3月19日至2025年6月30日。

6.3 净资产变动表

会计主体：东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	187,137,860.00	68,060,026.77	255,197,886.77
二、本期期初净资产	187,137,860.00	68,060,026.77	255,197,886.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-125,000,000.00	1,000,790.00	-123,999,210.00
（一）、综合收益总额	-	69,452,546.87	69,452,546.87
（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）	-125,000,000.00	-68,451,756.87	-193,451,756.87
其中：1.基金申购款	10,000,000.00	6,147,803.52	16,147,803.52

2.基金赎回款	-135,000,000.00	-74,599,560.39	-209,599,560.39
（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	62,137,860.00	69,060,816.77	131,198,676.77
项 目	上年度可比期间 2025年03月19日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	387,137,860.00	-	387,137,860.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-230,000,000.00	3,685,544.03	-226,314,455.97
（一）、综合收益总额	-	2,435,103.22	2,435,103.22
（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）	-230,000,000.00	1,250,440.81	-228,749,559.19
其中：1.基金申购款	30,000,000.00	-1,142,015.49	28,857,984.51
2.基金赎回款	-260,000,000.00	2,392,456.30	-257,607,543.70
（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	157,137,860.00	3,685,544.03	160,823,404.03

注：本基金基金合同生效日为2025年3月19日，上年度实际可比期间为2025年3月19日至2025年6月30日。

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：

顾勇	侯福岩	陆文澄
_____	_____	_____
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

东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金（原西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金，已于2026年4月3日完成更名，以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司（原西藏东财基金管理有限公司，已于2025年9月15日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，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]217号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为387,137,860.00份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（25）第00065号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2025年3月19日正式生效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股或其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、

股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合价格指数收益率。

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》

及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]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》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027年12月31日前，公募证券投资基金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，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

（2）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

（3）对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

（4）对证券投资基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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；

（5）对于证券投资基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券（股票）交易印花税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	500,058.50
等于：本金	500,009.88
加：应计利息	48.62
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	878,453.69
等于：本金	878,432.35
加：应计利息	21.34
减：坏账准备	-
合计	1,378,512.19

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06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	82,756,067.36	-	129,920,809.78	47,164,742.42

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		82,756,067.36	-	129,920,809.78	47,164,742.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用-审计费	17,852.03
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	3,130.67
合计	80,490.07

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	187,137,860.00	187,137,860.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-135,000,000.00	-135,000,000.00
本期末	62,137,860.00	62,137,860.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	54,203,286.05	13,856,740.72	68,060,026.77
本期期初	54,203,286.05	13,856,740.72	68,060,026.77
本期利润	42,629,488.43	26,823,058.44	69,452,546.87
本期基金份额交易产生的变动数	-51,749,829.42	-16,701,927.45	-68,451,756.87
其中：基金申购款	4,997,869.54	1,149,933.98	6,147,803.52
基金赎回款	-56,747,698.96	-17,851,861.43	-74,599,560.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,082,945.06	23,977,871.71	69,060,816.77

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	876.03
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	267.15
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,143.18

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,459,458.54
股票投资收益——赎回差价收入	33,182,928.26
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	42,642,386.80

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	36,283,126.50
减：卖出股票成本总额	26,787,443.55
减：交易费用	36,224.41
买卖股票差价收入	9,459,458.54

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	209,599,560.39
减：现金支付赎回款总额	2,217,732.05
减：赎回股票成本总额	174,198,900.08
减：交易费用	-
赎回差价收入	33,182,928.26

6.4.7.10.4 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	226,311.99
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	226,311.99

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	26,823,058.44
——股票投资	26,823,058.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,823,058.44

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-2,413.59
合计	-2,413.59

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,852.03

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	77,359.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期间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
东财基金管理有限公司	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生应付关联方佣金。

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01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年03月19日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	120,435.44	97,079.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,199.42	22,306.33
应支付基金管理人的净管理费	116,236.02	74,773.56

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年03月19日（基金合同生 效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	40,145.11	32,359.97

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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06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
东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金	34,503,300.00	55.53%	123,573,800.00	66.03%

金联接基金				
东财证券	0.00	0.00%	6,649,160.00	3.55%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年03月19日（基金合同生效日） 至2025年06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	500,058.50	876.03	500,144.26	22,984.83

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	40	3,275.20	63,373.20	-
6888	电科	2026-	6个	新股	9.47	70.14	580	5,49	40,68	-

18	蓝天	02-03	月	限售				2.60	1.20	
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股限售	92.18	463.15	57	5,254.26	26,399.55	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	新股限售	44.56	468.67	48	2,138.88	22,496.16	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	130	3,416.40	22,371.70	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股限售	40.98	308.19	63	2,581.74	19,415.97	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	532	3,410.12	12,837.16	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	109	1,929.30	9,190.88	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股限售	13.86	73.46	107	1,483.02	7,860.22	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股限售	17.52	35.92	129	2,260.08	4,633.68	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股限售	55.95	57.10	81	4,531.95	4,625.10	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股限售	11.18	17.59	200	2,236.00	3,518.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	70	1,103.20	3,269.70	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月	新股限售	22.68	47.61	56	1,270.08	2,666.16	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股限售	21.88	25.52	96	2,100.48	2,449.92	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股限售	37.88	34.87	39	1,477.32	1,359.93	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	29	971.21	983.97	-

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
688260	昀冢科技	2026-06-26	重大事項停牌	144.00	2026-07-01	132.00	1,072	26,127.35	154,368.00	-
688121	卓然股份	2026-05-06	重大事項停牌	6.48	2026-07-07	5.18	2,777	34,256.03	17,994.96	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事項停牌	832.00	2026-07-13	890.99	2,338	728,868.75	1,945,216.00	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事項可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

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

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数基金，采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。若因标的指数编制方法调整，或预期成份股及其权重发生变化（包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等）时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整，以更好地实现本基金的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、合规审计部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了投资银行存款白名单，通过对存款银行的信用评估来控制银行存款信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

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

无。

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

流动性风险是指开放式基金未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因投资品种交易不活跃而出现的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现投资。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等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时间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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,378,512.19	-	-	-	1,378,512.19
交易性金融资产	-	-	-	129,920,809.78	129,920,809.78
资产总计	1,378,512.19	-	-	129,920,809.78	131,299,321.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,116.36	15,116.36
应付托管费	-	-	-	5,038.77	5,038.77
其他负债	-	-	-	80,490.07	80,490.07
负债总计	-	-	-	100,645.20	100,645.20
利率敏感度缺口	1,378,512.19	-	-	129,820,164.58	131,198,676.77
上年度	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

末 2025年1 2月31日					
资产					
货币资 金	941,108.82	-	-	-	941,108.82
交易性 金融资 产	-	-	-	254,566,779.45	254,566,779.45
资产总 计	941,108.82	-	-	254,566,779.45	255,507,888.27
负债					
应付清 算款	-	-	-	132,204.93	132,204.93
应付管 理人报 酬	-	-	-	35,847.42	35,847.42
应付托 管费	-	-	-	11,949.15	11,949.15
其他负 债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总 计	-	-	-	310,001.50	310,001.50
利率敏 感度缺 口	941,108.82	-	-	254,256,777.95	255,197,886.77

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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

本基金本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资，按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，通过指数化分散投资降低其他价格风险。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06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	129,920,809.78	99.03	254,566,779.45	99.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	129,920,809.78	99.03	254,566,779.45	99.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,461,324.90	12,439,552.31
	业绩比较基准下降5%	-6,461,324.90	-12,439,552.31

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：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	127,555,098.32	249,348,221.63
第二层次	2,117,578.96	5,147,317.28
第三层次	248,132.50	71,240.54
合计	129,920,809.78	254,566,779.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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，确定相关金融工具的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2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025年12月31日：同）。

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货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	129,920,809.78	98.95
	其中：股票	129,920,809.78	98.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,378,512.19	1.05
8	其他各项资产	-	-

9	合计	131,299,321.97	100.00
---	----	----------------	--------

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

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	105,060,080.91	80.08
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	22,387,281.47	17.06
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	1,862,333.09	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	362,981.81	0.28
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	129,672,677.28	98.84

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	248,132.50	0.19
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	248,132.50	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	5,458	8,708,511.90	6.64
2	688041	海光信息	19,863	7,355,268.90	5.61
3	688012	中微公司	7,932	3,716,142.00	2.83
4	688008	澜起科技	9,743	3,019,355.70	2.30
5	688795	摩尔线程	3,960	2,837,300.40	2.16
6	688802	沐曦股份	3,405	2,820,361.50	2.15
7	688981	中芯国际	17,208	2,732,974.56	2.08
8	688498	源杰科技	1,167	2,200,962.00	1.68
9	688525	佰维存储	4,034	1,995,740.82	1.52
10	688072	拓荆科技	2,338	1,945,216.00	1.48
11	688082	盛美上海	4,035	1,743,120.00	1.33
12	688146	中船特气	4,845	1,695,701.55	1.29
13	688521	芯原股份	4,455	1,653,428.70	1.26
14	688120	华海清科	4,305	1,386,984.90	1.06
15	688702	盛科通信	3,469	1,352,875.31	1.03
16	688361	中科飞测	3,099	1,332,570.00	1.02
17	688347	华虹宏力	3,408	1,146,110.40	0.87
18	688396	华润微	11,293	1,101,632.15	0.84
19	688126	沪硅产业	27,345	1,090,792.05	0.83
20	688249	晶合集成	17,276	1,019,802.28	0.78
21	688506	百利天恒	3,456	1,016,167.68	0.77
22	688172	燕东微	12,144	1,015,967.04	0.77
23	688183	生益电子	7,076	936,862.40	0.71
24	688766	普冉股份	1,172	898,455.20	0.68
25	688200	华峰测控	1,629	855,387.90	0.65
26	688111	金山办公	3,900	830,895.00	0.63

27	688777	中控技术	6,730	790,775.00	0.60
28	688110	东芯股份	3,876	789,541.20	0.60
29	688409	富创精密	2,574	788,287.50	0.60
30	688469	芯联集成	71,893	762,784.73	0.58
31	688037	芯源微	1,737	762,629.85	0.58
32	688629	华丰科技	3,986	747,414.86	0.57
33	688048	长光华芯	1,468	736,936.00	0.56
34	688519	南亚新材	1,921	730,056.84	0.56
35	688313	仕佳光子	3,886	717,549.90	0.55
36	688271	联影医疗	7,009	709,521.07	0.54
37	688017	绿的谐波	1,543	644,757.98	0.49
38	688147	微导纳米	3,922	634,893.36	0.48
39	688234	天岳先进	3,598	624,288.98	0.48
40	688002	睿创微纳	4,032	623,710.08	0.48
41	688019	安集科技	1,831	621,551.26	0.47
42	688548	广钢气体	11,224	584,770.40	0.45
43	688387	信科移动	29,326	581,827.84	0.44
44	688141	杰华特	3,783	580,690.50	0.44
45	688036	传音控股	9,792	577,238.40	0.44
46	688627	精智达	796	569,140.00	0.43
47	688585	上纬新材	3,411	565,543.80	0.43
48	688630	芯碁微装	996	547,192.44	0.42
49	688047	龙芯中科	3,467	536,240.89	0.41
50	688375	国博电子	5,071	528,905.30	0.40
51	688187	时代电气	7,392	507,534.72	0.39
52	688300	联瑞新材	1,976	482,934.40	0.37
53	688728	格科微	22,393	471,148.72	0.36
54	688775	影石创新	3,393	470,439.45	0.36
55	688549	中巨芯	12,758	469,621.98	0.36
56	688295	中复神鹰	7,657	463,554.78	0.35
57	688027	国盾量子	890	448,568.90	0.34

58	688411	海博思创	1,508	439,129.60	0.33
59	688322	奥比中光	3,352	437,603.60	0.33
60	688220	翱捷科技	3,502	435,368.64	0.33
61	688432	有研硅	10,615	424,281.55	0.32
62	688167	炬光科技	1,180	417,967.80	0.32
63	688545	兴福电子	3,129	416,344.74	0.32
64	688578	艾力斯	3,769	411,574.80	0.31
65	688223	晶科能源	85,628	406,733.00	0.31
66	688336	三生国健	7,606	403,878.60	0.31
67	688331	荣昌生物	3,083	401,591.58	0.31
68	688668	鼎通科技	1,075	401,297.50	0.31
69	688536	思瑞浦	1,060	385,935.40	0.29
70	688025	杰普特	807	379,290.00	0.29
71	688368	晶丰明源	1,688	365,485.76	0.28
72	688099	晶晨股份	3,527	362,928.30	0.28
73	688188	柏楚电子	3,374	360,005.80	0.27
74	688213	思特威	3,352	358,898.64	0.27
75	688009	中国通号	73,933	351,921.08	0.27
76	688502	茂莱光学	502	348,187.20	0.27
77	688127	蓝特光学	3,559	347,358.40	0.26
78	688122	西部超导	5,527	347,150.87	0.26
79	688001	华兴源创	4,021	344,599.70	0.26
80	688449	联芸科技	3,988	344,204.28	0.26
81	688472	阿特斯	31,662	342,582.84	0.26
82	688362	甬矽电子	3,529	340,195.60	0.26
83	688403	汇成股份	8,446	335,306.20	0.26
84	688385	复旦微电	4,683	333,851.07	0.25
85	688248	南网科技	4,796	331,787.28	0.25
86	688676	金盘科技	3,869	327,472.16	0.25
87	688303	大全能源	18,479	322,088.97	0.25
88	688052	纳芯微	1,110	320,024.10	0.24

89	688301	奕瑞科技	2,571	318,804.00	0.24
90	688102	斯瑞新材	6,569	309,925.42	0.24
91	688257	新锐股份	3,039	309,674.10	0.24
92	688538	和辉光电	118,434	307,928.40	0.23
93	688233	神工股份	1,405	301,260.10	0.23
94	688433	华曙高科	3,467	296,775.20	0.23
95	688065	凯赛生物	6,138	293,703.30	0.22
96	688195	腾景科技	1,519	292,529.02	0.22
97	688268	华特气体	1,075	287,562.50	0.22
98	688568	中科星图	6,871	284,940.37	0.22
99	688599	天合光能	20,011	282,555.32	0.22
100	688652	京仪装备	1,380	276,234.60	0.21
101	688123	聚辰股份	1,277	271,490.20	0.21
102	688503	聚和材料	2,018	267,788.60	0.20
103	688266	泽璟制药	2,291	267,268.06	0.20
104	688205	德科立	1,277	265,858.63	0.20
105	688235	百济神州	1,019	259,447.59	0.20
106	688343	云天励飞	3,175	259,270.50	0.20
107	688018	乐鑫科技	1,999	255,712.08	0.19
108	688400	凌云光	3,855	255,201.00	0.19
109	688372	伟测科技	1,345	250,170.00	0.19
110	688800	瑞可达	2,575	247,122.75	0.19
111	688388	嘉元科技	5,590	245,960.00	0.19
112	688352	颀中科技	10,111	244,483.98	0.19
113	688692	达梦数据	1,000	244,290.00	0.19
114	688531	日联科技	1,355	240,973.20	0.18
115	688097	博众精工	3,800	239,590.00	0.18
116	688297	中无人机	5,743	238,621.65	0.18
117	688333	铂力特	2,330	238,592.00	0.18
118	688700	东威科技	2,643	236,284.20	0.18
119	688150	莱特光电	3,424	234,954.88	0.18

120	688332	中科蓝讯	1,491	234,832.50	0.18
121	688603	天承科技	1,122	233,319.90	0.18
122	688308	欧科亿	1,283	233,262.23	0.18
123	688392	骄成超声	1,026	233,086.68	0.18
124	689009	九号公司	6,095	232,524.25	0.18
125	688778	厦钨新能	4,266	232,070.40	0.18
126	688608	恒玄科技	1,388	232,059.72	0.18
127	688757	胜科纳米	3,416	227,847.20	0.17
128	688318	财富趋势	3,165	225,696.15	0.17
129	688380	中微半导	3,344	220,403.04	0.17
130	688180	君实生物	6,516	220,371.12	0.17
131	688390	固德威	2,030	220,275.30	0.17
132	688582	芯动联科	3,355	218,075.00	0.17
133	688003	天准科技	1,659	211,190.70	0.16
134	688484	南芯科技	3,688	208,335.12	0.16
135	688709	成都华微	5,418	206,371.62	0.16
136	688349	三一重能	13,564	205,901.52	0.16
137	688169	石头科技	2,161	205,230.17	0.16
138	688143	长盈通	1,165	204,900.20	0.16
139	688584	上海合晶	5,673	203,944.35	0.16
140	688535	华海诚科	1,089	203,643.00	0.16
141	688507	索辰科技	744	200,641.92	0.15
142	688617	惠泰医疗	1,094	198,626.64	0.15
143	688596	正帆科技	2,490	196,859.40	0.15
144	688563	航材股份	3,831	196,262.13	0.15
145	688278	特宝生物	3,598	195,731.20	0.15
146	688625	呈和科技	2,314	195,324.74	0.15
147	688661	和林微纳	1,210	192,365.80	0.15
148	688772	珠海冠宇	9,699	190,391.37	0.15
149	688615	合合信息	1,677	189,668.70	0.14
150	688106	金宏气体	4,547	188,609.56	0.14

151	688006	杭可科技	5,136	187,720.80	0.14
152	688028	沃尔德	1,200	187,044.00	0.14
153	688005	容百科技	6,084	186,170.40	0.14
154	688686	奥普特	1,095	184,387.05	0.14
155	688425	铁建重工	45,734	183,850.68	0.14
156	688819	天能股份	8,266	183,505.20	0.14
157	688475	萤石网络	6,703	183,327.05	0.14
158	688605	先锋精科	1,745	181,514.90	0.14
159	688523	航天环宇	3,462	181,408.80	0.14
160	688559	海目星	2,150	180,428.00	0.14
161	688114	华大智造	3,524	180,005.92	0.14
162	688726	拉普拉斯	3,387	179,002.95	0.14
163	688279	峰昭科技	788	176,858.72	0.13
164	688131	皓元医药	1,848	174,820.80	0.13
165	688610	埃科光电	648	170,683.20	0.13
166	688708	佳驰科技	3,340	169,672.00	0.13
167	688059	华锐精密	848	169,354.08	0.13
168	688020	方邦股份	673	167,980.80	0.13
169	688359	三孚新科	843	167,284.92	0.13
170	688281	华秦科技	3,313	166,411.99	0.13
171	688383	新益昌	882	165,851.28	0.13
172	688055	龙腾光电	28,612	164,805.12	0.13
173	688206	概伦电子	3,647	161,817.39	0.12
174	688515	裕太微	648	161,196.48	0.12
175	688662	富信科技	956	160,608.00	0.12
176	688401	路维光电	1,649	158,271.02	0.12
177	688516	奥特维	2,728	156,559.92	0.12
178	688192	迪哲医药	3,878	154,848.54	0.12
179	688260	昀冢科技	1,072	154,368.00	0.12
180	688107	安路科技	3,349	152,714.40	0.12
181	688593	新相微	3,885	151,204.20	0.12

182	688319	欧林生物	3,392	149,180.16	0.11
183	688363	华熙生物	4,168	149,089.36	0.11
184	688690	纳微科技	3,379	149,013.90	0.11
185	688275	万润新能	1,136	144,896.80	0.11
186	688798	艾为电子	1,967	144,220.44	0.11
187	688208	道通科技	5,703	143,658.57	0.11
188	688182	灿勤科技	3,332	143,509.24	0.11
189	688158	优刻得	3,836	141,011.36	0.11
190	688561	奇安信	5,807	139,251.86	0.11
191	688353	华盛锂电	1,181	137,078.67	0.10
192	688520	神州细胞	3,978	136,087.38	0.10
193	688779	五矿新能	16,608	134,690.88	0.10
194	688100	威胜信息	4,289	131,200.51	0.10
195	688090	瑞松科技	1,226	130,507.70	0.10
196	688262	国芯科技	2,974	128,566.02	0.10
197	688258	卓易信息	1,084	128,497.36	0.10
198	688138	清溢光电	2,699	126,853.00	0.10
199	688378	奥来德	2,042	126,604.00	0.10
200	688530	欧莱新材	1,296	125,582.40	0.10
201	688456	有研粉材	898	125,360.80	0.10
202	688031	星环科技	1,084	124,855.12	0.10
203	688691	灿芯股份	1,072	124,276.96	0.09
204	688337	普源精电	1,654	123,934.22	0.09
205	688166	博瑞医药	3,538	123,865.38	0.09
206	688416	恒烁股份	884	123,760.00	0.09
207	688116	天奈科技	3,225	123,195.00	0.09
208	688720	艾森股份	1,210	122,210.00	0.09
209	688088	虹软科技	3,410	121,225.50	0.09
210	688376	美埃科技	1,033	120,137.90	0.09
211	688153	唯捷创芯	3,658	117,494.96	0.09
212	688381	帝奥微	2,180	116,630.00	0.09

213	688669	聚石化学	1,086	116,202.00	0.09
214	688261	东微半导	1,099	115,318.07	0.09
215	688029	南微医学	1,591	114,233.80	0.09
216	688063	派能科技	2,107	112,239.89	0.09
217	688371	菲沃泰	2,861	111,550.39	0.09
218	688209	英集芯	3,808	110,736.64	0.08
219	688327	云从科技	8,831	110,034.26	0.08
220	688125	安达智能	670	109,545.00	0.08
221	688567	孚能科技	10,405	109,252.50	0.08
222	688677	海泰新光	1,070	108,209.10	0.08
223	688306	均普智能	10,637	107,433.70	0.08
224	688222	成都先导	3,344	107,375.84	0.08
225	688717	艾罗能源	1,295	106,928.15	0.08
226	688079	美迪凯	3,455	106,241.25	0.08
227	688612	威迈斯	3,549	105,014.91	0.08
228	688231	隆达股份	2,843	104,423.39	0.08
229	688227	品高股份	998	102,484.62	0.08
230	688035	德邦科技	1,107	101,622.60	0.08
231	688321	微芯生物	3,767	99,185.11	0.08
232	688016	心脉医疗	1,106	98,035.84	0.07
233	688698	伟创电气	1,866	97,871.70	0.07
234	688660	电气风电	11,342	97,768.04	0.07
235	688628	优利德	984	97,356.96	0.07
236	688190	云路股份	1,072	97,241.12	0.07
237	688663	新风光	1,098	97,129.08	0.07
238	688239	航宇科技	1,620	96,924.60	0.07
239	688312	燕麦科技	1,151	96,672.49	0.07
240	688191	智洋创新	2,705	96,568.50	0.07
241	688486	龙迅股份	1,498	95,242.84	0.07
242	688112	鼎阳科技	1,291	94,836.86	0.07
243	688198	佰仁医疗	1,060	94,594.40	0.07

244	688478	晶升股份	1,066	94,394.30	0.07
245	688062	迈威生物	3,336	94,242.00	0.07
246	688032	禾迈股份	1,115	94,239.80	0.07
247	688556	高测股份	7,064	93,809.92	0.07
248	688351	微电生理	4,118	93,313.88	0.07
249	688518	联赢激光	3,018	93,256.20	0.07
250	688325	赛微微电	713	92,982.33	0.07
251	688155	先惠技术	1,140	92,214.60	0.07
252	688083	中望软件	1,398	90,520.50	0.07
253	688093	世华科技	2,445	90,220.50	0.07
254	688598	金博股份	1,822	90,097.90	0.07
255	688165	埃夫特	4,413	90,025.20	0.07
256	688307	中润光学	1,117	89,304.15	0.07
257	688583	思看科技	1,032	88,514.64	0.07
258	688382	益方生物	4,913	88,434.00	0.07
259	688689	银河微电	1,366	88,407.52	0.07
260	688508	芯朋微	946	87,940.16	0.07
261	688611	杭州柯林	1,225	87,526.25	0.07
262	688170	德龙激光	895	85,928.95	0.07
263	688787	海天瑞声	639	85,913.55	0.07
264	688179	阿拉丁	3,086	85,513.06	0.07
265	688323	瑞华泰	1,507	85,145.50	0.06
266	688046	药康生物	3,492	84,506.40	0.06
267	688711	宏微科技	1,858	84,446.10	0.06
268	688128	中国电研	3,512	83,374.88	0.06
269	688550	瑞联新材	1,439	83,246.15	0.06
270	688160	步科股份	763	82,991.51	0.06
271	688543	国科军工	2,099	82,805.55	0.06
272	688202	美迪西	1,024	82,647.04	0.06
273	688230	芯导科技	1,046	82,435.26	0.06
274	688788	科思科技	1,829	82,268.42	0.06

275	688135	利扬芯片	1,954	82,224.32	0.06
276	688252	天德钰	3,425	82,200.00	0.06
277	688678	福立旺	3,330	80,486.10	0.06
278	688789	宏华数科	1,510	80,286.70	0.06
279	688552	航天南湖	2,852	80,226.76	0.06
280	688419	耐科装备	1,014	79,751.10	0.06
281	688439	振华风光	1,719	79,417.80	0.06
282	688699	明微电子	966	79,163.70	0.06
283	688418	震有科技	1,640	78,851.20	0.06
284	688586	江航装备	6,744	78,837.36	0.06
285	688719	爱科赛博	1,023	78,771.00	0.06
286	688105	诺唯赞	4,523	78,474.05	0.06
287	688693	锆威特	752	78,170.40	0.06
288	688386	泛亚微透	856	76,903.04	0.06
289	688328	深科达	801	76,655.70	0.06
290	688758	赛分科技	3,479	76,572.79	0.06
291	688485	九州一轨	1,193	76,423.58	0.06
292	688326	经纬恒润	1,071	75,912.48	0.06
293	688443	智翔金泰	3,199	74,376.75	0.06
294	688710	益诺思	1,094	73,516.80	0.06
295	688697	纽威数控	5,396	73,331.64	0.06
296	688161	威高骨科	3,478	72,968.44	0.06
297	688499	利元亨	1,388	72,939.40	0.06
298	688522	纳睿雷达	3,625	72,572.50	0.06
299	688091	上海谊众	1,804	72,520.80	0.06
300	688139	海尔生物	2,704	71,439.68	0.05
301	688733	壹石通	1,717	70,997.95	0.05
302	688480	赛恩斯	810	70,947.90	0.05
303	688221	前沿生物	3,164	70,873.60	0.05
304	688289	圣湘生物	4,880	70,272.00	0.05
305	688226	威腾电气	1,600	68,528.00	0.05

306	688049	炬芯科技	1,456	68,300.96	0.05
307	688739	成大生物	3,479	67,805.71	0.05
308	688379	华光新材	806	67,728.18	0.05
309	688068	热景生物	782	67,721.20	0.05
310	688428	诺诚健华	2,368	67,416.96	0.05
311	688551	科威尔	958	67,318.66	0.05
312	688591	泰凌微	1,951	67,075.38	0.05
313	688479	友车科技	1,741	66,105.77	0.05
314	688667	菱电电控	494	66,023.10	0.05
315	688173	希荻微	3,441	65,860.74	0.05
316	688786	悦安新材	1,429	65,848.32	0.05
317	688305	科德数控	1,008	65,792.16	0.05
318	688277	天智航	3,840	65,664.00	0.05
319	688512	慧智微	4,085	65,237.45	0.05
320	688750	金天钛业	3,914	65,089.82	0.05
321	688513	苑东生物	1,471	64,665.16	0.05
322	688108	赛诺医疗	3,484	64,558.52	0.05
323	688168	安博通	934	64,212.50	0.05
324	688181	八亿时空	1,025	64,165.00	0.05
325	688653	康希通信	3,683	64,010.54	0.05
326	688685	迈信林	1,161	63,738.90	0.05
327	688253	英诺特	1,052	63,414.56	0.05
328	688010	福光股份	1,301	63,267.63	0.05
329	688623	双元科技	627	62,988.42	0.05
330	688631	莱斯信息	1,332	62,484.12	0.05
331	688408	中信博	1,921	61,760.15	0.05
332	688601	力芯微	1,017	61,579.35	0.05
333	688448	磁谷科技	965	61,335.40	0.05
334	688219	会通股份	4,679	60,546.26	0.05
335	688103	国力电子	810	60,272.10	0.05
336	688050	爱博医疗	1,649	60,106.05	0.05

337	688011	新光光电	860	60,088.20	0.05
338	688721	龙图光罩	1,015	59,255.70	0.05
339	688290	景业智能	883	58,595.88	0.04
340	688177	百奥泰	3,467	58,314.94	0.04
341	688776	国光电气	949	58,211.66	0.04
342	688218	江苏北人	1,057	58,092.72	0.04
343	688577	浙海德曼	1,251	57,333.33	0.04
344	688626	翔宇医疗	1,295	57,316.70	0.04
345	688365	光云科技	3,620	57,087.40	0.04
346	688665	四方光电	866	56,896.20	0.04
347	688286	敏芯股份	494	56,844.58	0.04
348	688553	汇宇制药	5,256	55,871.28	0.04
349	688087	英科再生	1,656	55,343.52	0.04
350	688707	振华新材	4,295	55,190.75	0.04
351	688045	必易微	681	55,011.18	0.04
352	688655	迅捷兴	1,014	54,309.84	0.04
353	688621	阳光诺和	987	54,196.17	0.04
354	688656	浩欧博	552	53,417.04	0.04
355	688210	统联精密	1,315	53,270.65	0.04
356	688620	安凯微	3,266	52,909.20	0.04
357	688007	光峰科技	3,975	52,867.50	0.04
358	688636	智明达	1,443	52,279.89	0.04
359	688291	金橙子	888	51,930.24	0.04
360	688570	天玛智控	3,635	51,726.05	0.04
361	688185	康希诺	1,012	51,601.88	0.04
362	688510	航亚科技	2,148	51,294.24	0.04
363	688115	思林杰	620	50,995.00	0.04
364	688345	博力威	872	50,645.76	0.04
365	688061	灿瑞科技	1,017	50,514.39	0.04
366	688562	航天软件	3,336	50,240.16	0.04
367	688117	圣诺生物	1,855	50,140.65	0.04

368	688539	高华科技	1,570	50,051.60	0.04
369	688232	新点软件	2,813	50,015.14	0.04
370	688320	禾川科技	1,200	49,740.00	0.04
371	688356	键凯科技	643	49,562.44	0.04
372	688595	芯海科技	1,127	49,430.22	0.04
373	688228	开普云	639	49,420.26	0.04
374	688334	西高院	2,720	49,340.80	0.04
375	688276	百克生物	3,518	49,040.92	0.04
376	688658	悦康药业	3,780	48,610.80	0.04
377	688109	品茗科技	635	48,069.50	0.04
378	688176	亚虹医药	4,820	47,814.40	0.04
379	688366	昊海生科	1,656	47,808.72	0.04
380	688101	三达膜	2,885	47,689.05	0.04
381	688526	科前生物	3,930	47,553.00	0.04
382	688163	赛伦生物	947	46,223.07	0.04
383	688609	九联科技	4,192	46,153.92	0.04
384	688095	福昕软件	768	45,642.24	0.03
385	688119	中钢洛耐	9,587	45,538.25	0.03
386	688488	艾迪药业	3,529	45,347.65	0.03
387	688199	久日新材	1,308	45,165.24	0.03
388	688293	奥浦迈	1,076	44,858.44	0.03
389	688151	华强科技	3,009	44,743.83	0.03
390	688069	德林海	1,196	44,682.56	0.03
391	688505	复旦张江	6,036	44,545.68	0.03
392	688377	迪威尔	1,876	44,236.08	0.03
393	688696	极米科技	684	44,145.36	0.03
394	688566	吉贝尔	1,713	43,835.67	0.03
395	688348	昱能科技	1,256	43,683.68	0.03
396	688207	格灵深瞳	2,168	43,576.80	0.03
397	688315	诺禾致源	3,478	43,509.78	0.03
398	688580	伟思医疗	815	43,415.05	0.03

399	688683	莱尔科技	1,138	43,152.96	0.03
400	688216	气派科技	1,016	42,682.16	0.03
401	688282	理工导航	733	42,660.60	0.03
402	688575	亚辉龙	4,864	42,608.64	0.03
403	688799	华纳药厂	946	42,447.02	0.03
404	688225	亚信安全	3,411	42,364.62	0.03
405	688299	长阳科技	2,509	41,925.39	0.03
406	688360	德马科技	2,330	41,707.00	0.03
407	688196	卓越新能	1,148	41,213.20	0.03
408	688056	莱伯泰科	637	41,118.35	0.03
409	688073	毕得医药	763	41,064.66	0.03
410	688458	美芯晟	982	41,008.32	0.03
411	688410	山外山	2,834	40,696.24	0.03
412	688450	光格科技	606	40,595.94	0.03
413	688237	超卓航科	750	40,065.00	0.03
414	688679	通源环境	951	40,027.59	0.03
415	688084	晶品特装	788	39,620.64	0.03
416	688211	中科微至	1,150	39,583.00	0.03
417	688558	国盛智科	1,199	39,399.14	0.03
418	688197	首药控股	1,179	39,390.39	0.03
419	688633	星球石墨	1,323	39,332.79	0.03
420	688309	恒誉环保	641	39,024.08	0.03
421	688267	中触媒	1,967	38,749.90	0.03
422	688350	富淼科技	1,120	38,673.60	0.03
423	688229	博睿数据	503	38,580.10	0.03
424	688259	创耀科技	984	38,494.08	0.03
425	688767	博拓生物	1,184	38,491.84	0.03
426	688648	中邮科技	1,041	38,048.55	0.03
427	688768	容知日新	732	37,727.28	0.03
428	688607	康众医疗	734	37,434.00	0.03
429	688085	三友医疗	3,103	37,142.91	0.03

430	688148	芳源股份	4,315	37,022.70	0.03
431	688330	宏力达	1,084	36,671.72	0.03
432	688391	钜泉科技	1,021	36,623.27	0.03
433	688081	兴图新科	892	36,464.96	0.03
434	688039	当虹科技	972	36,275.04	0.03
435	688283	坤恒顺维	1,091	36,123.01	0.03
436	688311	盟升电子	1,379	36,116.01	0.03
437	688136	科兴制药	1,733	35,890.43	0.03
438	688057	金达莱	2,326	35,843.66	0.03
439	688398	赛特新材	1,378	35,703.98	0.03
440	688236	春立医疗	2,466	35,658.36	0.03
441	688186	广大特材	2,341	35,466.15	0.03
442	688500	慧辰股份	781	35,402.73	0.03
443	688272	富吉瑞	794	35,253.60	0.03
444	688389	普门科技	3,596	35,204.84	0.03
445	688680	海优新材	834	35,028.00	0.03
446	688159	有方科技	785	34,846.15	0.03
447	688602	康鹏科技	4,406	34,719.28	0.03
448	688657	浩辰软件	962	34,410.74	0.03
449	688716	中研股份	1,089	34,227.27	0.03
450	688682	霍莱沃	879	34,193.10	0.03
451	688600	皖仪科技	1,027	34,178.56	0.03
452	688175	高凌信息	1,358	34,153.70	0.03
453	688075	安旭生物	1,147	34,134.72	0.03
454	688581	安杰思	660	34,128.60	0.03
455	688429	时创能源	3,329	33,922.51	0.03
456	688511	天微电子	1,109	33,502.89	0.03
457	688459	哈铁科技	4,019	33,478.27	0.03
458	688273	麦澜德	860	33,316.40	0.03
459	688157	松井股份	1,258	33,198.62	0.03
460	688639	华恒生物	2,055	33,167.70	0.03

461	688080	映翰通	751	32,480.75	0.02
462	688023	安恒信息	882	32,387.04	0.02
463	688489	三未信安	1,407	31,938.90	0.02
464	688588	凌志软件	3,491	31,733.19	0.02
465	688571	杭华股份	3,602	31,517.50	0.02
466	688339	亿华通	1,675	31,322.50	0.02
467	688399	硕世生物	689	31,273.71	0.02
468	688755	汉邦科技	1,134	31,253.04	0.02
469	688298	东方生物	1,736	31,004.96	0.02
470	688215	瑞晟智能	758	30,441.28	0.02
471	688130	晶华微	1,081	30,397.72	0.02
472	688171	纬德信息	688	30,244.48	0.02
473	688358	祥生医疗	988	30,203.16	0.02
474	688212	澳华内镜	1,027	30,193.80	0.02
475	688238	和元生物	5,522	29,929.24	0.02
476	688302	海创药业	849	29,859.33	0.02
477	688618	三旺通信	968	29,785.36	0.02
478	688269	凯立新材	938	29,743.98	0.02
479	688569	铁科轨道	1,832	29,586.80	0.02
480	688247	宣泰医药	3,929	29,546.08	0.02
481	688098	申联生物	3,437	29,523.83	0.02
482	688590	新致软件	2,329	28,949.47	0.02
483	688133	泰坦科技	1,343	28,377.59	0.02
484	688129	东来技术	1,077	28,206.63	0.02
485	688335	复洁科技	1,172	28,174.88	0.02
486	688509	正元地信	6,545	28,012.60	0.02
487	688533	上声电子	1,326	27,660.36	0.02
488	688280	精进电动	5,023	27,576.27	0.02
489	688557	兰剑智能	888	27,554.64	0.02
490	688722	同益中	1,807	27,412.19	0.02
491	688338	赛科希德	925	27,296.75	0.02

492	688070	纵横股份	728	27,176.24	0.02
493	688096	京源环保	2,029	27,107.44	0.02
494	688592	司南导航	653	27,060.32	0.02
495	688077	大地熊	1,013	26,834.37	0.02
496	688255	凯尔达	964	26,799.20	0.02
497	688589	力合微	1,147	26,358.06	0.02
498	688606	奥泰生物	640	26,291.20	0.02
499	688156	路德科技	867	26,226.75	0.02
500	688455	科捷智能	1,381	25,769.46	0.02
501	688579	地纬智能	3,352	25,441.68	0.02
502	688071	华依科技	698	25,435.12	0.02
503	688619	罗普特	1,565	25,399.95	0.02
504	688357	建龙微纳	860	25,344.20	0.02
505	688373	盟科药业	5,570	25,232.10	0.02
506	688651	盛邦安全	783	25,228.26	0.02
507	688193	仁度生物	454	25,106.20	0.02
508	688162	巨一科技	1,053	24,892.92	0.02
509	688317	之江生物	1,636	24,867.20	0.02
510	688137	近岸蛋白	687	24,732.00	0.02
511	688015	交控科技	1,599	24,592.62	0.02
512	688152	麒麟信安	890	24,457.20	0.02
513	688367	工大高科	729	24,275.70	0.02
514	688030	山石网科	1,510	23,842.90	0.02
515	688292	浩瀚深度	1,278	23,770.80	0.02
516	688178	万德斯	701	23,700.81	0.02
517	688285	高铁电气	3,299	23,653.83	0.02
518	688687	凯因科技	1,411	23,013.41	0.02
519	688718	唯赛勃	1,441	23,012.77	0.02
520	688316	青云科技	418	22,572.00	0.02
521	688671	碧兴物联	632	22,480.24	0.02
522	688314	康拓医疗	661	22,394.68	0.02

523	688251	井松智能	868	22,246.84	0.02
524	688370	丛麟科技	1,053	22,028.76	0.02
525	688435	英方软件	685	21,920.00	0.02
526	688246	嘉和美康	1,058	21,741.90	0.02
527	688529	豪森智能	1,382	21,738.86	0.02
528	688265	南模生物	626	21,653.34	0.02
529	688369	致远互联	1,021	21,451.21	0.02
530	688355	明志科技	1,114	21,444.50	0.02
531	688501	青达环保	1,116	21,427.20	0.02
532	688060	云涌科技	638	20,983.82	0.02
533	688310	迈得医疗	1,361	20,918.57	0.02
534	688560	明冠新材	1,733	20,536.05	0.02
535	688737	中自科技	1,067	20,422.38	0.02
536	688576	西山科技	508	20,243.80	0.02
537	688113	联测科技	572	20,077.20	0.02
538	688468	科美诊断	3,526	20,062.94	0.02
539	688597	煜邦电力	2,917	18,960.50	0.01
540	688670	金迪克	1,106	18,735.64	0.01
541	688517	金冠电气	1,048	18,319.04	0.01
542	688426	康为世纪	992	18,193.28	0.01
543	688121	卓然股份	2,777	17,994.96	0.01
544	688203	海正生材	1,748	17,445.04	0.01
545	688038	中科通达	1,033	17,375.06	0.01
546	688244	永信至诚	1,200	17,112.00	0.01
547	688026	洁特生物	1,087	17,076.77	0.01
548	688638	誉辰智能	544	16,956.48	0.01
549	688329	艾隆科技	816	16,491.36	0.01
550	688013	天臣医疗	660	16,282.20	0.01
551	688132	邦彦技术	1,213	15,950.95	0.01
552	688118	普元信息	789	15,874.68	0.01
553	688395	正弦电气	718	15,867.80	0.01

554	688420	美腾科技	737	15,528.59	0.01
555	688021	奥福科技	802	15,526.72	0.01
556	688078	龙软科技	737	15,513.85	0.01
557	688288	鸿泉技术	858	15,246.66	0.01
558	688616	西力科技	1,501	15,160.10	0.01
559	688613	奥精医疗	1,052	14,843.72	0.01
560	688573	信宇人	836	14,813.92	0.01
561	688089	嘉必优	1,384	14,684.24	0.01
562	688092	爱科科技	676	14,358.24	0.01
563	688051	佳华科技	619	14,224.62	0.01
564	688466	金科环境	1,105	14,177.15	0.01
565	688393	安必平	792	14,081.76	0.01
566	688659	元琛科技	1,295	13,519.80	0.01
567	688695	中创股份	701	13,108.70	0.01
568	688067	爱威科技	648	13,057.20	0.01
569	688058	宝兰德	624	13,054.08	0.01
570	688681	科汇股份	909	12,707.82	0.01
571	688528	秦川物联	1,380	12,613.20	0.01
572	688004	博汇科技	649	11,811.80	0.01
573	688793	倍轻松	711	11,454.21	0.01
574	688565	力源科技	1,188	11,226.60	0.01
575	688217	睿昂基因	543	11,218.38	0.01
576	688296	和达科技	943	10,787.92	0.01
577	688701	卓锦股份	1,185	8,923.05	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	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.05

2	688818	电科蓝天	580	40,681.20	0.03
3	688785	恒运昌	57	26,399.55	0.02
4	688797	臻宝科技	48	22,496.16	0.02
5	688813	泰金新能	130	22,371.70	0.02
6	688635	长进光子	63	19,415.97	0.01
7	688811	有研复材	532	12,837.16	0.01
8	603459	红板科技	109	9,190.88	0.01
9	603407	长裕集团	107	7,860.22	0.01
10	688712	北芯生命	129	4,633.68	0.00
11	688816	易思维	81	4,625.10	0.00
12	601112	振石股份	200	3,518.00	0.00
13	603435	嘉德利	70	3,269.70	0.00
14	688781	视涯科技	56	2,666.16	0.00
15	603352	至信股份	96	2,449.92	0.00
16	603284	林平发展	39	1,359.93	0.00
17	603293	埃泰克	29	983.97	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	4,483,204.75	1.76
2	688802	沐曦股份	3,615,860.67	1.42
3	688411	海博思创	940,320.47	0.37
4	688200	华峰测控	740,930.25	0.29
5	688766	普冉股份	630,570.94	0.25
6	688617	惠泰医疗	605,005.80	0.24
7	688630	芯碁微装	588,246.29	0.23
8	688615	合合信息	584,450.09	0.23

9	688536	思瑞浦	541,616.14	0.21
10	688019	安集科技	494,451.22	0.19
11	688052	纳芯微	461,249.46	0.18
12	688668	鼎通科技	442,085.75	0.17
13	688048	长光华芯	432,364.44	0.17
14	688205	德科立	384,750.14	0.15
15	688017	绿的谐波	384,073.43	0.15
16	688608	恒玄科技	378,966.08	0.15
17	688372	伟测科技	350,986.03	0.14
18	688757	胜科纳米	323,524.49	0.13
19	688545	兴福电子	316,564.55	0.12
20	688018	乐鑫科技	313,807.82	0.12

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

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	1,574,964.77	0.62
2	688027	国盾量子	1,099,984.97	0.43
3	688012	中微公司	770,547.30	0.30
4	688235	百济神州	562,514.34	0.22
5	688692	达梦数据	558,548.84	0.22
6	688041	海光信息	556,568.55	0.22
7	688627	精智达	506,053.98	0.20
8	688167	炬光科技	505,469.45	0.20
9	688256	寒武纪	454,632.00	0.18
10	688025	杰普特	426,300.63	0.17
11	688270	ST臻镭	422,770.86	0.17
12	688502	茂莱光学	407,374.18	0.16

13	688031	星环科技	360,913.24	0.14
14	688279	峰昭科技	358,650.21	0.14
15	688635	长进光子	352,840.00	0.14
16	688818	电科蓝天	344,697.54	0.14
17	688125	安达智能	301,709.14	0.12
18	688392	骄成超声	301,046.80	0.12
19	688808	联讯仪器	300,907.08	0.12
20	688258	卓易信息	285,170.77	0.11

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,500,031.61
卖出股票收入（成交）总额	36,283,126.50

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票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未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	1,945,216.00	1.48	停牌

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	688808	联讯仪器	63,373.20	0.05	新股限售
2	688818	电科蓝天	40,681.20	0.03	新股限售
3	688785	恒运昌	26,399.55	0.02	新股限售
4	688797	臻宝科技	22,496.16	0.02	新股限售

5	688813	泰金新能	22,371.70	0.02	新股限售
---	--------	------	-----------	------	------

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,472	25,136.67	36,348,760.00	58.50%	25,789,100.00	41.50%	34,503,300.00	55.53%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

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03月19日)基金份额总额	387,137,860.00
本报告期期初基金份额总额	187,137,860.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	135,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,137,860.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：（1）自2026年2月13日起，倪永彪新任基金管理人督察长，离任总经理助理；沙福贵不再代任督察长。（2）自2026年2月27日起，顾勇新任基金管理人总经理、财务负责人，离任副总经理；沙福贵离任总经理、财务负责人。（3）根据基金管理人2026年2月28日发布的《东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告》，基金管理人近12个月内进行了董事变更。

基金托管人：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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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	
金融街证券	4	69,343,151.10	100.00%	13,585.20	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：

- (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
- (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	证监会规定网站	2026-01-22
2	东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2026-01-29
3	东财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	证监会规定网站及报刊	2026-02-09
4	东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-14
5	东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
6	东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
7	东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	证监会规定网站及报刊	2026-03-31

8	西藏东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告	证监会规定网站	2026-03-31
9	东财基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金全称的公告	证监会规定网站及报刊	2026-04-03
10	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-04-03
11	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金托管协议	证监会规定网站	2026-04-03
12	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同	证监会规定网站	2026-04-03
13	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	证监会规定网站	2026-04-03
14	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
15	东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告	证监会规定网站及报刊	2026-05-13
16	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
17	东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	2026-06-27

§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
ETF联接基金	1	2026-01-01至2026-06-30	123,573,800.00	4,355,500.00	93,426,000.00	34,503,300.00	55.53%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 三、《东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日