

鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证
券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
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
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
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	12
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	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	57

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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏华科创板综合 ETF
场内简称	科创综 Z（扩位简称:科创综指 ETF 鹏华）
基金主代码	589680
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 26 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,009,943,666.00 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 3 月 5 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的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。 1、组合复制策略 本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2%以内，年跟踪误差控制在 2%以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、替代性策略 在因特殊情形导致基金无法投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 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）标的指数的成份股票长期停牌；（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限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 本基金在适当情形下还将参与固定收益品种及其他符合基金合同约定的品种的投资。

	3、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 4、债券投资策略 本基金债券投资组合将采用自上而下的投资策略，根据宏观经济分析、资金面动向分析等判断未来利率变化，并利用债券定价技术，进行个券选择。 本基金可投资可转换债券及可交换债券，可转换债券及可交换债券兼具债权和股权双重属性，本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和债券价值分析综合开展投资决策。 5、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。同时，本基金将力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，从而达到稳定投资组合资产净值的目的。 基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 7、融资及转融通投资策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎经营原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。本基金将在分析市场环境、投资者类型与结构、基金历史申赎情况、出借证券流动性情况等因素的基础上，合理确定出借证券的范围、期限和比例。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新公告。
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，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险、

	投资集中风险等。
--	----------

注：无。

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		鹏华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高永杰	许俊
	联系电话	0755-81395402	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@phfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4006788533	95566
传真		0755-82021126	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		张纳沙	葛海蛟

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	http://www.phfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

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	250,191,727.10
本期利润	560,941,984.29
加权平均基金份额本期利润	0.7200
本期加权平均净值利润率	48.22%
本期基金份额净值增长率	52.22%
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	673,881,043.28
期末可供分配基金份额利润	0.6672
期末基金资产净值	1,981,173,211.18

期末基金份额净值	1.9617
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	96.17%

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等未实现收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	54.08%	2.31%	55.71%	2.36%	-1.63%	-0.05%
过去六个月	52.22%	2.18%	53.99%	2.23%	-1.77%	-0.05%
过去一年	100.54%	1.91%	104.94%	1.96%	-4.40%	-0.05%
自基金合同生效起至今	96.17%	1.88%	99.01%	1.94%	-2.84%	-0.06%

注：业绩比较基准=上证科创板综合指数收益率。

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 02 月 26 日生效。2、截至建仓期结束，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

3.3 其他指标

注：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

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		

苏俊杰	本基金的基金经理	2025-02-26	-	14 年	苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。曾任 MSCI INC. 分析师, 华泰柏瑞基金管理有限公司专户投资经理, 财通基金管理有限公司基金经理。2019 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任量化及衍生品投资部副总经理, 现担任指数与量化投资部总经理/基金经理。2021 年 03 月至 2025 年 01 月担任鹏华量化先锋混合型证券投资基金基金经理, 2021 年 03 月至今担任鹏华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 12 月担任鹏华沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华创业板指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 08 月至 2023 年 08 月担任鹏华中证 500 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 50 成份增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 02 月至今担任鹏华国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理, 2023 年 06 月至 2026 年 03 月担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 08 月至今担任鹏华创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 09 月至 2024 年 10 月担任鹏华中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 09 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2023 年 12 月至今担任鹏华上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理, 2023 年 12 月至 2026 年 03 月担任鹏华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金经理, 2024 年 01 月至 2025 年 06 月担任鹏华智投 800 混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 05 月至今担任鹏华智投数字经济混合型证券
-----	----------	------------	---	------	---

					投资基金基金经理，2024 年 06 月至 2025 年 08 月担任鹏华中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理，2025 年 02 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2025 年 04 月至今担任鹏华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 10 月至今担任鹏华上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 11 月至今担任鹏华启航量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，苏俊杰先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	--

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

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

注：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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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，本基金管理人严格执行公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年 A 股呈现极强结构性分化行情，市场经历了春季上行、中期回调、二季度末科技加速上涨的过程，资金集中涌向高景气成长赛道，成长板块大幅领跑，而价值消费板块表现偏弱。从行业赛道来看，行情主要由 AI 产业浪潮、半导体国产替代驱动，电子、通信板块领涨全市场，算力、芯片、先进封装等赛道资金高度集聚，呈现出强动量高波动的特征。与之对比，食品饮料、商贸零售、农林牧渔等消费板块持续走弱，银行保险等传统金融板块表现平淡，行业收益差距显著。尽管以科创、创业为代表的宽基指数涨幅明显，全市场仍有超六成个股下跌，个股涨跌幅中位数为负，只有少数聚焦科技主线的标的收获丰厚收益，指数化投资的优势愈发明显。

报告期内，本产品秉持被动指数化投资理念，将严格控制跟踪偏离度与年化跟踪误差作为投资管理的核心。投资组合构建上，对标上证科创板综合指数的成分股结构及权重分布，力求实现组合收益特征与基准指数的紧密跟踪。针对运作标的停复牌事件及个股流动性等情况，我们依托精细化的管理进行了审慎的动态微调。此外，配合指数编制规则的定期调样，我们执行了严谨的再平衡交易流程，保障了产品对标的指数的精确跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期份额净值增长率为 52.22%，同期业绩比较基准增长率为 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

国内经济总体平淡，海外加息预期多有摇摆。国内经济依然呈现外需强、内需弱的态势，经济的积极变化在于消费补贴的透支效应正在消退，房价走低带来的资产负债表拖累也在缓解，宏观政策保持发力空间和一定的宽松概率，经济预期有望保持平稳甚至略有改善。在中东局势多有波折的背景下，通胀和就业数据有望反复拉扯美联储加息预期，加息预期的摇摆也是 3 季度最重要的海外宏观背景。虽然市场在交易美联储 9 月加息，但经济和就业数据难以支撑如此快速的加息。

A 股波动加大，下半年有望走出震荡修复行情。A 股因前期过度极致的交易和持仓结构而带来脆弱性和风险的提升，在海外出现宏观预期变化、产业扰动和情绪外溢时，叠加巨型 IPO 产生的流动性虹吸效应，国内科技成长方向出现大幅调整，并伴随着主被动去杠杆和流动性冲击。在宏观和产业趋势并未显著改变的背景下，风险的快速释放和流动性冲击也带来了良好的配置性机会，下半年市场有望走出“V”型震荡修复和高位震荡的行情。

科技不再一枝独秀，再平衡将带来更广泛的机会。经历了 5-7 月科技方向流动性虹吸和流动性释放的过程，科技在下半年可能难以重现一枝独秀的行情，科技依然是景气度最高的方向之一，但

板块内部将因基本面和产业趋势而出现分化，科技和其他板块之间的差距也将有所收敛。投资者预期的再校准和资金的再平衡有望带来更广泛的投资机会。特别是前期经过持续调整和流动性虹吸冲击下的部分经济相关板块，有望迎来配置型资金流入和修复性行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金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，由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 673,881,043.28 元，期末基金份额净值 1.9617 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	36,420,959.52	41,841,201.57
结算备付金		33,760.48	33,591.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,956,050,267.26	1,455,194,872.57
其中：股票投资		1,956,050,267.26	1,455,194,872.57
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	-	-
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		933,476.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		1,993,498,956.41	1,497,069,665.50
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		-	223,631.08
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		196,413.90	130,839.87
应付托管费		65,471.31	43,613.29
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	6.4.7.9	12,063,860.02	1,896,394.20
负债合计		12,325,745.23	2,294,478.44
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,009,943,666.00	1,159,943,666.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	971,229,545.18	334,831,521.06
净资产合计		1,981,173,211.18	1,494,775,187.06
负债和净资产总计		1,993,498,956.41	1,497,069,665.50

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.9617 元，基金份额总额 1,009,943,666.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间
-----	-----	--	---------

			2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		562,244,393.74	20,449,218.76
1. 利息收入		22,494.03	195,014.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,494.03	195,014.98
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）		250,651,194.23	-25,588,791.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	248,315,469.54	-32,957,143.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收	6.4.7.17	-	-
益			
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,335,724.69	7,368,352.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	310,750,257.19	45,857,917.34
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	820,448.29	-14,922.29
减：二、营业总支出		1,302,409.45	1,419,124.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	866,439.42	1,006,128.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	288,813.16	335,376.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	147, 156. 87	77, 620. 03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		560, 941, 984. 29	19, 030, 094. 59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		560, 941, 984. 29	19, 030, 094. 59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		560, 941, 984. 29	19, 030, 094. 59

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 159, 943, 666. 00	-	334, 831, 521. 06	1, 494, 775, 187. 06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 159, 943, 666. 00	-	334, 831, 521. 06	1, 494, 775, 187. 06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 150, 000, 000. 00	-	636, 398, 024. 12	486, 398, 024. 12
（一）、综合收益总额	-	-	560, 941, 984. 29	560, 941, 984. 29
（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）	- 150, 000, 000. 00	-	75, 456, 039. 83	-74, 543, 960. 17
其中：1. 基金申购款	2, 140, 000, 000. 00	-	1, 132, 544, 514. 36	3, 272, 544, 514. 36

2. 基金赎回款	- 2,290,000,000.00	-	- 1,057,088,474.53	- 3,347,088,474.53
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,009,943,666.00	-	971,229,545.18	1,981,173,211.18
项目	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 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	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,729,943,666.00	-	-	1,729,943,666.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	480,000,000.00	-	-48,208,890.43	431,791,109.57
(一)、综合收益总额	-	-	19,030,094.59	19,030,094.59
(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)	480,000,000.00	-	-67,238,985.02	412,761,014.98
其中: 1. 基金申购款	2,300,000,000.00	-	- 125,970,705.80	2,174,029,294.20
2. 基金赎回款	-	-	58,731,720.78	-

回款	1, 820, 000, 000. 00			1, 761, 268, 279. 2 2
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2, 209, 943, 666. 00	-	-48, 208, 890. 43	2, 161, 734, 775. 5 7

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：

邓召明

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]214号《关于准予鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华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《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,729,942,000.00 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第 00051 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 2 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,729,943,666.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,666.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“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)、中国

证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2026 年上半年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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、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[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法, 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；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（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，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	662,784.77
等于：本金	662,455.67
加：应计利息	329.10

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	35,758,174.75
等于：本金	35,757,356.08
加：应计利息	818.67
减：坏账准备	-
合计	36,420,959.52

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	1,574,420,767.43	-	1,956,050,267.26	381,629,499.83
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	1,574,420,767.43	-	1,956,050,267.26	381,629,499.83

注：股票投资的公允价值和股票投资的公允价值变动均含可退替代款估值增值。

股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 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

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	84,302.56
应退替代款	3,283,251.55
可退替代款	8,648,806.21
其他	47,499.70
合计	12,063,860.02

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	1,159,943,666.00	1,159,943,666.00
本期申购	2,140,000,000.00	2,140,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,290,000,000.00	-2,290,000,000.00
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	1,009,943,666.00	1,009,943,666.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：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	402,636,160.94	-67,804,639.88	334,831,521.06
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	402,636,160.94	-67,804,639.88	334,831,521.06
本期利润	250,191,727.10	310,750,257.19	560,941,984.29
本期基金份额交易产生的变动数	21,053,155.24	54,402,884.59	75,456,039.83
其中：基金申购款	1,162,963,963.89	-30,419,449.53	1,132,544,514.36
基金赎回款	-1,141,910,808.65	84,822,334.12	-1,057,088,474.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	673,881,043.28	297,348,501.90	971,229,545.18

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	8,566.05
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,758.86
结算备付金利息收入	169.12
其他	-
合计	22,494.03

注：1、其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

2、其他存款利息收入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的利息收入。

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	50,875,997.90
股票投资收益——赎回差价收入	197,439,471.64
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	248,315,469.54

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	318,324,315.64
减：卖出股票成本总额	267,066,953.39

减：交易费用	381,364.35
买卖股票差价收入	50,875,997.90

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	3,347,088,474.53
减：现金支付赎回款总额	65,143,601.53
减：赎回股票成本总额	3,084,505,401.36
减：交易费用	—
赎回差价收入	197,439,471.64

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：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

注：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

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：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	2,335,724.69
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	2,335,724.69

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	310,750,257.19
股票投资	310,750,257.19
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	310,750,257.19

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	820,448.29
合计	820,448.29

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	2,986.45
登记结算费	59,507.37
存托服务费	360.49
合计	147,156.87

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

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没有发生变化。

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
鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人的股东、基金的一级交易商
鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“鹏华上证科创板综合 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

金额单位：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2月26日（基金合同生效日）至2025 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国信证券	854,549,944.74	100.00	2,310,671,547.67	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国信证券	167,432.82	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年2月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
国信证券	452,915.84	100.00	—	—

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，以扣除证管费、经手费等费用后的净额列示。佣金率由协议签订方参考市场价格确定。佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关要求。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2 月 26 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	866,439.42	1,006,128.09
其中：应支付销售机构的客户维 护费	67,029.67	162,569.56
应支付基金管理人的净管理费	799,409.75	843,558.53

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

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 2 月 26 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	288,813.16	335,376.05

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：无。

6.4.10.4 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

注：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

注：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

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
国信证券	1,167,671.00	0.12	778,000.00	0.07
鹏华上证科 创综合ETF联 接	457,493,200.00	45.30	525,082,500.00	45.27

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 2 月 26 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
国信证券	35,758,174.75	13,758.86	-	-

中国银行	662,784.77	8,566.05	10,143,655.89	45,664.95
------	------------	----------	---------------	-----------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在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

注：无。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	33,936	19,315,640.80	28,234,752.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	14,250	625,434.68	2,052,000.00	-
688121	卓然股份	2026 年 5 月 6 日	重大事项	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	15,642	171,926.37	101,360.16	-

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

注：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

本基金为指数型基金。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行或上市交易的其他非成份股（包含主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、政府支持机构债、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货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相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以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，违约风险可能性很小；在银行间同业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。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

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设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，因此除附注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，其余金融资产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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金，其余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。

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	36,420,959.52	-	-	-	36,420,959.52
结算备付金	33,760.48	-	-	-	33,760.48
交易性金融资产	-	-	-	-1,956,050,267.26	1,956,050,267.26
应收清算款	-	-	-	933,476.52	933,476.52
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	36,454,720.00	-	-	-1,957,044,236.41	1,993,498,956.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	196,413.90	196,413.90
应付托管费	-	-	-	65,471.31	65,471.31
其他负债	-	-	-	12,063,860.02	12,063,860.02
负债总计	-	-	-	12,325,745.23	12,325,745.23
利率敏感度缺口	36,454,720.00	-	-	-1,944,718,491.18	1,981,173,211.18
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	41,841,201.57	-	-	-	41,841,201.57
结算备付金	33,591.36	-	-	-	33,591.36
交易性金融资产	-	-	-	-1,455,194,872.57	1,455,194,872.57
资产总计	41,874,792.93	-	-	-1,455,194,872.57	1,497,069,665.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	130,839.87	130,839.87
应付托管费	-	-	-	43,613.29	43,613.29
应付清算款	-	-	-	223,631.08	223,631.08
其他负债	-	-	-	1,896,394.20	1,896,394.20
负债总计	-	-	-	2,294,478.44	2,294,478.44
利率敏感度缺口	41,874,792.93	-	-	-1,452,900,394.13	1,494,775,187.06

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，因此当利率发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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。本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券，所面临的其他价格风险来源于标的指数成份券和备选成份券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。

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个券在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份券及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，可以变更后的比例为准，本基金的投资比例可做相应调整。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，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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	1,956,050,267.26	98.73	1,455,194,872.57	97.35

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	1,956,050,267.26	98.73	1,455,194,872.57	97.35

注：债券投资为可转债、可交换债券投资。

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）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	96,592,099.91	-
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-96,592,099.91	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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
第一层次	1,925,662,155.10
第二层次	30,388,112.16
第三层次	-
合计	1,956,050,267.26

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，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，确定相关股票、债券和基金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

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应收款项和其他金融负债，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

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,956,050,267.26	98.12
	其中：股票	1,956,050,267.26	98.12
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	36,454,720.00	1.83
8	其他各项资产	993,969.15	0.05
9	合计	1,993,498,956.41	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

2、报告期末本基金投资的存托凭证公允价值为：3,601,474.45 元，占净值比 0.18%。本报告所指的“股票”均包含存托凭证。

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	1,584,410,209.10	79.97
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	335,445,396.89	16.93
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	28,757,592.53	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	5,717,613.18	0.29

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	1,954,330,811.70	98.65

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	1,485,940.68	0.08
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	-	-
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	1,485,940.68	0.08

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪	80,675	128,720,996.25	6.50
2	688041	海光信息	300,313	111,205,903.90	5.61
3	688012	中微公司	120,426	56,419,581.00	2.85
4	688981	中芯国际	293,921	46,680,533.22	2.36
5	688008	澜起科技	147,750	45,787,725.00	2.31
6	688802	沐曦股份-U	51,809	42,913,394.70	2.17
7	688795	摩尔线程-U	59,013	42,282,224.37	2.13
8	688525	佰维存储	59,962	29,665,000.26	1.50
9	688498	源杰科技	15,476	29,187,736.00	1.47
10	688072	拓荆科技	33,936	28,234,752.00	1.43
11	688082	盛美上海	61,939	26,757,648.00	1.35
12	688521	芯原股份	68,198	25,311,005.72	1.28
13	688146	中船特气	62,616	21,914,973.84	1.11
14	688702	盛科通信-U	52,820	20,599,271.80	1.04
15	688120	华海清科	63,402	20,426,856.36	1.03
16	688361	中科飞测	44,821	19,273,030.00	0.97
17	688347	华虹宏力	52,801	17,756,976.30	0.90
18	688126	沪硅产业	421,244	16,803,423.16	0.85
19	688396	华润微	171,480	16,727,874.00	0.84
20	688172	燕东微	184,555	15,439,871.30	0.78
21	688506	百利天恒	52,340	15,389,530.20	0.78
22	688249	晶合集成	259,341	15,308,899.23	0.77
23	688766	普冉股份	19,855	15,220,843.00	0.77
24	688183	生益电子	107,114	14,181,893.60	0.72
25	688200	华峰测控	26,087	13,698,283.70	0.69
26	688111	金山办公	59,684	12,715,676.20	0.64
27	688409	富创精密	38,891	11,910,368.75	0.60
28	688777	中控技术	99,826	11,729,555.00	0.59
29	688110	东芯股份	57,117	11,634,732.90	0.59
30	688469	芯联集成-U	1,083,225	11,493,017.25	0.58
31	688037	芯源微	25,825	11,338,466.25	0.57
32	688629	华丰科技	59,430	11,143,719.30	0.56
33	688048	长光华芯	22,149	11,118,798.00	0.56
34	688519	南亚新材	29,184	11,091,087.36	0.56
35	688271	联影医疗	106,334	10,764,190.82	0.54
36	688313	仕佳光子	57,482	10,614,051.30	0.54
37	688017	绿的谐波	23,616	9,868,181.76	0.50
38	688019	安集科技	28,982	9,838,229.72	0.50

39	688147	微导纳米	59,014	9,553,186.32	0.48
40	688234	天岳先进	54,891	9,524,137.41	0.48
41	688002	睿创微纳	60,235	9,317,752.15	0.47
42	688630	芯碁微装	16,330	8,971,538.70	0.45
43	688141	杰华特	58,147	8,925,564.50	0.45
44	688548	广钢气体	169,752	8,844,079.20	0.45
45	688036	传音控股	148,335	8,744,348.25	0.44
46	688387	信科移动-U	439,565	8,720,969.60	0.44
47	688585	上纬新材	52,220	8,658,076.00	0.44
48	688627	精智达	11,640	8,322,600.00	0.42
49	688047	龙芯中科	52,085	8,055,986.95	0.41
50	688375	国博电子	76,769	8,007,006.70	0.40
51	688187	时代电气	112,279	7,709,076.14	0.39
52	688300	联瑞新材	31,046	7,587,642.40	0.38
53	688775	影石创新	51,990	7,208,413.50	0.36
54	688728	格科微	335,332	7,055,385.28	0.36
55	688295	中复神鹰	115,978	7,021,308.12	0.35
56	688411	海博思创	23,913	6,963,465.60	0.35
57	688322	奥比中光-W	51,838	6,767,450.90	0.34
58	688220	翱捷科技-U	54,313	6,752,192.16	0.34
59	688549	中巨芯-U	181,209	6,670,303.29	0.34
60	688668	鼎通科技	17,350	6,476,755.00	0.33
61	688027	国盾量子	12,811	6,456,872.11	0.33
62	688578	艾力斯	58,118	6,346,485.60	0.32
63	688223	晶科能源	1,323,164	6,285,029.00	0.32
64	688536	思瑞浦	17,213	6,267,081.17	0.32
65	688432	有研硅	156,214	6,243,873.58	0.32
66	688336	三生国健	115,351	6,125,138.10	0.31
67	688545	兴福电子	45,296	6,027,085.76	0.30
68	688331	荣昌生物	45,529	5,930,607.54	0.30
69	688368	晶丰明源	26,673	5,775,237.96	0.29
70	688167	炬光科技	16,158	5,723,325.18	0.29
71	688099	晶晨股份	54,929	5,652,194.10	0.29
72	688188	柏楚电子	52,563	5,608,472.10	0.28
73	688362	甬矽电子	57,996	5,590,814.40	0.28
74	688213	思特威-W	52,004	5,568,068.28	0.28
75	688025	杰普特	11,831	5,560,570.00	0.28
76	688009	中国通号	1,110,698	5,286,922.48	0.27
77	688122	西部超导	83,583	5,249,848.23	0.26
78	688001	华兴源创	60,710	5,202,847.00	0.26
79	688052	纳芯微	17,765	5,121,827.15	0.26
80	688472	阿特斯	470,532	5,091,156.24	0.26
81	688449	联芸科技	58,789	5,074,078.59	0.26

82	688127	蓝特光学	51,986	5,073,833.60	0.26
83	688248	南网科技	73,234	5,066,328.12	0.26
84	688403	汇成股份	126,641	5,027,647.70	0.25
85	688676	金盘科技	59,239	5,013,988.96	0.25
86	688385	复旦微电	69,988	4,989,444.52	0.25
87	688303	大全能源	276,431	4,818,192.33	0.24
88	688301	奕瑞科技	38,236	4,741,264.00	0.24
89	688233	神工股份	21,556	4,622,037.52	0.23
90	688102	斯瑞新材	97,950	4,621,281.00	0.23
91	688433	华曙高科	53,816	4,606,649.60	0.23
92	688257	新锐股份	45,082	4,593,855.80	0.23
93	688538	和辉光电-U	1,759,669	4,575,139.40	0.23
94	688195	腾景科技	23,543	4,533,910.94	0.23
95	688502	茂莱光学	6,509	4,514,642.40	0.23
96	688123	聚辰股份	21,102	4,486,285.20	0.23
97	688065	凯赛生物	93,191	4,459,189.35	0.23
98	688652	京仪装备	22,262	4,456,184.54	0.22
99	688568	中科星图	104,543	4,335,398.21	0.22
100	688205	德科立	20,697	4,308,908.43	0.22
101	688599	天合光能	302,613	4,272,895.56	0.22
102	688268	华特气体	15,888	4,250,040.00	0.21
103	688503	聚和材料	31,488	4,178,457.60	0.21
104	688372	伟测科技	22,357	4,158,402.00	0.21
105	688400	凌云光	60,633	4,013,904.60	0.20
106	688266	泽璟制药-U	34,324	4,004,237.84	0.20
107	688531	日联科技	21,965	3,906,255.60	0.20
108	688018	乐鑫科技	30,417	3,890,942.64	0.20
109	688343	云天励飞-U	46,151	3,768,690.66	0.19
110	688388	嘉元科技	85,651	3,768,644.00	0.19
111	688608	恒玄科技	22,374	3,740,709.06	0.19
112	688332	中科蓝讯	23,418	3,688,335.00	0.19
113	688235	百济神州	14,328	3,648,052.08	0.18
114	688333	铂力特	35,478	3,632,947.20	0.18
115	688297	中无人机	87,391	3,631,096.05	0.18
116	688097	博众精工	57,449	3,622,159.45	0.18
117	688352	硕中科技	149,587	3,617,013.66	0.18
118	688308	欧科亿	19,844	3,607,837.64	0.18
119	689009	九号公司-WD	94,403	3,601,474.45	0.18
120	688800	瑞可达	37,283	3,578,049.51	0.18
121	688150	莱特光电	52,123	3,576,680.26	0.18
122	688778	厦钨新能	64,989	3,535,401.60	0.18
123	688757	胜科纳米	52,478	3,500,282.60	0.18
124	688380	中微半导	52,081	3,432,658.71	0.17

125	688700	东威科技	38,308	3,424,735.20	0.17
126	688692	达梦数据	13,989	3,417,372.81	0.17
127	688582	芯动联科	52,270	3,397,550.00	0.17
128	688390	固德威	30,820	3,344,278.20	0.17
129	688180	君实生物-U	98,593	3,334,415.26	0.17
130	688535	华海诚科	17,709	3,311,583.00	0.17
131	688318	财富趋势	45,878	3,271,560.18	0.17
132	688392	骄成超声	14,323	3,253,899.14	0.16
133	688603	天承科技	15,525	3,228,423.75	0.16
134	688169	石头科技	33,645	3,195,265.65	0.16
135	688617	惠泰医疗	17,546	3,185,651.76	0.16
136	688028	沃尔德	20,192	3,147,327.04	0.16
137	688003	天准科技	24,671	3,140,618.30	0.16
138	688484	南芯科技	55,344	3,126,382.56	0.16
139	688709	成都华微	81,786	3,115,228.74	0.16
140	688584	上海合晶	86,586	3,112,766.70	0.16
141	688661	和林微纳	19,284	3,065,770.32	0.15
142	688349	三一重能	198,621	3,015,066.78	0.15
143	688596	正帆科技	37,924	2,998,271.44	0.15
144	688507	索辰科技	11,081	2,988,324.08	0.15
145	688563	航材股份	58,097	2,976,309.31	0.15
146	688615	合合信息	25,799	2,917,866.90	0.15
147	688278	特宝生物	53,002	2,883,308.80	0.15
148	688772	珠海冠宇	146,706	2,879,838.78	0.15
149	688625	呈和科技	33,956	2,866,225.96	0.14
150	688006	杭可科技	77,870	2,846,148.50	0.14
151	688143	长盈通	16,058	2,824,281.04	0.14
152	688005	容百科技	91,981	2,814,618.60	0.14
153	688726	拉普拉斯	52,513	2,775,312.05	0.14
154	688475	萤石网络	100,979	2,761,775.65	0.14
155	688523	航天环宇	52,623	2,757,445.20	0.14
156	688605	先锋精科	26,451	2,751,433.02	0.14
157	688106	金宏气体	66,308	2,750,455.84	0.14
158	688114	华大智造	53,841	2,750,198.28	0.14
159	688425	铁建重工	679,443	2,731,360.86	0.14
160	688819	天能股份	122,976	2,730,067.20	0.14
161	688559	海目星	32,068	2,691,146.56	0.14
162	688708	佳驰科技	51,904	2,636,723.20	0.13
163	688131	皓元医药	27,870	2,636,502.00	0.13
164	688279	峰昭科技	11,598	2,603,055.12	0.13
165	688686	奥普特	15,122	2,546,393.58	0.13
166	688020	方邦股份	10,200	2,545,920.00	0.13
167	688206	概伦电子	56,563	2,509,700.31	0.13

168	688059	华锐精密	12,453	2,486,988.63	0.13
169	688281	华秦科技	49,453	2,484,024.19	0.13
170	688353	华盛锂电	21,206	2,461,380.42	0.12
171	688055	龙腾光电	426,655	2,457,532.80	0.12
172	688401	路维光电	25,434	2,441,155.32	0.12
173	688359	三孚新科	12,290	2,438,827.60	0.12
174	688515	裕太微-U	9,800	2,437,848.00	0.12
175	688662	富信科技	14,190	2,383,920.00	0.12
176	688192	迪哲医药-U	59,482	2,375,116.26	0.12
177	688107	安路科技	51,994	2,370,926.40	0.12
178	688383	新益昌	12,594	2,368,175.76	0.12
179	688516	奥特维	40,652	2,333,018.28	0.12
180	688319	欧林生物	52,542	2,310,797.16	0.12
181	688593	新相微	59,261	2,306,438.12	0.12
182	688690	纳微科技	52,025	2,294,302.50	0.12
183	688610	埃科光电	8,587	2,261,815.80	0.11
184	688090	瑞松科技	21,155	2,251,949.75	0.11
185	688182	灿勤科技	51,701	2,226,762.07	0.11
186	688798	艾为电子	30,313	2,222,549.16	0.11
187	688363	华熙生物	61,848	2,212,302.96	0.11
188	688208	道通科技	86,497	2,178,859.43	0.11
189	688158	优刻得-W	59,137	2,173,876.12	0.11
190	688561	奇安信-U	88,273	2,116,786.54	0.11
191	688378	奥来德	34,034	2,110,108.00	0.11
192	688520	神州细胞	60,460	2,068,336.60	0.10
193	688260	昀冢科技	14,250	2,052,000.00	0.10
194	688530	欧莱新材	21,100	2,044,590.00	0.10
195	688779	五矿新能	249,280	2,021,660.80	0.10
196	688275	万润新能	15,694	2,001,769.70	0.10
197	688166	博瑞医药	56,030	1,961,610.30	0.10
198	688376	美埃科技	16,724	1,945,001.20	0.10
199	688337	普源精电	25,418	1,904,570.74	0.10
200	688100	威胜信息	62,114	1,900,067.26	0.10
201	688138	清溢光电	40,283	1,893,301.00	0.10
202	688416	恒烁股份	13,336	1,867,040.00	0.09
203	688262	国芯科技	43,155	1,865,590.65	0.09
204	688088	虹软科技	51,925	1,845,933.75	0.09
205	688116	天奈科技	47,698	1,822,063.60	0.09
206	688456	有研粉材	13,000	1,814,800.00	0.09
207	688258	卓易信息	15,096	1,789,479.84	0.09
208	688153	唯捷创芯	55,578	1,785,165.36	0.09
209	688029	南微医学	24,563	1,763,623.40	0.09
210	688717	艾罗能源	21,308	1,759,401.56	0.09

211	688031	星环科技-U	15,166	1,746,819.88	0.09
212	688381	帝奥微	32,149	1,719,971.50	0.09
213	688691	灿芯股份	14,817	1,717,734.81	0.09
214	688063	派能科技	31,884	1,698,460.68	0.09
215	688125	安达智能	10,268	1,678,818.00	0.08
216	688327	云从科技-UW	134,075	1,670,574.50	0.08
217	688371	菲沃泰	42,512	1,657,542.88	0.08
218	688567	孚能科技	157,209	1,650,694.50	0.08
219	688222	成都先导	51,324	1,648,013.64	0.08
220	688079	美迪凯	52,939	1,627,874.25	0.08
221	688209	英集芯	55,938	1,626,677.04	0.08
222	688035	德邦科技	17,713	1,626,053.40	0.08
223	688669	聚石化学	15,005	1,605,535.00	0.08
224	688261	东微半导	15,250	1,600,182.50	0.08
225	688612	威迈斯	54,066	1,599,812.94	0.08
226	688306	均普智能	157,840	1,594,184.00	0.08
227	688312	燕麦科技	18,940	1,590,770.60	0.08
228	688486	龙迅股份	24,686	1,569,535.88	0.08
229	688663	新风光	17,615	1,558,222.90	0.08
230	688112	鼎阳科技	21,208	1,557,939.68	0.08
231	688720	艾森股份	15,168	1,531,968.00	0.08
232	688198	佰仁医疗	17,164	1,531,715.36	0.08
233	688478	晶升股份	17,278	1,529,966.90	0.08
234	688508	芯朋微	16,449	1,529,099.04	0.08
235	688321	微芯生物	57,501	1,514,001.33	0.08
236	688677	海泰新光	14,841	1,500,870.33	0.08
237	688191	智洋创新	42,023	1,500,221.10	0.08
238	688239	航宇科技	24,992	1,495,271.36	0.08
239	688231	隆达股份	40,299	1,480,182.27	0.07
240	688660	电气风电	171,450	1,477,899.00	0.07
241	688698	伟创电气	28,009	1,469,072.05	0.07
242	688083	中望软件	22,568	1,461,278.00	0.07
243	688227	品高股份	14,131	1,451,112.39	0.07
244	688611	杭州柯林	20,279	1,448,934.55	0.07
245	688062	迈威生物-U	51,206	1,446,569.50	0.07
246	688556	高测股份	107,611	1,429,074.08	0.07
247	688325	赛微微电	10,706	1,396,169.46	0.07
248	688165	埃夫特-U	68,018	1,387,567.20	0.07
249	688351	微电生理	61,011	1,382,509.26	0.07
250	688628	优利德	13,942	1,379,421.48	0.07
251	688016	心脉医疗	15,364	1,361,864.96	0.07
252	688190	云路股份	14,952	1,356,295.92	0.07
253	688518	联赢激光	43,789	1,353,080.10	0.07

254	688323	瑞华泰	23,928	1,351,932.00	0.07
255	688202	美迪西	16,739	1,351,004.69	0.07
256	688598	金博股份	27,290	1,349,490.50	0.07
257	688382	益方生物-U	74,784	1,346,112.00	0.07
258	688093	世华科技	36,397	1,343,049.30	0.07
259	688583	思看科技	15,400	1,320,858.00	0.07
260	688032	禾迈股份	15,445	1,305,411.40	0.07
261	688179	阿拉丁	46,970	1,301,538.70	0.07
262	688485	九州一轨	20,083	1,286,516.98	0.06
263	688550	瑞联新材	22,237	1,286,410.45	0.06
264	688788	科思科技	28,591	1,286,023.18	0.06
265	688046	药康生物	53,033	1,283,398.60	0.06
266	688543	国科军工	32,470	1,280,941.50	0.06
267	688155	先惠技术	15,775	1,276,039.75	0.06
268	688711	宏微科技	28,011	1,273,099.95	0.06
269	688252	天德钰	53,014	1,272,336.00	0.06
270	688789	宏华数科	23,807	1,265,818.19	0.06
271	688135	利扬芯片	29,990	1,261,979.20	0.06
272	688678	福立旺	52,014	1,257,178.38	0.06
273	688170	德龙激光	12,899	1,238,432.99	0.06
274	688128	中国电研	51,995	1,234,361.30	0.06
275	688307	中润光学	15,370	1,228,831.50	0.06
276	688160	步科股份	11,288	1,227,795.76	0.06
277	688418	震有科技	25,303	1,216,568.24	0.06
278	688552	航天南湖	43,245	1,216,481.85	0.06
279	688439	振华风光	26,188	1,209,885.60	0.06
280	688758	赛分科技	53,704	1,182,025.04	0.06
281	688499	利元亨	22,469	1,180,745.95	0.06
282	688710	益诺思	17,476	1,174,387.20	0.06
283	688105	诺唯赞	66,583	1,155,215.05	0.06
284	688230	芯导科技	14,556	1,147,158.36	0.06
285	688586	江航装备	97,586	1,140,780.34	0.06
286	688699	明微电子	13,685	1,121,485.75	0.06
287	688328	深科达	11,686	1,118,350.20	0.06
288	688697	纽威数控	82,212	1,117,261.08	0.06
289	688386	泛亚微透	12,434	1,117,070.56	0.06
290	688419	耐科装备	14,171	1,114,549.15	0.06
291	688719	爱科赛博	14,400	1,108,800.00	0.06
292	688226	威腾电气	25,838	1,106,641.54	0.06
293	688443	智翔金泰-U	47,564	1,105,863.00	0.06
294	688522	纳睿雷达	54,985	1,100,799.70	0.06
295	688221	前沿生物-U	48,414	1,084,473.60	0.05
296	688733	壹石通	26,174	1,082,294.90	0.05

297	688091	上海谊众	26,921	1,082,224.20	0.05
298	688591	泰凌微	31,400	1,079,532.00	0.05
299	688049	炬芯科技	22,991	1,078,507.81	0.05
300	688139	海尔生物	40,703	1,075,373.26	0.05
301	688305	科德数控	16,440	1,073,038.80	0.05
302	688685	迈信林	19,542	1,072,855.80	0.05
303	688161	威高骨科	50,846	1,066,749.08	0.05
304	688326	经纬恒润-W	14,969	1,061,002.72	0.05
305	688181	八亿时空	16,741	1,047,986.60	0.05
306	688786	悦安新材	22,596	1,041,223.68	0.05
307	688289	圣湘生物	71,879	1,035,057.60	0.05
308	688173	希荻微	53,945	1,032,507.30	0.05
309	688480	赛恩斯	11,787	1,032,423.33	0.05
310	688253	英诺特	17,122	1,032,114.16	0.05
311	688010	福光股份	21,087	1,025,460.81	0.05
312	688689	银河微电	15,814	1,023,482.08	0.05
313	688631	莱斯信息	21,687	1,017,337.17	0.05
314	688277	天智航-U	58,914	1,007,429.40	0.05
315	688739	成大生物	51,671	1,007,067.79	0.05
316	688068	热景生物	11,613	1,005,685.80	0.05
317	688787	海天瑞声	7,447	1,001,249.15	0.05
318	688601	力芯微	16,501	999,135.55	0.05
319	688108	赛诺医疗	53,744	995,876.32	0.05
320	688379	华光新材	11,850	995,755.50	0.05
321	688479	友车科技	26,091	990,675.27	0.05
322	688513	苑东生物	22,453	987,033.88	0.05
323	688750	金天钛业	59,118	983,132.34	0.05
324	688428	诺诚健华	34,362	978,286.14	0.05
325	688721	龙图光罩	16,636	971,209.68	0.05
326	688653	康希通信	55,326	961,565.88	0.05
327	688512	慧智微-U	59,768	954,494.96	0.05
328	688551	科威尔	13,465	946,185.55	0.05
329	688626	翔宇医疗	21,281	941,897.06	0.05
330	688693	锆威特	9,050	940,747.50	0.05
331	688050	爱博医疗	25,417	926,449.65	0.05
332	688168	安博通	13,366	918,912.50	0.05
333	688408	中信博	28,456	914,860.40	0.05
334	688219	会通股份	70,430	911,364.20	0.05
335	688177	百奥泰	53,551	900,727.82	0.05
336	688577	浙海德曼	19,617	899,047.11	0.05
337	688655	迅捷兴	16,618	890,060.08	0.04
338	688667	菱电电控	6,600	882,090.00	0.04
339	688210	统联精密	21,568	873,719.68	0.04

340	688103	国力电子	11,729	872,754.89	0.04
341	688011	新光光电	12,384	865,270.08	0.04
342	688365	光云科技	54,743	863,297.11	0.04
343	688553	汇宇制药-W	80,323	853,833.49	0.04
344	688087	英科再生	25,369	847,831.98	0.04
345	688320	禾川科技	20,274	840,357.30	0.04
346	688595	芯海科技	19,104	837,901.44	0.04
347	688707	振华新材	65,189	837,678.65	0.04
348	688290	景业智能	12,611	836,865.96	0.04
349	688665	四方光电	12,637	830,250.90	0.04
350	688636	智明达	22,901	829,703.23	0.04
351	688776	国光电气	13,400	821,956.00	0.04
352	688620	安凯微	50,698	821,307.60	0.04
353	688286	敏芯股份	6,981	803,303.67	0.04
354	688218	江苏北人	14,550	799,668.00	0.04
355	688510	航亚科技	33,409	797,806.92	0.04
356	688683	莱尔科技	21,007	796,585.44	0.04
357	688570	天玛智控	55,302	786,947.46	0.04
358	688007	光峰科技	59,132	786,455.60	0.04
359	688539	高华科技	24,365	776,756.20	0.04
360	688117	圣诺生物	28,696	775,652.88	0.04
361	688448	磁谷科技	12,189	774,732.84	0.04
362	688069	德林海	20,681	772,642.16	0.04
363	688656	浩欧博	7,932	767,579.64	0.04
364	688621	阳光诺和	13,970	767,092.70	0.04
365	688799	华纳药厂	16,753	751,707.11	0.04
366	688334	西高院	41,031	744,302.34	0.04
367	688562	航天软件	49,419	744,250.14	0.04
368	688291	金橙子	12,723	744,041.04	0.04
369	688276	百克生物	53,324	743,336.56	0.04
370	688658	悦康药业	57,735	742,472.10	0.04
371	688109	品茗科技	9,800	741,860.00	0.04
372	688345	博力威	12,705	737,906.40	0.04
373	688609	九联科技	66,864	736,172.64	0.04
374	688623	双元科技	7,327	736,070.42	0.04
375	688176	亚虹医药-U	74,199	736,054.08	0.04
376	688199	久日新材	21,302	735,558.06	0.04
377	688232	新点软件	41,054	729,940.12	0.04
378	688348	昱能科技	20,760	722,032.80	0.04
379	688185	康希诺	14,131	720,539.69	0.04
380	688366	昊海生科	24,935	719,873.45	0.04
381	688526	科前生物	59,411	718,873.10	0.04
382	688293	奥浦迈	17,159	715,358.71	0.04

383	688045	必易微	8,850	714,903.00	0.04
384	688377	迪威尔	30,228	712,776.24	0.04
385	688061	灿瑞科技	14,310	710,777.70	0.04
386	688101	三达膜	42,516	702,789.48	0.04
387	688488	艾迪药业	53,993	693,810.05	0.04
388	688679	通源环境	16,310	686,487.90	0.03
389	688119	中钢洛耐	143,983	683,919.25	0.03
390	688505	复旦张江	92,481	682,509.78	0.03
391	688207	格灵深瞳	33,931	682,013.10	0.03
392	688315	诺禾致源	54,132	677,191.32	0.03
393	688566	吉贝尔	26,326	673,682.34	0.03
394	688095	福昕软件	11,329	673,282.47	0.03
395	688115	思林杰	8,158	670,995.50	0.03
396	688633	星球石墨	22,499	668,895.27	0.03
397	688197	首药控股-U	19,879	664,157.39	0.03
398	688228	开普云	8,506	657,854.04	0.03
399	688151	华强科技	44,108	655,885.96	0.03
400	688163	赛伦生物	13,376	652,882.56	0.03
401	688575	亚辉龙	74,249	650,421.24	0.03
402	688282	理工导航	11,100	646,020.00	0.03
403	688580	伟思医疗	11,877	632,687.79	0.03
404	688225	亚信安全	50,914	632,351.88	0.03
405	688299	长阳科技	37,319	623,600.49	0.03
406	688073	毕得医药	11,456	616,561.92	0.03
407	688350	富淼科技	17,747	612,803.91	0.03
408	688648	中邮科技	16,639	608,155.45	0.03
409	688309	恒誉环保	9,938	605,025.44	0.03
410	688767	博拓生物	18,603	604,783.53	0.03
411	688360	德马科技	33,400	597,860.00	0.03
412	688311	盟升电子	22,817	597,577.23	0.03
413	688237	超卓航科	11,173	596,861.66	0.03
414	688216	气派科技	14,201	596,584.01	0.03
415	688410	山外山	41,121	590,497.56	0.03
416	688356	键凯科技	7,637	588,659.96	0.03
417	688330	宏力达	17,350	586,950.50	0.03
418	688267	中触媒	29,532	581,780.40	0.03
419	688458	美芯晟	13,774	575,202.24	0.03
420	688085	三友医疗	47,558	569,269.26	0.03
421	688196	卓越新能	15,758	565,712.20	0.03
422	688768	容知日新	10,894	561,476.76	0.03
423	688696	极米科技	8,690	560,852.60	0.03
424	688148	芳源股份	65,348	560,685.84	0.03
425	688398	赛特新材	21,581	559,163.71	0.03

426	688600	皖仪科技	16,796	558,970.88	0.03
427	688607	康众医疗	10,948	558,348.00	0.03
428	688211	中科微至	16,189	557,225.38	0.03
429	688450	光格科技	8,164	546,906.36	0.03
430	688389	普门科技	55,718	545,479.22	0.03
431	688259	创耀科技	13,941	545,371.92	0.03
432	688186	广大特材	35,755	541,688.25	0.03
433	688157	松井股份	20,517	541,443.63	0.03
434	688057	金达莱	35,067	540,382.47	0.03
435	688236	春立医疗	37,129	536,885.34	0.03
436	688056	莱伯泰科	8,279	534,409.45	0.03
437	688136	科兴制药	25,660	531,418.60	0.03
438	688558	国盛智科	16,132	530,097.52	0.03
439	688429	时创能源	51,861	528,463.59	0.03
440	688175	高凌信息	20,989	527,873.35	0.03
441	688581	安杰思	10,168	525,787.28	0.03
442	688081	兴图新科	12,824	524,245.12	0.03
443	688639	华恒生物	32,389	522,758.46	0.03
444	688159	有方科技	11,750	521,582.50	0.03
445	688269	凯立新材	16,427	520,900.17	0.03
446	688602	康鹏科技	65,940	519,607.20	0.03
447	688039	当虹科技	13,844	516,658.08	0.03
448	688391	钜泉科技	14,304	513,084.48	0.03
449	688680	海优新材	12,093	507,906.00	0.03
450	688511	天微电子	16,800	507,528.00	0.03
451	688283	坤恒顺维	15,194	503,073.34	0.03
452	688489	三未信安	22,032	500,126.40	0.03
453	688590	新致软件	40,066	498,020.38	0.03
454	688459	哈铁科技	59,388	494,702.04	0.02
455	688682	霍莱沃	12,695	493,835.50	0.02
456	688212	澳华内镜	16,730	491,862.00	0.02
457	688273	麦澜德	12,593	487,852.82	0.02
458	688339	亿华通-U	25,974	485,713.80	0.02
459	688716	中研股份	15,409	484,304.87	0.02
460	688571	杭华股份	54,447	476,411.25	0.02
461	688084	晶品特装	9,449	475,095.72	0.02
462	688075	安旭生物	15,875	472,440.00	0.02
463	688399	硕世生物	10,398	471,965.22	0.02
464	688335	复洁科技	19,568	470,414.72	0.02
465	688298	东方生物	26,250	468,825.00	0.02
466	688588	凌志软件	50,981	463,417.29	0.02
467	688023	安恒信息	12,548	460,762.56	0.02
468	688133	泰坦科技	21,779	460,190.27	0.02

469	688098	申联生物	53,322	458,035.98	0.02
470	688171	纬德信息	10,322	453,755.12	0.02
471	688215	瑞晟智能	11,250	451,800.00	0.02
472	688722	同益中	29,760	451,459.20	0.02
473	688238	和元生物	82,423	446,732.66	0.02
474	688302	海创药业-U	12,500	439,625.00	0.02
475	688533	上声电子	21,058	439,269.88	0.02
476	688589	力合微	19,052	437,814.96	0.02
477	688247	宣泰医药	58,175	437,476.00	0.02
478	688500	慧辰股份	9,484	429,909.72	0.02
479	688569	铁科轨道	26,376	425,972.40	0.02
480	688657	浩辰软件	11,908	425,949.16	0.02
481	688618	三旺通信	13,806	424,810.62	0.02
482	688358	祥生医疗	13,805	422,018.85	0.02
483	688592	司南导航	10,156	420,864.64	0.02
484	688130	晶华微	14,913	419,353.56	0.02
485	688280	精进电动-W	76,314	418,963.86	0.02
486	688272	富吉瑞	9,400	417,360.00	0.02
487	688455	科捷智能	22,153	413,374.98	0.02
488	688229	博睿数据	5,350	410,345.00	0.02
489	688070	纵横股份	10,935	408,203.55	0.02
490	688509	正元地信	94,980	406,514.40	0.02
491	688162	巨一科技	17,027	402,518.28	0.02
492	688606	奥泰生物	9,753	400,653.24	0.02
493	688080	映翰通	9,193	397,597.25	0.02
494	688338	赛科希德	13,437	396,525.87	0.02
495	688557	兰剑智能	12,755	395,787.65	0.02
496	688755	汉邦科技	14,320	394,659.20	0.02
497	688579	地纬智能	51,987	394,581.33	0.02
498	688619	罗普特	23,981	389,211.63	0.02
499	688255	凯尔达	13,994	389,033.20	0.02
500	688129	东来技术	14,849	388,895.31	0.02
501	688373	盟科药业-U	85,021	385,145.13	0.02
502	688096	京源环保	28,663	382,937.68	0.02
503	688071	华依科技	10,505	382,802.20	0.02
504	688077	大地熊	14,394	381,297.06	0.02
505	688317	之江生物	24,973	379,589.60	0.02
506	688292	浩瀚深度	20,399	379,421.40	0.02
507	688030	山石网科	23,987	378,754.73	0.02
508	688156	路德科技	12,352	373,648.00	0.02
509	688687	凯因科技	22,544	367,692.64	0.02
510	688367	工大高科	10,934	364,102.20	0.02
511	688015	交控科技	23,645	363,660.10	0.02

512	688357	建龙微纳	12,302	362,539.94	0.02
513	688718	唯赛勃	22,677	362,151.69	0.02
514	688152	麒麟信安	12,896	354,382.08	0.02
515	688178	万德斯	10,476	354,193.56	0.02
516	688370	丛麟科技	16,706	349,489.52	0.02
517	688246	嘉和美康	16,905	347,397.75	0.02
518	688671	碧兴物联	9,705	345,206.85	0.02
519	688285	高铁电气	47,800	342,726.00	0.02
520	688529	豪森智能	21,727	341,765.71	0.02
521	688314	康拓医疗	10,035	339,985.80	0.02
522	688265	南模生物	9,779	338,255.61	0.02
523	688576	西山科技	8,373	333,664.05	0.02
524	688435	英方软件	10,370	331,840.00	0.02
525	688316	青云科技-U	6,099	329,346.00	0.02
526	688310	迈得医疗	21,220	326,151.40	0.02
527	688251	井松智能	12,389	317,530.07	0.02
528	688560	明冠新材	26,640	315,684.00	0.02
529	688137	近岸蛋白	8,620	310,320.00	0.02
530	688369	致远互联	14,544	305,569.44	0.02
531	688651	盛邦安全	9,388	302,481.36	0.02
532	688517	金冠电气	17,107	299,030.36	0.02
533	688355	明志科技	15,500	298,375.00	0.02
534	688468	科美诊断	51,682	294,070.58	0.01
535	688501	青达环保	15,148	290,841.60	0.01
536	688737	中自科技	15,048	288,018.72	0.01
537	688193	仁度生物	5,149	284,739.70	0.01
538	688113	联测科技	8,002	280,870.20	0.01
539	688597	煜邦电力	43,168	280,592.00	0.01
540	688026	洁特生物	17,615	276,731.65	0.01
541	688244	永信至诚	19,352	275,959.52	0.01
542	688203	海正生材	26,192	261,396.16	0.01
543	688670	金迪克	15,373	260,418.62	0.01
544	688426	康为世纪	13,965	256,118.10	0.01
545	688132	邦彦技术	19,475	256,096.25	0.01
546	688013	天臣医疗	9,977	246,132.59	0.01
547	688038	中科通达	14,487	243,671.34	0.01
548	688060	云涌科技	7,407	243,616.23	0.01
549	688613	奥精医疗	17,042	240,462.62	0.01
550	688395	正弦电气	10,845	239,674.50	0.01
551	688420	美腾科技	11,236	236,742.52	0.01
552	688118	普元信息	11,749	236,389.88	0.01
553	688616	西力科技	23,266	234,986.60	0.01
554	688089	嘉必优	21,315	226,152.15	0.01

555	688638	誉辰智能	7,095	221,151.15	0.01
556	688092	爱科科技	10,350	219,834.00	0.01
557	688659	元琛科技	21,022	219,469.68	0.01
558	688288	鸿泉技术	12,200	216,794.00	0.01
559	688051	佳华科技	9,403	216,080.94	0.01
560	688573	信宇人	12,156	215,404.32	0.01
561	688058	宝兰德	9,696	202,840.32	0.01
562	688393	安必平	11,329	201,429.62	0.01
563	688695	中创股份	10,720	200,464.00	0.01
564	688466	金科环境	15,426	197,915.58	0.01
565	688329	艾隆科技	9,650	195,026.50	0.01
566	688528	秦川物联	21,250	194,225.00	0.01
567	688078	龙软科技	9,026	189,997.30	0.01
568	688565	力源科技	19,870	187,771.50	0.01
569	688681	科汇股份	13,262	185,402.76	0.01
570	688021	奥福科技	9,416	182,293.76	0.01
571	688004	博汇科技	9,949	181,071.80	0.01
572	688793	倍轻松	10,707	172,489.77	0.01
573	688067	爱威科技	8,177	164,766.55	0.01
574	688296	和达科技	12,950	148,148.00	0.01
575	688217	睿昂基因	6,928	143,132.48	0.01
576	688701	卓锦股份	16,456	123,913.68	0.01
577	688121	卓然股份	15,642	101,360.16	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	688270	ST 臻镭	18,963	1,485,940.68	0.08

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-U	27,800,624.23	1.86
2	688802	沐曦股份-U	20,206,507.88	1.35
3	688012	中微公司	16,323,529.43	1.09
4	688041	海光信息	14,631,646.82	0.98
5	688498	源杰科技	10,530,250.88	0.70
6	688256	寒武纪	9,536,435.43	0.64
7	688981	中芯国际	9,193,118.18	0.62
8	688146	中船特气	7,112,252.29	0.48
9	688411	海博思创	6,292,766.79	0.42
10	688271	联影医疗	5,275,637.44	0.35

11	688019	安集科技	5,229,230.04	0.35
12	688027	国盾量子	4,996,035.09	0.33
13	688617	惠泰医疗	4,777,969.64	0.32
14	688008	澜起科技	4,741,025.96	0.32
15	688205	德科立	4,548,643.60	0.30
16	688200	华峰测控	4,493,673.10	0.30
17	688702	盛科通信-U	4,465,524.91	0.30
18	688172	燕东微	4,437,856.85	0.30
19	688052	纳芯微	4,032,372.48	0.27
20	688536	思瑞浦	4,006,944.65	0.27

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	7,544,977.83	0.50
2	688041	海光信息	7,364,007.42	0.49
3	688027	国盾量子	6,019,415.45	0.40
4	688256	寒武纪	6,017,581.78	0.40
5	688766	普冉股份	4,382,324.51	0.29
6	688981	中芯国际	3,212,215.08	0.21
7	688235	百济神州	2,922,134.94	0.20
8	688200	华峰测控	2,914,451.87	0.19
9	688692	达梦数据	2,862,183.51	0.19
10	688615	合合信息	2,675,676.16	0.18
11	688368	晶丰明源	2,661,207.31	0.18
12	688195	腾景科技	2,659,072.38	0.18
13	688017	绿的谐波	2,615,618.05	0.17
14	688008	澜起科技	2,593,946.83	0.17
15	688802	沐曦股份-U	2,533,717.20	0.17
16	688167	炬光科技	2,307,425.58	0.15
17	688630	芯碁微装	2,279,222.10	0.15
18	688627	精智达	2,165,876.23	0.14
19	688031	星环科技-U	2,114,904.46	0.14
20	688411	海博思创	2,020,082.11	0.14

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	536,225,629.10
卖出股票收入（成交）总额	318,324,315.64

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

注：无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低申购赎回时现金资产对投资组合的影响及投资组合仓位调整的交易成本，达到稳定投资组合资产净值的目的。

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

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

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证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	933,476.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	993,969.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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	28,234,752.00	1.43	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

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，投资组合报告中数字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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）

3,404	296,693.20	918,523,666.00	90.95	91,420,000.00	9.05
-------	------------	----------------	-------	---------------	------

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国银行股份有限公司-鹏 华上证科创板综合交易型 开放式指数证券投资基金 联接基金	457,493,200.00	45.30

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

注：截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 2 月 26 日） 基金份额总额	1,729,943,666.00
本报告期期初基金份额总额	1,159,943,666.00
本报告期基金总申购份额	2,140,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,290,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,009,943,666.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

基金管理人的重大人事变动：

报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。

本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国信证券	4	854,549,944.74	100.00	167,432.82	100.00	本报告期新增1个

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执

行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- (2) 基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- (3) 基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 01 月 21 日
2	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
3	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 02 月 05 日
4	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 03 月 30 日
5	鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 04 日
6	鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 17 日
7	鹏华上证科创板综合交易型开放式	《证券日报》、基金管	2026 年 04 月 21 日

	指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	
8	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金融街证券股份有限公司为申购赎回代理券商的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 04 月 29 日
9	鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 05 月 30 日
10	鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2026 年 06 月 24 日

注：无。

§ 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(%)
机构	1	20260408~20260409, 20260413~20260414, 20260416~20260512	120,896,500.00	0.00	15,000,000.00	105,896,500.00	10.49
	2	20260101~20260630	525,082,500.00	618,017,600.00	685,606,900.00	457,493,200.00	45.30
产品特有风险							
基金份额持有人持有的基金份额所占比列过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- （二）《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- （三）《鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2026 年中期报告》（原文）。

12.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日