

招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 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及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责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 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 2025 年 2 月 26 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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 期末上市基金前十名持有人	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.4 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	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商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	招商上证科创板综合 ETF
场内简称	科创全指（扩位证券简称：科创综指 ETF 招商）
基金主代码	589770
交易代码	589770
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	招商基金管理有限公司
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	708,569,166.00 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的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资策略	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。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	许俊
	联系电话	0755-83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755-83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王小青	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2025 年 2 月 26 日 - 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,175,993.20
本期利润	31,839,387.03
加权平均基金份额本期利润	0.0410
本期加权平均净值利润率	4.30%
本期基金份额净值增长率	-1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-12,142,383.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0171
期末基金资产净值	696,426,782.65
期末基金份额净值	0.9829

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.71%

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

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

3、期末可供分配利润，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；

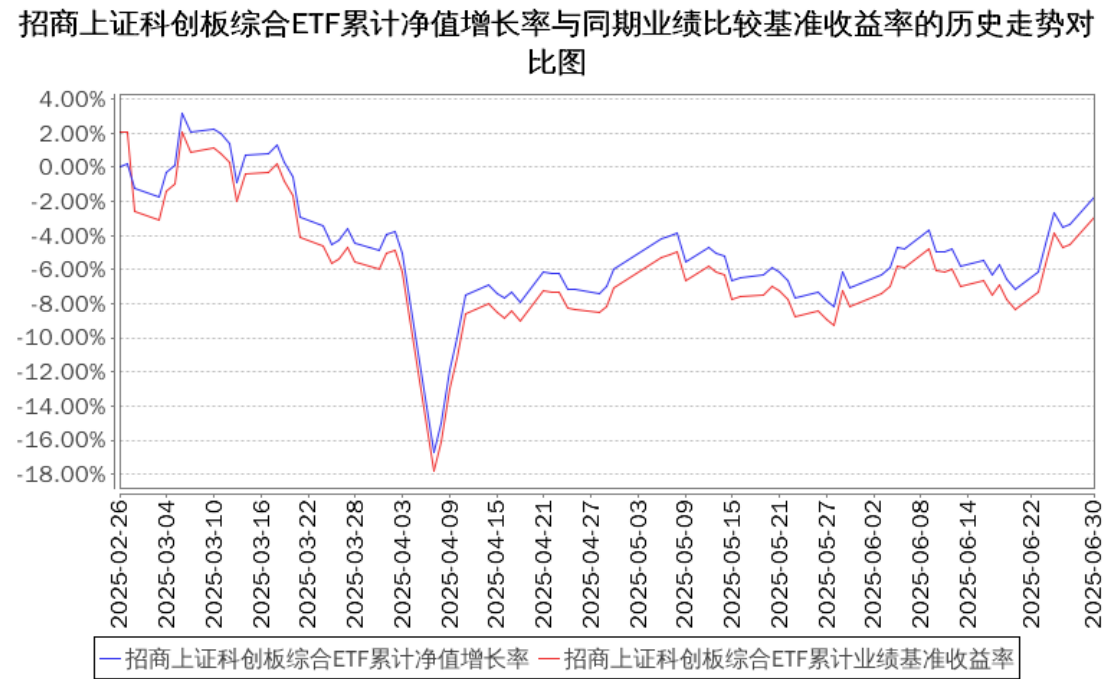
4、本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，截至本报告期末成立未满半年。

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
过去一个月	5.75%	1.00%	5.71%	1.01%	0.04%	-0.01%
过去三个月	3.31%	1.97%	3.27%	1.99%	0.04%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-1.71%	1.79%	-2.89%	1.88%	1.18%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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：本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截至报告期末基金建仓期尚未结束。

§ 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
房俊一	本基金 基金经 理	2025 年 2 月 26 日	-	5	男，硕士。2019 年 7 月至 2021 年 4 月在中证指数有限公司工作，任研究开发部研究员；2021 年 4 月至 2024 年 8 月在华宝基金管理有限公司工作，历任高级分析师、基金经理助理等职位。2024 年 8 月加入招商基金管理有限公司指数产品管理事业部，现任招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商

					沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商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。
苏燕青	本基金基金经理（已离任）	2025 年 2 月 26 日	2025 年 4 月 17 日	13	女，硕士。2012 年 1 月加入招商基金管理有限公司，曾任 ETF 专员，协助指数类基金产品的投资管理工作，曾任上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商沪深 300 地产等权重指数证券投资基金、招商沪深 300 高贝塔指数证券投资基金、招商中证全指证券公司指数证券投资基金、招商富时中国 A-H50 指数型证券投资基金（LOF）、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商上证港股通交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证香

					港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证全球中国互联网交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、招商中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）、招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、招商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。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司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 12 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

报告期内，财政政策与货币政策协同发力以稳增长，资本市场则在政策支持与经济转型驱动下表现活跃。其中，财政政策延续“更加积极”的基调，聚焦“稳增长、扩内需、化风险”，通过加大支出强度、优化结构、前置发力，对冲经济下行压力，支持高质量发展。而货币政策方面，以量价工具降低融资成本，以精准滴灌引导资源流向新质生产力领域。市场表现来看，交易情绪较为活跃，流动性方面较为充裕，结构性机会突出。就申万一级行业来看，行业表现涨跌不一。其中，有色金属、银行、国防军工、传媒、通信行业涨幅居前。而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化表现较为疲软。本基金跟踪的标的指数上证科创板综合指数报告期内上涨 9.93%。关于本基金的运作，报告期内仓位相对较高，紧跟指数表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-1.71%，同期业绩基准增长率为-2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，政策端支持产业景气度复苏的态度较为明确，叠加政府持续推进中长期资金入市，行情长期向上动能相对较强。行情节奏看，市场流动性逐渐宽裕，投资风险偏好也持续抬升，后续可持续关注政策落地和景气度修复情况。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计师事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截至报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的约定。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

本报告期内，本托管人在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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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地复核，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”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：招商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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	5,608,616.92
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	689,295,749.12

其中：股票投资		689,295,749.12
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		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		1,714,137.85
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		696,618,503.89
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		97,888.26
应付托管费		32,629.42
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	61,203.56
负债合计		191,721.24
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	708,569,166.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-12,142,383.35
净资产合计		696,426,782.65
负债和净资产总计		696,618,503.89

注：1. 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9829 元，基金份额总额 708,569,166.00 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：招商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：2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 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		32,400,611.63
1.利息收入		54,431.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,431.34
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）		9,617,478.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	6,841,743.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	37,150.95
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
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	2,738,583.56
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）	6.4.7.16	22,663,393.83
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	65,308.08
减：二、营业总支出		561,224.60

1.管理人报酬	6.4.10.2.1	374,251.99
其中：暂估管理人报酬		-
2.托管费	6.4.10.2.2	124,750.64
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		0.07
8.其他费用	6.4.7.19	62,221.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,839,387.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,839,387.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		31,839,387.03

6.3 净资产变动表

会计主体：招商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：2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	1,288,569,166.00	-	-	1,288,569,166.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-580,000,000.00	-	-12,142,383.35	-592,142,383.35
（一）、综合收益总额	-	-	31,839,387.03	31,839,387.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	-580,000,000.00	-	-43,981,770.38	-623,981,770.38

减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,115,000,000.00	-	-71,343,548.17	1,043,656,451.83
2.基金赎回款	-1,695,000,000.00	-	27,361,777.79	-1,667,638,222.21
(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	708,569,166.00	-	-12,142,383.35	696,426,782.65

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：

____钟文岳____ ____欧志明____ ____何剑萍____
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

招商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”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商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》及其他有关法律法规的规定，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]128 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 1,288,569,166.00 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 00046 号验资报告。《招商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》(以下简称“基金合同”)于 2025 年 2 月 26 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证，下同)和备选成份券(含存托凭证，下同)。为更好地实现基金的投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份券(包括主板、科创板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含

可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资业务和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的资产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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:上证科创板综合指数收益率。

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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 2 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的金融资产业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融

工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特

征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

转融通证券出借业务利息收入在转融通证券实际出借期间内，按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时计入当期损益。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费(如适用)按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日计提。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1) 每一基金份额享有同等分配权;
- 2) 本基金的收益分配方式为现金分红;
- 3) 基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供分配利润进行评价, 在符合收益分配相关规定的前提下, 基金管理人可进行收益分配;
- 4) 在符合上述基金分红条件的前提下, 本基金可每季度进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容, 基金管理人可以根据实际情况确定并按照规定公告;
- 5) 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配;
- 6) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。证券交易所或基金登记机构对收益分配另有规定的, 从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下, 履行适当程序后, 基金管理人可在不违反法律法规规定的前提下酌情调整以上基金收益分配原则, 但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。外币货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度, 本基金整体为一个报告分部, 且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票, 包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(中基协发[2017]6 号), 在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2017]13 号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13 号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566 号)所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

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

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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[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[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[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[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[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证

券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，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。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	5,399,069.61
等于：本金	5,398,761.80
加：应计利息	307.81
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	209,547.31
等于：本金	209,528.90
加：应计利息	18.41
减：坏账准备	-
合计	5,608,616.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		666,632,355.29	-	689,295,749.12	22,663,393.83
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		666,632,355.29	-	689,295,749.12	22,663,393.83

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**

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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各项买入返售金融资产。

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。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	61,203.56

合计	61,203.56
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,288,569,166.00	1,288,569,166.00
本期申购	1,115,000,000.00	1,115,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,695,000,000.00	-1,695,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	708,569,166.00	708,569,166.00

注：1、本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额；
2、本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,288,569,166.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 4,166.00 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,175,993.20	22,663,393.83	31,839,387.03
本期基金份额交易产生的变动数	-3,039,894.49	-40,941,875.89	-43,981,770.38
其中：基金申购款	6,848,534.06	-78,192,082.23	-71,343,548.17
基金赎回款	-9,888,428.55	37,250,206.34	27,361,777.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,136,098.71	-18,278,482.06	-12,142,383.35

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,915.24
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,772.51
结算备付金利息收入	-
其他	743.59
合计	54,431.34

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 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,638,342.83
股票投资收益——赎回差价收入	3,203,401.04
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	6,841,743.87

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 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	299,769,205.40
减：卖出股票成本总额	295,679,624.15
减：交易费用	451,238.42
买卖股票差价收入	3,638,342.83

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 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,667,638,222.21
减：现金支付赎回款总额	45,550,689.21
减：赎回股票成本总额	1,618,884,131.96
减：交易费用	-
赎回差价收入	3,203,401.04

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
----	--

债券投资收益——利息收入	26.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,123.96
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	37,150.95

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	180,158.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	142,999.43
减：应计利息总额	28.09
减：交易费用	7.31
买卖债券差价收入	37,123.96

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,738,583.56
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	2,738,583.56

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	22,663,393.83
——股票投资	22,663,393.83
——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	22,663,393.83

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日） 至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-4,062.88
其他	69,370.96
合计	65,308.08

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	12,475.10
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	49,746.80
合计	62,221.90

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**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**

本报告期内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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商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(以下简称“招商上证科创板综合 ETF 联接”)	本基金的联接基金

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

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 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	374,251.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	66,794.20
应支付基金管理人的净管理费	307,457.79

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	124,750.64

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（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**

本基金本报告期内无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。

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

本基金本报告期内无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。

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**

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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 2025 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	7,643,100.00	1.08%
招商上证科创板综合 ETF 联接	406,284,300.00	57.34%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

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 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
中国银行-活期	5,399,069.61	46,915.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	442	20,553.00	18,939.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	60	5,610.00	5,439.60	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	47,269	948,207.18	1,798,585.45	-

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银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

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交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的

合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	5,608,616.92	-	-	-	5,608,616.92
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融 资产	-	-	-	689,295,749.12	689,295,749.12
衍生金融资 产	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,714,137.85	1,714,137.85
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,608,616.92	-	-	691,009,886.97	696,618,503.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	97,888.26	97,888.26
应付托管费	-	-	-	32,629.42	32,629.42
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	61,203.56	61,203.56
负债总计	-	-	-	191,721.24	191,721.24
利率敏感度缺口	5,608,616.92	-	-	690,818,165.73	696,426,782.65

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	689,295,749.12	98.98
交易性金融资产-基金投资	-	-

交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	689,295,749.12	98.98

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	
	2.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（2025 年 6 月 30 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	34,464,787.46
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-34,464,787.46

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	687,375,471.77	-
第二层次	1,798,585.45	-
第三层次	121,691.90	-
合计	689,295,749.12	-

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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	689,295,749.12	98.95
	其中：股票	689,295,749.12	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	5,608,616.92	0.81
8	其他各项资产	1,714,137.85	0.25
9	合计	696,618,503.89	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	552,035,525.81	79.27
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	123,287,405.01	17.70
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	11,661,811.11	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	2,189,315.29	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	689,174,057.22	98.96

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	121,691.90	0.02
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	121,691.90	0.02

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 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688041	海光信息	235,415	33,261,785.35	4.78
2	688256	寒武纪	42,366	25,483,149.00	3.66
3	688981	中芯国际	202,393	17,844,990.81	2.56
4	688111	金山办公	47,593	13,328,419.65	1.91
5	688506	百利天恒	40,593	12,020,399.16	1.73
6	688012	中微公司	64,140	11,692,722.00	1.68
7	688271	联影医疗	83,400	10,653,516.00	1.53
8	688008	澜起科技	116,514	9,554,148.00	1.37
9	688036	传音控股	116,162	9,258,111.40	1.33
10	688396	华润微	133,999	6,319,392.84	0.91
11	688047	龙芯中科	40,578	5,412,699.42	0.78
12	688223	晶科能源	1,016,119	5,273,657.61	0.76
13	688126	沪硅产业	278,493	5,213,388.96	0.75
14	688082	盛美上海	45,038	5,131,629.72	0.74
15	688521	芯原股份	50,104	4,835,036.00	0.69
16	688303	大全能源	218,563	4,659,763.16	0.67
17	688009	中国通号	874,800	4,496,472.00	0.65
18	688072	拓荆科技	28,335	4,355,372.85	0.63
19	688183	生益电子	84,354	4,318,924.80	0.62
20	689009	九号公司	72,960	4,317,043.20	0.62
21	688578	艾力斯	46,002	4,280,026.08	0.61
22	688249	晶合集成	204,301	4,141,181.27	0.59
23	688213	思特威	40,493	4,139,194.46	0.59
24	688169	石头科技	26,007	4,071,395.85	0.58
25	688728	格科微	263,502	4,057,930.80	0.58
26	688120	华海清科	23,517	3,967,317.90	0.57

27	688188	柏楚电子	29,408	3,871,857.28	0.56
28	688187	时代电气	88,620	3,779,643.00	0.54
29	688617	惠泰医疗	12,626	3,749,922.00	0.54
30	688375	国博电子	60,947	3,657,429.47	0.53
31	688297	中无人机	68,309	3,647,700.60	0.52
32	688777	中控技术	79,733	3,580,809.03	0.51
33	688608	恒玄科技	10,148	3,531,301.04	0.51
34	688065	凯赛生物	73,594	3,466,277.40	0.50
35	688336	三生国健	63,408	3,439,249.92	0.49
36	688469	芯联集成	717,206	3,421,072.62	0.49
37	688472	阿特斯	373,860	3,420,819.00	0.49
38	688122	西部超导	65,305	3,388,023.40	0.49
39	688220	翱捷科技	42,363	3,317,022.90	0.48
40	688538	和辉光电	1,403,631	3,284,496.54	0.47
41	688002	睿创微纳	46,883	3,268,682.76	0.47
42	688027	国盾量子	11,762	3,234,667.62	0.46
43	688599	天合光能	220,488	3,203,690.64	0.46
44	688525	佰维存储	47,415	3,195,771.00	0.46
45	688349	三一重能	124,137	3,095,976.78	0.44
46	688235	百济神州	13,159	3,074,468.76	0.44
47	688099	晶晨股份	42,791	3,038,588.91	0.44
48	688278	特宝生物	41,286	2,977,133.46	0.43
49	688568	中科星图	81,928	2,950,227.28	0.42
50	688318	财富趋势	25,603	2,942,296.76	0.42
51	688692	达梦数据	12,978	2,892,666.42	0.42
52	688266	泽璟制药	26,616	2,861,486.16	0.41
53	688192	迪哲医药	47,147	2,819,390.60	0.40
54	688361	中科飞测	32,988	2,777,259.72	0.40
55	688114	华大智造	42,282	2,741,142.06	0.39
56	688819	天能股份	98,637	2,738,163.12	0.39
57	688520	神州细胞	45,493	2,722,756.05	0.39
58	688582	芯动联科	40,365	2,712,528.00	0.39
59	688629	华丰科技	47,313	2,706,303.60	0.39
60	688385	复旦微电	54,287	2,674,720.49	0.38
61	688180	君实生物	76,828	2,610,615.44	0.37
62	688563	航材股份	46,039	2,607,188.57	0.37
63	688234	天岳先进	43,756	2,561,913.80	0.37
64	688363	华熙生物	49,728	2,553,532.80	0.37
65	688702	盛科通信	41,584	2,539,950.72	0.36
66	688475	萤石网络	79,429	2,503,602.08	0.36
67	688778	厦钨新能	42,800	2,393,376.00	0.34
68	688172	燕东微	121,513	2,388,945.58	0.34
69	688322	奥比中光	40,446	2,386,718.46	0.34

70	688019	安集科技	15,607	2,369,142.60	0.34
71	688561	奇安信	69,340	2,356,173.20	0.34
72	688166	博瑞医药	43,134	2,316,727.14	0.33
73	688347	华虹公司	41,130	2,258,448.30	0.32
74	688052	纳芯微	12,736	2,222,304.64	0.32
75	688425	铁建重工	542,467	2,213,265.36	0.32
76	688017	绿的谐波	17,358	2,167,840.62	0.31
77	688331	荣昌生物	35,262	2,133,351.00	0.31
78	688709	成都华微	63,964	2,094,181.36	0.30
79	688018	乐鑫科技	14,317	2,091,713.70	0.30
80	688037	芯源微	19,422	2,082,038.40	0.30
81	688208	道通科技	67,574	2,067,764.40	0.30
82	688279	峰昭科技	10,563	1,959,436.50	0.28
83	688387	信科移动	345,911	1,954,397.15	0.28
84	688088	虹软科技	40,378	1,948,238.50	0.28
85	688382	益方生物	58,952	1,934,804.64	0.28
86	688295	中复神鹰	92,458	1,923,126.40	0.28
87	688498	源杰科技	9,821	1,915,095.00	0.27
88	688100	威胜信息	49,022	1,816,265.10	0.26
89	688248	南网科技	57,467	1,807,911.82	0.26
90	688313	仕佳光子	47,269	1,798,585.45	0.26
91	688567	孚能科技	123,898	1,796,521.00	0.26
92	688343	云天励飞	35,296	1,744,328.32	0.25
93	688502	茂莱光学	6,056	1,742,068.96	0.25
94	688409	富创精密	31,435	1,729,239.35	0.25
95	688200	华峰测控	11,894	1,715,114.80	0.25
96	688484	南芯科技	43,208	1,708,876.40	0.25
97	688301	奕瑞科技	19,319	1,692,537.59	0.24
98	688116	天奈科技	36,584	1,674,449.68	0.24
99	688281	华秦科技	27,567	1,668,079.17	0.24
100	688772	珠海冠宇	115,140	1,645,350.60	0.24
101	688333	铂力特	27,508	1,638,376.48	0.24
102	688005	容百科技	72,712	1,622,931.84	0.23
103	688536	思瑞浦	11,559	1,603,464.48	0.23
104	688522	纳睿雷达	31,133	1,594,632.26	0.23
105	688676	金盘科技	47,060	1,574,157.00	0.23
106	688798	艾为电子	23,054	1,572,282.80	0.23
107	688146	中船特气	53,498	1,546,627.18	0.22
108	688433	华曙高科	41,973	1,542,507.75	0.22
109	688141	杰华特	45,819	1,492,783.02	0.21
110	688068	热景生物	10,588	1,483,802.32	0.21
111	688327	云从科技	106,223	1,464,815.17	0.21
112	688147	微导纳米	47,275	1,426,759.50	0.20

113	688552	航天南湖	34,946	1,394,694.86	0.20
114	688432	有研硅	126,278	1,394,109.12	0.20
115	688110	东芯股份	45,110	1,383,072.60	0.20
116	688153	唯捷创芯	43,983	1,363,912.83	0.20
117	688631	莱斯信息	15,122	1,348,882.40	0.19
118	688352	颀中科技	119,895	1,346,420.85	0.19
119	688165	埃夫特	52,637	1,343,296.24	0.19
120	688548	广钢气体	132,980	1,332,459.60	0.19
121	688776	国光电气	12,417	1,309,745.16	0.19
122	688400	凌云光	47,219	1,301,827.83	0.19
123	688206	概伦电子	44,526	1,294,816.08	0.19
124	688050	爱博医疗	18,532	1,275,928.20	0.18
125	688097	博众精工	45,588	1,272,361.08	0.18
126	688055	龙腾光电	338,456	1,252,287.20	0.18
127	688198	佰仁医疗	12,098	1,242,343.62	0.18
128	688543	国科军工	20,524	1,235,339.56	0.18
129	688789	宏华数科	16,907	1,234,887.28	0.18
130	688362	甬矽电子	41,336	1,230,986.08	0.18
131	688306	均普智能	124,514	1,225,217.76	0.18
132	688289	圣湘生物	59,262	1,213,685.76	0.17
133	688076	ST 诺泰	32,419	1,206,635.18	0.17
134	688029	南微医学	17,860	1,206,443.00	0.17
135	688006	杭可科技	61,866	1,206,387.00	0.17
136	688700	东威科技	30,574	1,206,144.30	0.17
137	688584	上海合晶	67,046	1,198,782.48	0.17
138	688123	聚辰股份	14,479	1,172,654.21	0.17
139	688660	电气风电	134,263	1,165,402.84	0.17
140	688549	中巨芯	148,816	1,151,835.84	0.17
141	688001	华兴源创	45,437	1,148,192.99	0.16
142	688107	安路科技	40,588	1,146,205.12	0.16
143	688612	威迈斯	42,630	1,139,926.20	0.16
144	688591	泰凌微	23,676	1,134,080.40	0.16
145	688062	迈威生物	40,095	1,133,886.60	0.16
146	688439	振华风光	19,310	1,124,807.50	0.16
147	688739	成大生物	42,189	1,113,789.60	0.16
148	688182	灿勤科技	40,397	1,113,341.32	0.16
149	688300	联瑞新材	23,911	1,113,057.05	0.16
150	688063	派能科技	24,473	1,103,242.84	0.16
151	688380	中微半导	40,540	1,098,634.00	0.16
152	688161	威高骨科	40,344	1,080,815.76	0.16
153	688516	奥特维	32,413	1,077,408.12	0.15
154	688779	五矿新能	195,551	1,063,797.44	0.15
155	688519	南亚新材	23,723	1,062,790.40	0.15

156	688032	禾迈股份	10,639	1,062,410.54	0.15
157	688158	优刻得	46,835	1,059,407.70	0.15
158	688177	百奥泰	41,989	1,052,244.34	0.15
159	688390	固德威	24,151	1,049,360.95	0.15
160	688332	中科蓝讯	10,172	1,048,529.76	0.15
161	688127	蓝特光学	40,705	1,046,525.55	0.15
162	688232	新点软件	34,275	1,029,621.00	0.15
163	688083	中望软件	15,828	1,019,481.48	0.15
164	688151	华强科技	36,012	1,015,178.28	0.15
165	688443	智翔金泰	36,590	1,015,006.60	0.15
166	688252	天德钰	41,525	1,012,379.50	0.15
167	688139	海尔生物	32,749	1,011,616.61	0.15
168	688596	正帆科技	29,729	1,008,407.68	0.14
169	688102	斯瑞新材	74,432	1,003,343.36	0.14
170	688408	中信博	21,457	1,001,612.76	0.14
171	688503	聚和材料	24,198	1,001,555.22	0.14
172	688150	莱特光电	40,418	999,132.96	0.14
173	688128	中国电研	40,708	997,346.00	0.14
174	688131	皓元医药	20,527	992,480.45	0.14
175	688686	奥普特	10,363	990,910.06	0.14
176	688656	浩欧博	7,245	983,871.00	0.14
177	688321	微芯生物	41,309	982,328.02	0.14
178	688800	瑞可达	19,917	979,916.40	0.14
179	688270	臻镭科技	20,944	975,152.64	0.14
180	688698	伟创电气	20,573	971,045.60	0.14
181	688351	微电生理	48,518	955,804.60	0.14
182	688048	长光华芯	16,548	955,481.52	0.14
183	688366	昊海生科	18,582	952,141.68	0.14
184	688627	精智达	10,785	949,187.85	0.14
185	688190	云路股份	10,158	940,224.48	0.14
186	688091	上海谊众	20,098	940,184.44	0.14
187	688531	日联科技	13,117	939,177.20	0.13
188	688690	纳微科技	40,842	932,422.86	0.13
189	688016	心脉医疗	10,521	930,266.82	0.13
190	688262	国芯科技	34,755	926,915.85	0.13
191	688696	极米科技	8,013	916,366.68	0.13
192	688630	芯碁微装	11,446	908,469.02	0.13
193	688105	诺唯赞	40,004	905,290.52	0.13
194	688570	天玛智控	44,199	905,195.52	0.13
195	688205	德科立	14,437	905,055.53	0.13
196	688326	经纬恒润	10,129	903,911.96	0.13
197	688392	骄成超声	13,262	903,540.06	0.13
198	688586	江航装备	79,950	899,437.50	0.13

199	688652	京仪装备	15,647	896,886.04	0.13
200	688106	金宏气体	49,625	887,791.25	0.13
201	688138	清溢光电	32,539	884,735.41	0.13
202	688403	汇成股份	85,018	883,337.02	0.13
203	688523	航天环宇	41,046	882,899.46	0.13
204	688658	悦康药业	46,274	881,056.96	0.13
205	688368	晶丰明源	10,018	879,880.94	0.13
206	688276	百克生物	41,817	878,157.00	0.13
207	688388	嘉元科技	43,350	870,468.00	0.12
208	688003	天准科技	18,491	848,736.90	0.12
209	688575	亚辉龙	58,096	847,620.64	0.12
210	688766	普冉股份	13,307	841,002.40	0.12
211	688515	裕太微	9,131	836,399.60	0.12
212	688167	炬光科技	10,329	834,066.75	0.12
213	688160	步科股份	9,605	823,148.50	0.12
214	688225	亚信安全	40,206	819,800.34	0.12
215	688093	世华科技	26,258	815,310.90	0.12
216	688372	伟测科技	13,362	807,064.80	0.12
217	688209	英集芯	43,648	806,178.56	0.12
218	688559	海目星	24,496	805,918.40	0.12
219	688049	炬芯科技	13,161	796,240.50	0.11
220	688535	华海诚科	9,256	795,923.44	0.11
221	688639	华恒生物	25,045	793,926.50	0.11
222	688717	艾罗能源	14,675	789,955.25	0.11
223	688185	康希诺	13,200	787,116.00	0.11
224	688025	杰普特	10,899	779,278.50	0.11
225	688486	龙迅股份	11,557	772,932.16	0.11
226	688668	鼎通科技	12,341	770,818.86	0.11
227	688593	新相微	47,071	768,669.43	0.11
228	688084	晶品特装	8,652	761,376.00	0.11
229	688159	有方科技	10,564	757,121.88	0.11
230	688562	航天软件	40,294	755,109.56	0.11
231	688230	芯导科技	13,593	753,459.99	0.11
232	688526	科前生物	48,105	749,475.90	0.11
233	688507	索辰科技	10,156	744,739.48	0.11
234	688136	科兴制药	19,300	737,646.00	0.11
235	688787	海天瑞声	6,937	736,570.66	0.11
236	688685	迈信林	13,015	726,887.75	0.10
237	688518	联赢激光	35,383	721,459.37	0.10
238	688095	福昕软件	10,466	710,746.06	0.10
239	688553	汇宇制药	42,881	698,531.49	0.10
240	688550	瑞联新材	16,129	693,708.29	0.10
241	688707	振华新材	51,159	693,204.45	0.10

242	688513	苑东生物	16,647	683,525.82	0.10
243	688007	光峰科技	47,232	682,974.72	0.10
244	688311	盟升电子	15,579	670,675.95	0.10
245	688103	国力股份	10,972	667,536.48	0.10
246	688337	普源精电	18,691	666,707.97	0.10
247	688023	安恒信息	11,717	664,822.58	0.10
248	688365	光云科技	43,355	659,863.10	0.09
249	688788	科思科技	14,408	658,013.36	0.09
250	688499	利元亨	15,785	656,813.85	0.09
251	688428	诺诚健华	26,805	654,846.15	0.09
252	688222	成都先导	40,722	654,809.76	0.09
253	688305	科德数控	11,669	651,246.89	0.09
254	688320	禾川科技	13,693	647,541.97	0.09
255	688626	翔宇医疗	14,702	647,182.04	0.09
256	688319	欧林生物	41,288	646,570.08	0.09
257	688239	航宇科技	18,469	646,045.62	0.09
258	688401	路维光电	18,614	645,905.80	0.09
259	688277	天智航	46,447	645,613.30	0.09
260	688621	阳光诺和	12,864	641,784.96	0.09
261	688508	芯朋微	11,489	641,315.98	0.09
262	688622	禾信仪器	8,097	636,990.99	0.09
263	688505	复旦张江	72,720	629,755.20	0.09
264	688691	灿芯股份	10,141	627,322.26	0.09
265	688697	纽威数控	46,984	626,766.56	0.09
266	688510	航亚科技	25,845	624,932.10	0.09
267	688046	药康生物	41,551	624,927.04	0.09
268	688168	安博通	8,776	621,955.12	0.09
269	688219	会通股份	49,501	621,237.55	0.09
270	688606	奥泰生物	9,119	612,796.80	0.09
271	688348	昱能科技	14,229	611,420.13	0.09
272	688290	景业智能	11,707	610,168.84	0.09
273	688186	广大特材	21,109	603,928.49	0.09
274	688073	毕得医药	10,390	602,827.80	0.09
275	688458	美芯晟	12,772	602,327.52	0.09
276	688581	安杰思	9,280	601,622.40	0.09
277	688383	新益昌	11,734	596,791.24	0.09
278	688577	浙海德曼	12,690	595,034.10	0.09
279	688315	诺禾致源	42,128	594,847.36	0.09
280	688488	艾迪药业	42,732	591,838.20	0.08
281	688588	凌志软件	40,528	590,492.96	0.08
282	688429	时创能源	40,540	589,451.60	0.08
283	688293	奥浦迈	13,008	585,490.08	0.08
284	688359	三孚新科	11,062	583,409.88	0.08

285	688299	长阳科技	29,494	583,096.38	0.08
286	688212	澳华内镜	11,855	580,895.00	0.08
287	688371	菲沃泰	34,746	575,393.76	0.08
288	688173	希荻微	41,727	569,990.82	0.08
289	688648	中邮科技	12,004	566,228.68	0.08
290	688386	泛亚微透	10,362	562,760.22	0.08
291	688389	普门科技	43,485	561,826.20	0.08
292	688719	爱科赛博	13,190	560,575.00	0.08
293	688334	西高院	32,546	559,140.28	0.08
294	688155	先惠技术	10,782	556,566.84	0.08
295	688556	高测股份	76,968	552,630.24	0.08
296	688661	和林微纳	13,877	551,888.29	0.08
297	688625	呈和科技	18,012	550,806.96	0.08
298	688236	春立医疗	29,535	549,055.65	0.08
299	688152	麒麟信安	11,689	547,746.54	0.08
300	688191	智洋创新	22,955	545,869.90	0.08
301	688590	新致软件	26,400	542,256.00	0.08
302	688112	鼎阳科技	14,633	540,982.01	0.08
303	688085	三友医疗	28,055	539,497.65	0.08
304	688381	帝奥微	24,804	537,254.64	0.08
305	688298	东方生物	19,531	534,172.85	0.08
306	688489	三未信安	13,096	532,745.28	0.08
307	688653	康希通信	43,472	532,532.00	0.08
308	688636	智明达	15,631	528,171.49	0.08
309	688302	海创药业	11,276	527,716.80	0.08
310	688609	九联科技	50,345	527,112.15	0.08
311	688566	吉贝尔	19,187	521,694.53	0.07
312	688176	亚虹医药	58,340	517,475.80	0.07
313	688665	四方光电	11,542	516,158.24	0.07
314	688035	德邦科技	12,690	515,467.80	0.07
315	688512	慧智微	47,232	515,301.12	0.07
316	688157	松井股份	12,886	513,893.68	0.07
317	688268	华特气体	10,187	513,119.19	0.07
318	688066	航天宏图	26,183	512,663.14	0.07
319	688580	伟思医疗	10,902	506,833.98	0.07
320	688259	创耀科技	12,778	506,647.70	0.07
321	688195	腾景科技	11,253	506,385.00	0.07
322	688233	神工股份	15,903	505,238.31	0.07
323	688598	金博股份	19,788	503,010.96	0.07
324	688678	福立旺	26,224	499,304.96	0.07
325	688258	卓易信息	10,193	493,646.99	0.07
326	688620	安凯微	39,227	490,729.77	0.07
327	688196	卓越新能	10,183	489,496.81	0.07

328	688356	键凯科技	6,924	488,834.40	0.07
329	688360	德马科技	26,349	488,773.95	0.07
330	688399	硕世生物	9,674	488,537.00	0.07
331	688117	圣诺生物	14,503	488,025.95	0.07
332	688070	纵横股份	10,057	485,753.10	0.07
333	688418	震有科技	18,350	485,541.00	0.07
334	688197	首药控股	13,395	484,899.00	0.07
335	688101	三达膜	34,580	482,045.20	0.07
336	688353	华盛锂电	14,563	481,744.04	0.07
337	688767	博拓生物	13,450	481,510.00	0.07
338	688031	星环科技	10,297	480,149.11	0.07
339	688459	哈铁科技	49,836	478,425.60	0.07
340	688247	宣泰医药	46,306	478,340.98	0.07
341	688267	中触媒	16,597	477,661.66	0.07
342	688595	芯海科技	12,767	477,358.13	0.07
343	688282	理工导航	10,007	476,733.48	0.07
344	688325	赛微微电	9,928	476,544.00	0.07
345	688119	中钢洛耐	113,989	476,474.02	0.07
346	688722	同益中	22,265	473,576.55	0.07
347	688410	山外山	33,328	473,257.60	0.07
348	688603	天承科技	10,628	469,757.60	0.07
349	688108	赛诺医疗	41,861	469,680.42	0.07
350	688799	华纳药厂	11,369	469,539.70	0.07
351	688539	高华科技	17,607	468,346.20	0.07
352	688226	威腾电气	17,913	468,245.82	0.07
353	688601	力芯微	11,681	466,655.95	0.07
354	688059	华锐精密	9,898	462,830.48	0.07
355	688087	英科再生	17,843	458,565.10	0.07
356	688010	福光股份	14,684	455,791.36	0.07
357	688228	开普云	7,670	455,444.60	0.07
358	688579	山大地纬	40,508	453,284.52	0.07
359	688611	杭州柯林	13,856	452,121.28	0.06
360	688286	敏芯股份	6,379	450,931.51	0.06
361	688377	迪威尔	18,619	444,435.53	0.06
362	688376	美埃科技	11,887	443,028.49	0.06
363	688231	隆达股份	24,534	442,838.70	0.06
364	688280	精进电动	60,771	441,805.17	0.06
365	688768	容知日新	9,948	441,591.72	0.06
366	688602	康鹏科技	52,637	441,098.06	0.06
367	688275	万润新能	10,780	437,129.00	0.06
368	688179	阿拉丁	34,338	436,779.36	0.06
369	688720	艾森股份	10,159	434,703.61	0.06
370	688061	灿瑞科技	13,154	431,451.20	0.06

371	688496	清越科技	46,354	431,092.20	0.06
372	688080	映翰通	8,470	431,038.30	0.06
373	688261	东微半导	10,426	430,072.50	0.06
374	688628	优利德	12,798	429,372.90	0.06
375	688456	有研粉材	11,937	429,135.15	0.06
376	688680	海优新材	9,659	426,927.80	0.06
377	688687	凯因科技	16,046	426,663.14	0.06
378	688569	铁科轨道	20,575	423,845.00	0.06
379	688255	凯尔达	12,576	423,685.44	0.06
380	688623	双元科技	6,722	421,939.94	0.06
381	688202	美迪西	11,738	421,746.34	0.06
382	688201	信安世纪	32,558	421,626.10	0.06
383	688378	奥来德	24,972	420,778.20	0.06
384	688039	当虹科技	12,812	420,489.84	0.06
385	688075	安旭生物	10,899	418,194.63	0.06
386	688077	大地熊	13,080	417,906.00	0.06
387	688079	美迪凯	41,135	412,995.40	0.06
388	688373	盟科药业	65,550	410,998.50	0.06
389	688143	长盈通	10,484	408,876.00	0.06
390	688227	品高股份	12,998	408,657.12	0.06
391	688699	明微电子	12,482	404,167.16	0.06
392	688533	上声电子	15,006	404,111.58	0.06
393	688135	利扬芯片	19,388	401,525.48	0.06
394	688238	和元生物	64,695	401,109.00	0.06
395	688339	亿华通	18,720	399,672.00	0.06
396	688089	嘉必优	15,781	396,892.15	0.06
397	688677	海泰新光	10,104	394,157.04	0.06
398	688115	思林杰	7,658	393,621.20	0.06
399	688207	格灵深瞳	25,936	391,633.60	0.06
400	688391	钜泉科技	13,105	389,087.45	0.06
401	688573	信宇人	11,082	383,437.20	0.06
402	688416	恒烁股份	9,518	383,194.68	0.06
403	688358	祥生医疗	12,918	383,018.70	0.05
404	688269	凯立新材	11,455	380,306.00	0.05
405	688478	晶升股份	12,357	378,124.20	0.05
406	688015	交控科技	18,079	376,766.36	0.05
407	688500	慧辰股份	8,583	375,077.10	0.05
408	688257	新锐股份	25,517	373,824.05	0.05
409	688221	前沿生物	37,218	373,668.72	0.05
410	688253	英诺特	12,076	372,665.36	0.05
411	688662	富信科技	10,129	369,202.05	0.05
412	688090	瑞松科技	10,645	366,081.55	0.05
413	688181	八亿时空	11,761	366,002.32	0.05

414	688033	天宜新材	57,032	365,575.12	0.05
415	688716	中研股份	10,243	364,650.80	0.05
416	688682	霍莱沃	11,644	364,457.20	0.05
417	688244	永信至诚	13,815	363,610.80	0.05
418	688733	壹石通	19,040	360,617.60	0.05
419	688711	宏微科技	20,455	359,803.45	0.05
420	688211	中科微至	11,358	359,480.70	0.05
421	688683	莱尔科技	14,192	357,922.24	0.05
422	688291	金橙子	11,787	357,263.97	0.05
423	688071	华依科技	9,790	356,845.50	0.05
424	688379	华光新材	10,295	356,824.70	0.05
425	688633	星球石墨	13,013	354,343.99	0.05
426	688246	嘉和美康	12,038	353,796.82	0.05
427	688053	思科瑞	11,433	353,622.69	0.05
428	688199	久日新材	14,945	352,702.00	0.05
429	688480	赛恩斯	10,904	350,563.60	0.05
430	688133	泰坦科技	15,170	349,213.40	0.05
431	688020	方邦股份	9,221	349,199.27	0.05
432	688273	麦澜德	11,546	348,804.66	0.05
433	688557	兰剑智能	11,650	348,684.50	0.05
434	688419	耐科装备	9,304	346,853.12	0.05
435	688369	致远互联	13,138	346,711.82	0.05
436	688316	青云科技	5,449	345,303.13	0.05
437	688125	安达智能	9,388	344,539.60	0.05
438	688057	金达莱	27,857	339,855.40	0.05
439	688210	统联精密	14,843	338,420.40	0.05
440	688663	新风光	12,452	335,581.40	0.05
441	688288	鸿泉物联	11,560	335,355.60	0.05
442	688357	建龙微纳	11,540	332,236.60	0.05
443	688162	巨一科技	12,191	332,082.84	0.05
444	688592	司南导航	7,163	331,575.27	0.05
445	688317	之江生物	18,325	330,216.50	0.05
446	688576	西山科技	5,178	329,320.80	0.05
447	688509	正元地信	76,672	328,922.88	0.05
448	688398	赛特新材	15,795	327,114.45	0.05
449	688571	杭华股份	42,319	326,279.49	0.05
450	688793	倍轻松	9,762	324,976.98	0.05
451	688657	浩辰软件	7,546	320,478.62	0.05
452	688345	博力威	11,602	319,635.10	0.05
453	688585	上纬新材	40,812	317,517.36	0.05
454	688330	宏力达	12,287	315,530.16	0.05
455	688667	菱电电控	5,910	314,471.10	0.05
456	688312	燕麦科技	12,972	311,717.16	0.04

457	688435	英方软件	9,451	311,315.94	0.04
458	688285	高铁电气	37,951	311,198.20	0.04
459	688137	近岸蛋白	8,090	309,847.00	0.04
460	688610	埃科光电	7,741	307,008.06	0.04
461	688393	安必平	10,665	306,512.10	0.04
462	688618	三旺通信	12,487	304,682.80	0.04
463	688338	赛科希德	12,022	302,713.96	0.04
464	688237	超卓航科	10,320	301,653.60	0.04
465	688170	德龙激光	11,951	301,165.20	0.04
466	688468	科美诊断	40,873	300,825.28	0.04
467	688786	悦安新材	12,867	299,801.10	0.04
468	688028	沃尔德	13,812	299,720.40	0.04
469	688011	新光光电	11,331	296,305.65	0.04
470	688651	盛邦安全	8,650	295,224.50	0.04
471	688560	明冠新材	19,405	294,373.85	0.04
472	688171	纬德信息	9,500	292,220.00	0.04
473	688501	青达环保	10,489	292,118.65	0.04
474	688558	国盛智科	11,535	291,143.40	0.04
475	688695	中创股份	9,745	289,426.50	0.04
476	688314	康拓医疗	9,301	287,214.88	0.04
477	688307	中润光学	10,026	285,139.44	0.04
478	688283	坤恒顺维	10,368	284,601.60	0.04
479	688132	邦彦技术	14,014	284,484.20	0.04
480	688551	科威尔	9,671	284,230.69	0.04
481	688265	南模生物	8,817	283,995.57	0.04
482	688426	康为世纪	12,793	283,620.81	0.04
483	688109	品茗科技	9,051	281,757.63	0.04
484	688589	力合微	13,141	281,085.99	0.04
485	688216	气派科技	12,238	280,617.34	0.04
486	688121	卓然股份	23,216	280,449.28	0.04
487	688292	浩瀚深度	14,508	279,133.92	0.04
488	688529	豪森智能	15,554	279,038.76	0.04
489	688600	皖仪科技	11,848	278,428.00	0.04
490	688129	东来技术	10,216	277,875.20	0.04
491	688030	山石网科	17,266	276,083.34	0.04
492	688693	锆威特	8,354	275,765.54	0.04
493	688148	芳源股份	50,953	275,655.73	0.04
494	688013	天臣医疗	9,377	274,089.71	0.04
495	688045	必易微	7,920	272,448.00	0.04
496	688597	煜邦电力	34,525	270,330.75	0.04
497	688308	欧科亿	14,578	268,964.10	0.04
498	688113	联测科技	7,286	263,680.34	0.04
499	688078	龙软科技	8,229	260,859.30	0.04

500	688689	银河微电	11,282	260,275.74	0.04
501	688056	莱伯泰科	7,745	258,528.10	0.04
502	688229	博睿数据	5,072	258,418.40	0.04
503	688058	宝兰德	8,985	257,599.95	0.04
504	688098	申联生物	41,703	254,805.33	0.04
505	688203	海正生材	19,783	250,452.78	0.04
506	688323	瑞华泰	17,259	250,428.09	0.04
507	688638	誉辰智能	6,438	250,180.68	0.04
508	688069	德林海	12,817	249,290.65	0.04
509	688655	迅捷兴	11,746	248,897.74	0.04
510	688060	云涌科技	6,790	248,446.10	0.04
511	688328	深科达	10,897	246,817.05	0.04
512	688081	兴图新科	11,799	245,537.19	0.04
513	688022	瀚川智能	16,565	245,493.30	0.04
514	688420	美腾科技	10,237	244,050.08	0.04
515	688530	欧莱新材	14,774	243,327.78	0.03
516	688455	科捷智能	17,163	241,483.41	0.03
517	688479	友车科技	12,765	241,258.50	0.03
518	688448	磁谷科技	8,168	239,240.72	0.03
519	688163	赛伦生物	12,275	238,748.75	0.03
520	688619	罗普特	17,814	236,926.20	0.03
521	688118	普元信息	10,522	235,166.70	0.03
522	688272	富吉瑞	8,654	234,090.70	0.03
523	688096	京源环保	15,193	231,237.46	0.03
524	688613	奥精医疗	12,031	230,032.72	0.03
525	688370	丛麟科技	12,028	229,855.08	0.03
526	688175	高凌信息	11,250	228,712.50	0.03
527	688215	瑞晟智能	5,948	226,142.96	0.03
528	688178	万德斯	9,813	225,895.26	0.03
529	688310	迈得医疗	15,302	225,551.48	0.03
530	688395	正弦电气	9,924	225,076.32	0.03
531	688130	晶华微	10,094	223,077.40	0.03
532	688616	西力科技	17,219	219,025.68	0.03
533	688051	佳华科技	8,789	218,758.21	0.03
534	688218	江苏北人	9,953	215,980.10	0.03
535	688251	井松智能	9,985	215,276.60	0.03
536	688737	中自科技	9,950	213,925.00	0.03
537	688092	爱科科技	9,510	212,073.00	0.03
538	688026	洁特生物	12,465	204,426.00	0.03
539	688450	光格科技	7,694	203,275.48	0.03
540	688189	南新制药	27,306	203,156.64	0.03
541	688156	路德环境	11,475	194,042.25	0.03
542	688671	碧兴物联	9,046	193,132.10	0.03

543	688669	聚石化学	10,199	192,455.13	0.03
544	688607	康众医疗	10,141	190,143.75	0.03
545	688193	仁度生物	4,494	188,882.82	0.03
546	688038	中科通达	11,802	187,297.74	0.03
547	688355	明志科技	10,595	186,154.15	0.03
548	688466	金科环境	10,524	186,064.32	0.03
549	688004	博汇科技	9,204	183,159.60	0.03
550	688367	工大高科	10,123	178,670.95	0.03
551	688517	金冠电气	12,016	172,790.08	0.02
552	688329	艾隆科技	8,869	170,639.56	0.02
553	688681	科汇股份	12,164	170,296.00	0.02
554	688067	爱威科技	7,873	169,348.23	0.02
555	688679	通源环境	11,261	168,577.17	0.02
556	688309	恒誉环保	9,335	167,189.85	0.02
557	688217	睿昂基因	6,530	165,209.00	0.02
558	688528	秦川物联	15,922	164,951.92	0.02
559	688260	昀冢科技	9,964	164,206.72	0.02
560	688350	富淼科技	10,287	163,974.78	0.02
561	688296	和达科技	12,432	163,232.16	0.02
562	688335	复洁环保	13,317	162,467.40	0.02
563	688485	九州一轨	13,852	150,848.28	0.02
564	688670	金迪克	10,658	148,679.10	0.02
565	688659	元琛科技	15,124	132,032.52	0.02
566	688021	奥福科技	8,595	131,417.55	0.02
567	688565	力源科技	14,087	130,304.75	0.02
568	688701	卓锦股份	11,447	94,323.28	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	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
2	603049	中策橡胶	442	18,939.70	0.00
3	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
4	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
5	603202	天有为	60	5,439.60	0.00
6	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
7	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
8	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
9	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	688041	海光信息	70,567,839.37	10.13
2	688256	寒武纪	59,507,545.17	8.54
3	688981	中芯国际	37,060,057.44	5.32
4	688111	金山办公	31,348,558.91	4.50
5	688012	中微公司	25,122,835.58	3.61
6	688271	联影医疗	21,575,637.71	3.10
7	688036	传音控股	20,495,186.77	2.94
8	688506	百利天恒	17,652,025.77	2.53
9	688008	澜起科技	17,065,495.47	2.45
10	688608	恒玄科技	14,191,467.92	2.04
11	688223	晶科能源	13,160,935.71	1.89
12	688396	华润微	12,747,420.58	1.83
13	688169	石头科技	12,536,524.03	1.80
14	688617	惠泰医疗	11,481,956.15	1.65
15	688047	龙芯中科	10,757,503.75	1.54
16	688188	柏楚电子	10,058,393.41	1.44
17	688009	中国通号	9,587,368.99	1.38
18	688072	拓荆科技	9,494,104.73	1.36
19	688249	晶合集成	9,110,194.83	1.31
20	688303	大全能源	9,012,277.46	1.29

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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。

7.4.2 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	688608	恒玄科技	7,191,157.06	1.03
2	688617	惠泰医疗	6,939,328.35	1.00
3	688235	百济神州	5,369,861.45	0.77
4	688027	国盾量子	5,270,435.19	0.76
5	688279	峰昭科技	4,521,450.26	0.65
6	688041	海光信息	4,426,124.44	0.64
7	688018	乐鑫科技	4,145,102.81	0.60

8	688052	纳芯微	3,259,514.25	0.47
9	688019	安集科技	3,090,265.31	0.44
10	688536	思瑞浦	2,867,183.15	0.41
11	688502	茂莱光学	2,855,684.77	0.41
12	688200	华峰测控	2,536,327.90	0.36
13	688256	寒武纪	2,480,284.61	0.36
14	688012	中微公司	2,273,916.85	0.33
15	688486	龙迅股份	2,246,718.14	0.32
16	688498	源杰科技	2,148,900.30	0.31
17	688169	石头科技	2,148,579.79	0.31
18	688301	奕瑞科技	2,085,588.48	0.30
19	688766	普冉股份	1,962,802.42	0.28
20	688332	中科蓝讯	1,890,039.39	0.27

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,543,801,271.87
卖出股票收入（成交）总额	299,769,205.40

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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。

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。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除传音控股（证券代码 688036）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据 2024 年 11 月 8 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被广东省深圳市住房和建设局处以罚款。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收清算款	1,714,137.85
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	-
8	其他	-
9	合计	1,714,137.85

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说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.01	新股流通受限
2	603049	中策橡胶	18,939.70	0.00	新股流通受限
3	688755	汉邦科技	7,983.99	0.00	新股流通受限
4	603014	威高血净	6,699.40	0.00	新股流通受限
5	603202	天有为	5,439.60	0.00	新股流通受限

§ 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	招商上证科创板综合 ETF 联接

		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
3,073	230,578.97	492,349,966.00	69.49%	216,219,200.00	30.51%	406,284,300.00	57.34%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	方正证券股份有限公司	20,125,366.00	2.84%
2	和泰人寿保险股份有限公司-传统保险产品	10,230,000.00	1.44%
3	招商证券股份有限公司	7,643,100.00	1.08%
4	国泰海通证券股份有限公司	6,544,400.00	0.92%
5	深圳君宜私募证券投资基金管理有限公司-君宜敬天私募证券投资基金	5,000,000.00	0.71%
6	王国栋	5,000,000.00	0.71%
7	中国银河证券股份有限公司	5,000,000.00	0.71%
8	卢凤仙	5,000,000.00	0.71%
9	张镫方	4,971,700.00	0.70%
10	长江证券股份有限公司	4,115,500.00	0.58%
-	招商上证科创板综合 ETF 联接	406,284,300.00	57.34%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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	48,200.00	0.0068%

8.4 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 2 月 26 日)基金份额总额	1,288,569,166.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,115,000,000.00

减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,695,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	708,569,166.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

根据本基金管理人 2025 年 5 月 20 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第四次会议审议通过，同意徐勇先生辞任公司总经理职务，聘任钟文岳先生为公司总经理。

根据本基金管理人 2025 年 5 月 30 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任王景女士、朱红裕先生、陈方元先生为公司首席（副总经理级）。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 19 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第六次会议审议通过，同意董方先生辞任公司副总经理职务。

根据本基金管理人 2025 年 6 月 27 日的公告，经招商基金管理有限公司第七届董事会 2025 年第五次会议审议通过，同意聘任于立勇先生为公司首席（副总经理级）。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
国泰海通证券	5	1,842,881,251.39	100.00%	183,367.90	100.00%	本报告期新增

注：（一）选择标准

1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。

2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用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
国泰海通证券	180,158.79	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-10
2	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-10
3	招商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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-10
4	招商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及招募说明书提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2025-02-10
5	招商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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-10
6	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-10
7	关于招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司等公司为网下现金、网下股票销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-17
8	关于招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-21
9	招商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生效公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-27
10	关于开放招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金日常申购赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-28
11	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-02-28
12	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2025-02-28
13	关于招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司等渠道为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-05
14	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-05

15	招商基金管理有限公司关于招融资本私募股权基金管理（深圳）有限责任公司股东变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-08
16	关于招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加中国国际金融股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-03-12
17	招商基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-08
18	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-15
19	关于招商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变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-17
20	招商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(二零二五年第一号)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-22
21	招商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	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-04-22
22	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-09
23	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-20
24	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-05-30
25	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加浙商证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-03
26	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-19
27	招商基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§ 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
招商上证科创板综合 ETF 联接	1	20250414-20250630	-	1,006,283,100.00	599,998,800.00	406,284,300.00	57.34%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，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、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商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》；
- 4、《招商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》；
- 5、《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司
地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日