

鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证  
券投资基金  
2025 年中期报告

2025 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：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、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，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 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 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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 .....	59
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 .....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
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 .....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 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	2,209,943,666.00 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	<p>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。</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>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。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

	<p><b>3、存托凭证投资策略</b>          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。</p> <p><b>4、债券投资策略</b>          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。</p> <p><b>5、股指期货投资策略</b>          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。</p> <p><b>6、资产支持证券的投资策略</b>          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。</p> <p><b>7、融资及转融通投资策略</b>          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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>上证科创板综合指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>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、</p>

	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		4006788999	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	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(2025年2月26日(基金合同生效日) - 2025年6月30日)
本期已实现收益	-26,827,822.75
本期利润	19,030,094.59
加权平均基金份额本期利润	0.0092
本期加权平均净值利润率	0.97%
本期基金份额净值增长率	-2.18%
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	-48,208,890.43

期末可供分配基金份额利润	-0.0218
期末基金资产净值	2,161,734,775.57
期末基金份额净值	0.9782
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	-2.18%

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。

(4) 本基金基金合同于2025年02月26日生效，至2025年06月30日未满6个月。

## 3.2 基金净值表现

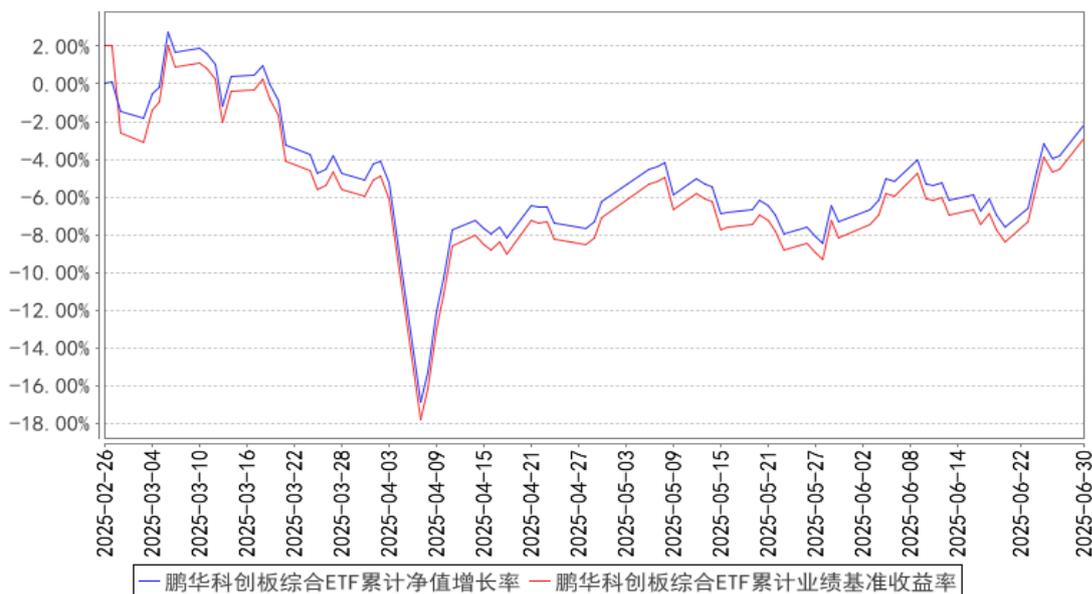
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.57%	1.00%	5.71%	1.01%	-0.14%	-0.01%
过去三个月	3.10%	1.97%	3.27%	1.99%	-0.17%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.18%	1.77%	-2.89%	1.88%	0.71%	-0.11%

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

鹏华科创板综合ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

### 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达到 12,513 亿元，359 只公募基金、12 只全国社保投资组合、8 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、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		

<p>苏俊杰</p>	<p>本基金的基金经理</p>	<p>2025-02-26</p>	<p>-</p>	<p>13 年</p>	<p>苏俊杰先生, 国籍中国, 理学硕士, 13 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 月至今担任鹏华沪深 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 月至今担任鹏华沪深 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</p>
------------	-----------------	-------------------	----------	-------------	---

					06 月至今担任鹏华中证 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，苏俊杰先生具备基金从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1. 基金经理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

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生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% 的情况。

#### 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

A 股上半年震荡走高，在经历了年初由 deepseek 带动的春季躁动行情之后，二季度开始市场的主线围绕对等关税和稳增长政策展开。当市场受到对等关税的影响出现了比较剧烈的波动时候，

我们仍然坚持认为从中长期来看，关税无碍中国制造业的全球竞争力，A 股当前的配置价值依然很高，包括海外资金在内的增量资金有望持续增配中国权益资产，从而推动市场的持续上行；事后来看，A 股在二季度初经历短暂下挫后稳步震荡上行，在过程中市场情绪和赚钱效应也得以逐步修复。

展望下半年，随着风险偏好回暖，A 股下半年有望持续迎来增量资金入场，市场或延续结构性机会，不管是低估值高分红的价值型股票，还是市场空间大、渗透率低的成长类主题投资，都有可能成为资金关注的方向，配置上仍然推荐哑铃型的结构。

本基金一直以来秉承指数基金的投资策略，致力于通过精细化管理实现跟踪误差的最小化。在基金运作过程中，采用全复制法构建投资组合，即按照标的指数的成分股权重比例进行配置，以确保组合结构与指数的一致性。为应对日常申购赎回的需求，对组合进行适时的动态调整。同时建立了完善的组合再平衡机制，定期根据指数成分股调整和权重变化对投资组合进行优化。

#### 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-2.18%，同期业绩比较基准增长率为-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

2025 年下半年宏观经济预计仍然面临一系列挑战，一方面，美国对等关税政策对进出口贸易带来极大的不确定性，出口短期可能维持较高增速，但后期受关税上升影响易放缓；另一方面，国内有效需求仍然不足，价格仍然偏弱，需要重点关注政策的支持力度。预计政策会从需求和供给两个维度，双管齐下，通过反内卷出清行业过剩产能，提振价格，实现行业高质量发展，同时在需求端继续加力各类政策补贴、基建等。

市场走势上，在政策共识、盈利回升和资金回流共振驱动下，A 股可能在 2025 年下半年迎来真正行情拐点。美联储降息预期不断增强，全球流动性共振宽松，叠加中美关系缓和，将吸引外资回流；赚钱效应的改善，将推动股市作为居民资产配置的新蓄水池；此外机构的中长期配置资金也会继续有序的进入到市场中来。随着市场成熟度提升，未来市场的波动率有望实现系统性的降低，A 股市场可能会进入真正意义上的慢牛，长牛。

#### 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-48,208,890.43 元，期末基金份额净值 0.9782 元，不符合利润分配条件。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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：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：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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	35,172,979.47
结算备付金		33,420.40
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,126,408,555.02
其中：股票投资		2,126,408,555.02
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		418,775.57
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	81,877.50
资产总计		2,162,115,607.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		270,454.61
应付托管费		90,151.53
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	20,226.25
负债合计		380,832.39
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	2,209,943,666.00
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-48,208,890.43
净资产合计		2,161,734,775.57
负债和净资产总计		2,162,115,607.96

注：(1) 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9782 元，基金份额总额 2,209,943,666.00 份。

(2) 本财务报表的实际编制期间为 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日，无上年度末数据。

## 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：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
<b>一、营业总收入</b>		20,449,218.76
1. 利息收入		195,014.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	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）		-25,588,791.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-32,957,143.86
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	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	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	-14,922.29
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,419,124.17</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,006,128.09
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	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	77,620.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>19,030,094.59</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>19,030,094.59</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>19,030,094.59</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比较期间及可比较数据。

### 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：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	1,729,943,666.00	-	-	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	1,820,000,000.00	-	58,731,720.78	1,761,268,279.22
(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	2,161,734,775.57

注：本财务报表的实际编制期间为 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止期间，无上年度可比期间及可比数据。

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《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>》、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《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》和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 2025 年 02 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日止期间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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 02 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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 2025 年

02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具；即不包含付款的合同义务且享有发行人净资产和剩余收益的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金

持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比

例计算认列。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税(和/或)股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率或者发行价计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息以及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。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费(如有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下,每次收益分配比例根据以下原则确定:使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 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。

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,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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 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,若出现以下情形,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券,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,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值

业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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[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[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》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，暂适用简易计税方法，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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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	
	2025年6月30日	
活期存款	10,143,655.89	
等于：本金	10,142,815.40	
加：应计利息	840.49	
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	25,029,323.58	
等于：本金	25,028,704.67	
加：应计利息	618.91	
减：坏账准备	-	
合计	35,172,979.47	

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			
	2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,080,550,637.68	-	2,126,408,555.02	45,857,917.34
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	2,080,550,637.68	-	2,126,408,555.02	45,857,917.34

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 2025年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	81,877.50
合计	81,877.50

## 6.4.7.9 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	20,226.25
合计	20,226.25

## 6.4.7.10 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	1,729,943,666.00	1,729,943,666.00
本期申购	2,300,000,000.00	2,300,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,820,000,000.00	-1,820,000,000.00
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	2,209,943,666.00	2,209,943,666.00

注：1、本基金自2025年2月17日至2025年2月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,729,942,000.00元，折合为1,729,942,000.00份基金份额。根据《鹏华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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币1,666.00元，在本基金成立后，折合为1,666.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、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
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	-26,827,822.75	45,857,917.34	19,030,094.59
本期基金份额交易产生的变动数	-7,206,214.29	-60,032,770.73	-67,238,985.02
其中：基金申购款	-17,379,720.03	-108,590,985.77	-125,970,705.80
基金赎回款	10,173,505.74	48,558,215.04	58,731,720.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,034,037.04	-14,174,853.39	-48,208,890.43

## 6.4.7.13 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	45,664.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	19,138.05
结算备付金利息收入	33,420.40
其他	96,791.58
合计	195,014.98

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
	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	-4,999,499.95
股票投资收益——赎回差价收入	-27,957,643.91

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	-32,957,143.86

#### 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 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	270,810,397.07
减：卖出股票成本总额	275,073,598.39
减：交易费用	736,298.63
买卖股票差价收入	-4,999,499.95

#### 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 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	1,761,268,279.22
减：现金支付赎回款总额	40,972,550.22
减：赎回股票成本总额	1,748,253,372.91
减：交易费用	-
赎回差价收入	-27,957,643.91

#### 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
	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	7,368,352.59
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	7,368,352.59

## 6.4.7.20 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	45,857,917.34
股票投资	45,857,917.34
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	45,857,917.34

## 6.4.7.21 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	-14,922.29
合计	-14,922.29

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
	2025年2月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日
审计费用	20,226.25
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,069.65
登记结算费	55,622.50

存托服务费	701.63
合计	77,620.03

#### 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

本基金基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，截至本报告期末不满一年，无上年度可比期间数据。

##### 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 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（%）
国信证券	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 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 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	1,006,128.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	162,569.56
应支付基金管理人的净管理费	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
	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	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自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 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（%）
国信证券	3,441,300.00	0.16
鹏华上证科创综合ETF联接	299,976,500.00	13.57

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 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	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：本基金在本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金在上年度可比期间未成立。

## 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（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

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
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项	38.05	2025年7月11日	39.98	143,578	2,807,951.83	5,463,142.90	-

## 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 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（未满一年）。

#### **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 2025 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 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	35,172,979.47	-	-	-	35,172,979.47
结算备付金	33,420.40	-	-	-	33,420.40
交易性金融资产	-	-	-	-2,126,408,555.02	2,126,408,555.02
应收清算款	-	-	-	418,775.57	418,775.57
其他资产	-	-	-	81,877.50	81,877.50
资产总计	35,206,399.87	-	-	-2,126,909,208.09	2,162,115,607.96
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	270,454.61	270,454.61
应付托管费	-	-	-	90,151.53	90,151.53
其他负债	-	-	-	20,226.25	20,226.25
负债总计	-	-	-	380,832.39	380,832.39
利率敏感度缺口	35,206,399.87	-	-	-2,126,528,375.70	2,161,734,775.57

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2025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 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	2,126,408,555.02	98.37
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	2,126,408,555.02	98.37

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

注：于 2025 年 06 月 30 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 2025年6月30日
第一层次	2,120,945,412.12
第二层次	5,463,142.90
第三层次	-
合计	2,126,408,555.02

#### 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	2,126,408,555.02	98.35
	其中：股票	2,126,408,555.02	98.35
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	35,206,399.87	1.63
8	其他各项资产	500,653.07	0.02
9	合计	2,162,115,607.96	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：13,196,507.59 元，占净值比 0.61%。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	1,706,524,946.88	78.94
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	377,395,888.04	17.46

	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	35,665,522.64	1.65
N	水利、环境和公共设施管理业	6,822,197.46	0.32
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	2,126,408,555.02	98.37

### 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

注：无。

### 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	688041	海光信息	723,168	102,176,406.72	4.73
2	688256	寒武纪-U	130,073	78,238,909.50	3.62
3	688981	中芯国际	618,808	54,560,301.36	2.52
4	688111	金山办公	143,823	40,277,631.15	1.86
5	688506	百利天恒	124,769	36,946,596.28	1.71
6	688012	中微公司	194,318	35,424,171.40	1.64
7	688271	联影医疗	256,638	32,782,938.12	1.52
8	688008	澜起科技	356,033	29,194,706.00	1.35
9	688036	传音控股	354,639	28,264,728.30	1.31
10	688396	华润微	413,320	19,492,171.20	0.90
11	688047	龙芯中科	124,684	16,631,598.76	0.77
12	688223	晶科能源	3,113,715	16,160,180.85	0.75
13	688126	沪硅产业	854,699	15,999,965.28	0.74
14	688082	盛美上海	137,596	15,677,688.24	0.73

15	688521	芯原股份	155,755	15,030,357.50	0.70
16	688303	大全能源	668,259	14,247,281.88	0.66
17	688009	中国通号	2,683,350	13,792,419.00	0.64
18	688072	拓荆科技	87,177	13,399,976.67	0.62
19	688183	生益电子	259,065	13,264,128.00	0.61
20	688608	恒玄科技	38,000	13,223,240.00	0.61
21	689009	九号公司-WD	223,027	13,196,507.59	0.61
22	688578	艾力斯	140,420	13,064,676.80	0.60
23	688617	惠泰医疗	43,242	12,842,874.00	0.59
24	688213	思特威-W	125,009	12,778,419.98	0.59
25	688249	晶合集成	624,899	12,666,702.73	0.59
26	688169	石头科技	80,543	12,609,006.65	0.58
27	688728	格科微	809,500	12,466,300.00	0.58
28	688120	华海清科	73,522	12,403,161.40	0.57
29	688188	柏楚电子	89,956	11,843,606.96	0.55
30	688187	时代电气	269,995	11,515,286.75	0.53
31	688297	中无人机	210,416	11,236,214.40	0.52
32	688375	国博电子	185,284	11,118,892.84	0.51
33	688777	中控技术	245,854	11,041,303.14	0.51
34	688065	凯赛生物	224,143	10,557,135.30	0.49
35	688472	阿特斯	1,146,980	10,494,867.00	0.49
36	688469	芯联集成-U	2,199,695	10,492,545.15	0.49
37	688122	西部超导	202,114	10,485,674.32	0.49
38	688336	三生国健	191,930	10,410,283.20	0.48
39	688220	翱捷科技-U	130,149	10,190,666.70	0.47
40	688538	和辉光电-U	4,305,118	10,073,976.12	0.47
41	688002	睿创微纳	141,743	9,882,321.96	0.46
42	688599	天合光能	678,107	9,852,894.71	0.46
43	688525	佰维存储	143,286	9,657,476.40	0.45
44	688349	三一重能	381,740	9,520,595.60	0.44
45	688099	晶晨股份	131,329	9,325,672.29	0.43
46	688318	财富趋势	79,693	9,158,319.56	0.42
47	688278	特宝生物	126,714	9,137,346.54	0.42
48	688568	中科星图	252,337	9,086,655.37	0.42
49	688027	国盾量子	32,580	8,959,825.80	0.41
50	688266	泽璟制药-U	82,343	8,852,695.93	0.41
51	688192	迪哲医药-U	142,738	8,535,732.40	0.39
52	688235	百济神州-U	36,400	8,504,496.00	0.39
53	688819	天能股份	303,220	8,417,387.20	0.39
54	688114	华大智造	129,729	8,410,331.07	0.39
55	688361	中科飞测	99,821	8,403,929.99	0.39
56	688582	芯动联科	124,892	8,392,742.40	0.39
57	688520	神州细胞	138,821	8,308,436.85	0.38

58	688385	复旦微电	167,460	8,250,754.20	0.38
59	688629	华丰科技	143,012	8,180,286.40	0.38
60	688180	君实生物-U	238,646	8,109,191.08	0.38
61	688692	达梦数据	35,900	8,001,751.00	0.37
62	688563	航材股份	140,342	7,947,567.46	0.37
63	688019	安集科技	51,781	7,860,355.80	0.36
64	688234	天岳先进	133,892	7,839,376.60	0.36
65	688702	盛科通信-U	127,785	7,805,107.80	0.36
66	688475	萤石网络	244,738	7,714,141.76	0.36
67	688363	华熙生物	149,558	7,679,803.30	0.36
68	688052	纳芯微	43,710	7,626,957.90	0.35
69	688172	燕东微	374,233	7,357,420.78	0.34
70	688322	奥比中光-UW	124,263	7,332,759.63	0.34
71	688778	厦钨新能	130,971	7,323,898.32	0.34
72	688561	奇安信-U	213,591	7,257,822.18	0.34
73	688166	博瑞医药	131,746	7,076,077.66	0.33
74	688017	绿的谐波	56,574	7,065,526.86	0.33
75	688018	乐鑫科技	48,193	7,040,997.30	0.33
76	688347	华虹公司	127,009	6,974,064.19	0.32
77	688425	铁建重工	1,660,406	6,774,456.48	0.31
78	688331	荣昌生物	110,447	6,682,043.50	0.31
79	688037	芯源微	62,236	6,671,699.20	0.31
80	688709	成都华微	198,007	6,482,749.18	0.30
81	688208	道通科技	208,954	6,393,992.40	0.30
82	688088	虹软科技	125,030	6,032,697.50	0.28
83	688387	信科移动-U	1,065,400	6,019,510.00	0.28
84	688200	华峰测控	41,416	5,972,187.20	0.28
85	688382	益方生物-U	180,550	5,925,651.00	0.27
86	688295	中复神鹰	280,054	5,825,123.20	0.27
87	688100	威胜信息	152,651	5,655,719.55	0.26
88	688536	思瑞浦	40,581	5,629,396.32	0.26
89	688248	南网科技	176,029	5,537,872.34	0.26
90	688567	孚能科技	380,250	5,513,625.00	0.26
91	688313	仕佳光子	143,578	5,463,142.90	0.25
92	688343	云天励飞-U	110,277	5,449,889.34	0.25
93	688279	峰昭科技	29,276	5,430,698.00	0.25
94	688301	奕瑞科技	61,897	5,422,796.17	0.25
95	688498	源杰科技	27,219	5,307,705.00	0.25
96	688409	富创精密	95,574	5,257,525.74	0.24
97	688484	南芯科技	132,397	5,236,301.35	0.24
98	688116	天奈科技	113,984	5,217,047.68	0.24
99	688281	华秦科技	84,930	5,139,114.30	0.24
100	688333	铂力特	84,819	5,051,819.64	0.23

101	688772	珠海冠宇	352,745	5,040,726.05	0.23
102	688005	容百科技	223,053	4,978,542.96	0.23
103	688798	艾为电子	72,266	4,928,541.20	0.23
104	688522	纳睿雷达	94,521	4,841,365.62	0.22
105	688502	茂莱光学	16,700	4,803,922.00	0.22
106	688676	金盘科技	142,308	4,760,202.60	0.22
107	688146	中船特气	164,617	4,759,077.47	0.22
108	688433	华曙高科	128,793	4,733,142.75	0.22
109	688141	杰华特	139,239	4,536,406.62	0.21
110	688631	莱斯信息	50,330	4,489,436.00	0.21
111	688327	云从科技-UW	323,450	4,460,375.50	0.21
112	688198	佰仁医疗	42,156	4,328,999.64	0.20
113	688147	微导纳米	143,368	4,326,846.24	0.20
114	688432	有研硅	387,313	4,275,935.52	0.20
115	688110	东芯股份	137,915	4,228,473.90	0.20
116	688552	航天南湖	104,426	4,167,641.66	0.19
117	688153	唯捷创芯	134,072	4,157,572.72	0.19
118	688352	顾中科技	370,016	4,155,279.68	0.19
119	688165	埃夫特-U	162,519	4,147,484.88	0.19
120	688548	广钢气体	411,730	4,125,534.60	0.19
121	688050	爱博医疗	59,800	4,117,230.00	0.19
122	688068	热景生物	29,349	4,112,968.86	0.19
123	688789	宏华数科	55,386	4,045,393.44	0.19
124	688400	凌云光	143,250	3,949,402.50	0.18
125	688123	聚辰股份	48,582	3,934,656.18	0.18
126	688206	概伦电子	135,295	3,934,378.60	0.18
127	688029	南微医学	58,235	3,933,774.25	0.18
128	688543	国科军工	65,293	3,929,985.67	0.18
129	688032	禾迈股份	39,339	3,928,392.54	0.18
130	688332	中科蓝讯	38,050	3,922,194.00	0.18
131	688097	博众精工	139,061	3,881,192.51	0.18
132	688055	龙腾光电	1,039,680	3,846,816.00	0.18
133	688362	甬矽电子	127,000	3,782,060.00	0.17
134	688306	均普智能	382,800	3,766,752.00	0.17
135	688584	上海合晶	207,353	3,707,471.64	0.17
136	688686	奥普特	38,729	3,703,266.98	0.17
137	688289	圣湘生物	180,544	3,697,541.12	0.17
138	688700	东威科技	93,200	3,676,740.00	0.17
139	688076	诺泰生物	98,455	3,664,495.10	0.17
140	688006	杭可科技	187,312	3,652,584.00	0.17
141	688776	国光电气	34,400	3,628,512.00	0.17
142	688439	振华风光	62,077	3,615,985.25	0.17
143	688660	电气风电	415,316	3,604,942.88	0.17

144	688591	泰凌微	74,757	3,580,860.30	0.17
145	688549	中巨芯-U	460,107	3,561,228.18	0.16
146	688107	安路科技	124,643	3,519,918.32	0.16
147	688190	云路股份	38,024	3,519,501.44	0.16
148	688612	威迈斯	131,618	3,519,465.32	0.16
149	688001	华兴源创	139,156	3,516,472.12	0.16
150	688062	迈威生物-U	123,929	3,504,712.12	0.16
151	688300	联瑞新材	75,095	3,495,672.25	0.16
152	688016	心脉医疗	39,000	3,448,380.00	0.16
153	688063	派能科技	76,317	3,440,370.36	0.16
154	688182	灿勤科技	124,255	3,424,467.80	0.16
155	688739	成大生物	129,684	3,423,657.60	0.16
156	688326	经纬恒润-W	37,969	3,388,353.56	0.16
157	688380	中微半导	124,563	3,375,657.30	0.16
158	688083	中望软件	52,115	3,356,727.15	0.16
159	688161	威高骨科	124,308	3,330,211.32	0.15
160	688519	南亚新材	74,117	3,320,441.60	0.15
161	688516	奥特维	98,317	3,268,057.08	0.15
162	688390	固德威	75,174	3,266,310.30	0.15
163	688779	五矿新能	599,625	3,261,960.00	0.15
164	688177	百奥泰	128,825	3,228,354.50	0.15
165	688127	蓝特光学	125,397	3,223,956.87	0.15
166	688158	优刻得-W	141,988	3,211,768.56	0.15
167	688630	芯碁微装	40,411	3,207,421.07	0.15
168	688131	皓元医药	65,615	3,172,485.25	0.15
169	688443	智翔金泰-U	114,241	3,169,045.34	0.15
170	688408	中信博	67,728	3,161,543.04	0.15
171	688800	瑞可达	63,794	3,138,664.80	0.15
172	688048	长光华芯	54,255	3,132,683.70	0.14
173	688503	聚和材料	75,304	3,116,832.56	0.14
174	688252	天德钰	127,651	3,112,131.38	0.14
175	688596	正帆科技	91,294	3,096,692.48	0.14
176	688150	莱特光电	125,252	3,096,229.44	0.14
177	688270	臻镭科技	66,486	3,095,588.16	0.14
178	688698	伟创电气	65,574	3,095,092.80	0.14
179	688128	中国电研	126,022	3,087,539.00	0.14
180	688366	昊海生科	60,077	3,078,345.48	0.14
181	688139	海尔生物	99,580	3,076,026.20	0.14
182	688232	新点软件	102,279	3,072,461.16	0.14
183	688102	斯瑞新材	225,650	3,041,762.00	0.14
184	688151	华强科技	107,322	3,025,407.18	0.14
185	688205	德科立	48,195	3,021,344.55	0.14
186	688321	微芯生物	126,713	3,013,235.14	0.14

187	688091	上海谊众	64,237	3,005,006.86	0.14
188	688652	京仪装备	51,864	2,972,844.48	0.14
189	688690	纳微科技	125,956	2,875,575.48	0.13
190	688351	微电生理	145,956	2,875,333.20	0.13
191	688766	普冉股份	45,220	2,857,904.00	0.13
192	688105	诺唯赞	123,633	2,797,814.79	0.13
193	688570	天玛智控	135,477	2,774,568.96	0.13
194	688262	国芯科技	103,924	2,771,653.08	0.13
195	688586	江航装备	245,848	2,765,790.00	0.13
196	688003	天准科技	60,087	2,757,993.30	0.13
197	688372	伟测科技	45,598	2,754,119.20	0.13
198	688523	航天环宇	126,968	2,731,081.68	0.13
199	688486	龙迅股份	40,714	2,722,952.32	0.13
200	688403	汇成股份	262,050	2,722,699.50	0.13
201	688049	炬芯科技	44,978	2,721,169.00	0.13
202	688656	浩欧博	20,023	2,719,123.40	0.13
203	688276	百克生物	128,500	2,698,500.00	0.12
204	688106	金宏气体	149,270	2,670,440.30	0.12
205	688388	嘉元科技	132,835	2,667,326.80	0.12
206	688658	悦康药业	139,868	2,663,086.72	0.12
207	688138	清溢光电	97,868	2,661,030.92	0.12
208	688668	鼎通科技	42,378	2,646,929.88	0.12
209	688717	艾罗能源	49,137	2,645,044.71	0.12
210	688627	精智达	29,840	2,626,218.40	0.12
211	688575	亚辉龙	177,680	2,592,351.20	0.12
212	688531	日联科技	36,171	2,589,843.60	0.12
213	688093	世华科技	82,050	2,547,652.50	0.12
214	688225	亚信安全	124,166	2,531,744.74	0.12
215	688696	极米科技	22,050	2,521,638.00	0.12
216	688559	海目星	76,580	2,519,482.00	0.12
217	688392	骄成超声	36,789	2,506,434.57	0.12
218	688685	迈信林	44,468	2,483,537.80	0.11
219	688209	英集芯	134,156	2,477,861.32	0.11
220	688639	华恒生物	77,851	2,467,876.70	0.11
221	688368	晶丰明源	27,710	2,433,769.30	0.11
222	688136	科兴制药	61,782	2,361,308.04	0.11
223	688691	灿芯股份	38,000	2,350,680.00	0.11
224	688593	新相微	143,093	2,336,708.69	0.11
225	688562	航天软件	124,363	2,330,562.62	0.11
226	688167	炬光科技	28,629	2,311,791.75	0.11
227	688515	裕太微-U	25,200	2,308,320.00	0.11
228	688550	瑞联新材	53,140	2,285,551.40	0.11
229	688160	步科股份	26,588	2,278,591.60	0.11

230	688305	科德数控	40,569	2,264,155.89	0.10
231	688526	科前生物	145,084	2,260,408.72	0.10
232	688513	苑东生物	54,780	2,249,266.80	0.10
233	688508	芯朋微	40,212	2,244,633.84	0.10
234	688311	盟升电子	51,820	2,230,851.00	0.10
235	688788	科思科技	48,269	2,204,445.23	0.10
236	688535	华海诚科	25,563	2,198,162.37	0.10
237	688320	禾川科技	46,266	2,187,919.14	0.10
238	688626	翔宇医疗	49,357	2,172,695.14	0.10
239	688499	利元亨	52,069	2,166,591.09	0.10
240	688185	康希诺	36,231	2,160,454.53	0.10
241	688553	汇宇制药-W	132,230	2,154,026.70	0.10
242	688518	联赢激光	105,627	2,153,734.53	0.10
243	688025	杰普特	30,000	2,145,000.00	0.10
244	688337	普源精电	60,117	2,144,373.39	0.10
245	688707	振华新材	157,966	2,140,439.30	0.10
246	688084	晶品特装	23,949	2,107,512.00	0.10
247	688159	有方科技	29,150	2,089,180.50	0.10
248	688401	路维光电	60,150	2,087,205.00	0.10
249	688239	航宇科技	59,460	2,079,910.80	0.10
250	688507	索辰科技	28,100	2,060,573.00	0.10
251	688348	昱能科技	47,900	2,058,263.00	0.10
252	688230	芯导科技	37,110	2,057,007.30	0.10
253	688007	光峰科技	142,042	2,053,927.32	0.10
254	688155	先惠技术	39,408	2,034,240.96	0.09
255	688787	海天瑞声	19,151	2,033,453.18	0.09
256	688365	光云科技	133,221	2,027,623.62	0.09
257	688212	澳华内镜	41,195	2,018,555.00	0.09
258	688428	诺诚健华-U	82,426	2,013,667.18	0.09
259	688222	成都先导	124,512	2,002,152.96	0.09
260	688319	欧林生物	126,863	1,986,674.58	0.09
261	688648	中邮科技	41,733	1,968,545.61	0.09
262	688095	福昕软件	28,929	1,964,568.39	0.09
263	688277	天智航-U	140,712	1,955,896.80	0.09
264	688510	航亚科技	80,176	1,938,655.68	0.09
265	688268	华特气体	38,256	1,926,954.72	0.09
266	688505	复旦张江	222,321	1,925,299.86	0.09
267	688046	药康生物	127,481	1,917,314.24	0.09
268	688186	广大特材	66,391	1,899,446.51	0.09
269	688697	纽威数控	141,532	1,888,036.88	0.09
270	688219	会通股份	148,893	1,868,607.15	0.09
271	688661	和林微纳	46,917	1,865,889.09	0.09
272	688258	卓易信息	38,147	1,847,459.21	0.09

273	688023	安恒信息	32,312	1,833,382.88	0.08
274	688103	国力股份	30,088	1,830,553.92	0.08
275	688196	卓越新能	38,078	1,830,409.46	0.08
276	688488	艾迪药业	131,712	1,824,211.20	0.08
277	688315	诺禾致源	129,149	1,823,583.88	0.08
278	688588	凌志软件	124,624	1,815,771.68	0.08
279	688195	腾景科技	40,309	1,813,905.00	0.08
280	688112	鼎阳科技	49,035	1,812,823.95	0.08
281	688429	时创能源	123,836	1,800,575.44	0.08
282	688031	星环科技-U	38,450	1,792,923.50	0.08
283	688299	长阳科技	89,800	1,775,346.00	0.08
284	688621	阳光诺和	35,572	1,774,687.08	0.08
285	688625	呈和科技	57,988	1,773,273.04	0.08
286	688035	德邦科技	43,360	1,761,283.20	0.08
287	688173	希荻微	128,138	1,750,365.08	0.08
288	688603	天承科技	39,599	1,750,275.80	0.08
289	688622	禾信仪器	22,124	1,740,495.08	0.08
290	688636	智明达	51,488	1,739,779.52	0.08
291	688371	菲沃泰	104,332	1,727,737.92	0.08
292	688168	安博通	24,349	1,725,613.63	0.08
293	688389	普门科技	133,524	1,725,130.08	0.08
294	688556	高测股份	238,659	1,713,571.62	0.08
295	688334	西高院	99,359	1,706,987.62	0.08
296	688191	智洋创新	71,686	1,704,693.08	0.08
297	688298	东方生物	62,249	1,702,510.15	0.08
298	688590	新致软件	82,172	1,687,812.88	0.08
299	688606	奥泰生物	25,062	1,684,166.40	0.08
300	688566	吉贝尔	61,905	1,683,196.95	0.08
301	688290	景业智能	32,290	1,682,954.80	0.08
302	688073	毕得医药	28,903	1,676,952.06	0.08
303	688085	三友医疗	86,734	1,667,894.82	0.08
304	688581	安杰思	25,709	1,666,714.47	0.08
305	688381	帝奥微	76,803	1,663,552.98	0.08
306	688458	美芯晟	35,274	1,663,521.84	0.08
307	688236	春立医疗	89,301	1,660,105.59	0.08
308	688233	神工股份	52,138	1,656,424.26	0.08
309	688577	浙海德曼	35,241	1,652,450.49	0.08
310	688197	首药控股-U	45,582	1,650,068.40	0.08
311	688799	华纳药厂	39,923	1,648,819.90	0.08
312	688767	博拓生物	45,872	1,642,217.60	0.08
313	688383	新益昌	32,250	1,640,235.00	0.08
314	688609	九联科技	156,000	1,633,320.00	0.08
315	688595	芯海科技	43,664	1,632,596.96	0.08

316	688117	圣诺生物	48,490	1,631,688.50	0.08
317	688601	力芯微	40,818	1,630,679.10	0.08
318	688293	奥浦迈	36,055	1,622,835.55	0.08
319	688353	华盛锂电	49,048	1,622,507.84	0.08
320	688598	金博股份	63,524	1,614,780.08	0.07
321	688653	康希通信	131,504	1,610,924.00	0.07
322	688275	万润新能	39,720	1,610,646.00	0.07
323	688359	三孚新科	30,530	1,610,152.20	0.07
324	688261	东微半导	38,850	1,602,562.50	0.07
325	688176	亚虹医药-U	178,757	1,585,574.59	0.07
326	688066	航天宏图	80,894	1,583,904.52	0.07
327	688418	震有科技	59,691	1,579,423.86	0.07
328	688267	中触媒	54,243	1,561,113.54	0.07
329	688386	泛亚微透	28,693	1,558,316.83	0.07
330	688512	慧智微-U	142,800	1,557,948.00	0.07
331	688719	爱科赛博	36,600	1,555,500.00	0.07
332	688376	美埃科技	41,379	1,542,195.33	0.07
333	688075	安旭生物	40,084	1,538,023.08	0.07
334	688010	福光股份	49,431	1,534,338.24	0.07
335	688539	高华科技	57,573	1,531,441.80	0.07
336	688620	安凯微	122,391	1,531,111.41	0.07
337	688360	德马科技	82,503	1,530,430.65	0.07
338	688611	杭州柯林	46,902	1,530,412.26	0.07
339	688678	福立旺	80,322	1,529,330.88	0.07
340	688226	威腾电气	57,795	1,510,761.30	0.07
341	688152	麒麟信安	32,169	1,507,439.34	0.07
342	688143	长盈通	38,550	1,503,450.00	0.07
343	688489	三未信安	36,592	1,488,562.56	0.07
344	688722	同益中	69,983	1,488,538.41	0.07
345	688202	美迪西	41,275	1,483,010.75	0.07
346	688677	海泰新光	38,006	1,482,614.06	0.07
347	688087	英科再生	57,518	1,478,212.60	0.07
348	688302	海创药业-U	31,300	1,464,840.00	0.07
349	688247	宣泰医药	140,700	1,453,431.00	0.07
350	688119	中钢洛耐	347,351	1,451,927.18	0.07
351	688108	赛诺医疗	128,950	1,446,819.00	0.07
352	688377	迪威尔	60,572	1,445,853.64	0.07
353	688459	哈铁科技	150,020	1,440,192.00	0.07
354	688101	三达膜	103,235	1,439,095.90	0.07
355	688665	四方光电	31,937	1,428,222.64	0.07
356	688410	山外山	100,400	1,425,680.00	0.07
357	688580	伟思医疗	30,450	1,415,620.50	0.07
358	688157	松井股份	35,250	1,405,770.00	0.07

359	688687	凯因科技	52,766	1,403,047.94	0.06
360	688579	山大地纬	125,350	1,402,666.50	0.06
361	688259	创耀科技	35,341	1,401,270.65	0.06
362	688231	隆达股份	77,200	1,393,460.00	0.06
363	688356	键凯科技	19,337	1,365,192.20	0.06
364	688716	中研股份	38,291	1,363,159.60	0.06
365	688533	上声电子	50,362	1,356,248.66	0.06
366	688602	康鹏科技	161,630	1,354,459.40	0.06
367	688399	硕世生物	26,780	1,352,390.00	0.06
368	688070	纵横股份	27,935	1,349,260.50	0.06
369	688569	铁科轨道	64,893	1,336,795.80	0.06
370	688269	凯立新材	40,183	1,334,075.60	0.06
371	688090	瑞松科技	38,727	1,331,821.53	0.06
372	688280	精进电动-UW	182,726	1,328,418.02	0.06
373	688282	理工导航	27,800	1,324,392.00	0.06
374	688496	清越科技	141,391	1,314,936.30	0.06
375	688325	赛微微电	27,250	1,308,000.00	0.06
376	688179	阿拉丁	102,600	1,305,072.00	0.06
377	688089	嘉必优	51,614	1,298,092.10	0.06
378	688478	晶升股份	42,404	1,297,562.40	0.06
379	688378	奥来德	76,913	1,295,984.05	0.06
380	688339	亿华通-U	60,623	1,294,301.05	0.06
381	688059	华锐精密	27,520	1,286,835.20	0.06
382	688253	英诺特	41,629	1,284,670.94	0.06
383	688135	利扬芯片	61,932	1,282,611.72	0.06
384	688181	八亿时空	41,131	1,279,996.72	0.06
385	688228	开普云	21,548	1,279,520.24	0.06
386	688373	盟科药业-U	203,522	1,276,082.94	0.06
387	688201	信安世纪	98,279	1,272,713.05	0.06
388	688079	美迪凯	126,268	1,267,730.72	0.06
389	688211	中科微至	39,950	1,264,417.50	0.06
390	688286	敏芯股份	17,730	1,253,333.70	0.06
391	688238	和元生物	202,098	1,253,007.60	0.06
392	688246	嘉和美康	41,945	1,232,763.55	0.06
393	688768	容知日新	27,645	1,227,161.55	0.06
394	688015	交控科技	58,610	1,221,432.40	0.06
395	688244	永信至诚	46,182	1,215,510.24	0.06
396	688207	格灵深瞳	80,200	1,211,020.00	0.06
397	688633	星球石墨	44,382	1,208,521.86	0.06
398	688683	莱尔科技	47,553	1,199,286.66	0.06
399	688080	映翰通	23,549	1,198,408.61	0.06
400	688628	优利德	35,542	1,192,434.10	0.06
401	688720	艾森股份	27,745	1,187,208.55	0.05

402	688456	有研粉材	33,000	1,186,350.00	0.05
403	688061	灿瑞科技	36,131	1,185,096.80	0.05
404	688623	二元科技	18,820	1,181,331.40	0.05
405	688221	前沿生物-U	117,200	1,176,688.00	0.05
406	688039	当虹科技	35,688	1,171,280.16	0.05
407	688133	泰坦科技	50,838	1,170,290.76	0.05
408	688663	新风光	43,269	1,166,099.55	0.05
409	688680	海优新材	26,357	1,164,979.40	0.05
410	688199	久日新材	49,357	1,164,825.20	0.05
411	688733	壹石通	61,485	1,164,525.90	0.05
412	688255	凯尔达	34,494	1,162,102.86	0.05
413	688711	宏微科技	65,819	1,157,756.21	0.05
414	688077	大地熊	36,150	1,154,992.50	0.05
415	688257	新锐股份	77,976	1,142,348.40	0.05
416	688162	巨一科技	41,781	1,138,114.44	0.05
417	688210	统联精密	49,566	1,130,104.80	0.05
418	688699	明微电子	34,827	1,127,698.26	0.05
419	688033	天宜新材	175,400	1,124,314.00	0.05
420	688227	品高股份	35,531	1,117,094.64	0.05
421	688330	宏力达	43,181	1,108,888.08	0.05
422	688391	钜泉科技	36,761	1,091,434.09	0.05
423	688312	燕麦科技	45,153	1,085,026.59	0.05
424	688501	青达环保	38,925	1,084,061.25	0.05
425	688115	思林杰	21,000	1,079,400.00	0.05
426	688317	之江生物	59,378	1,069,991.56	0.05
427	688573	信宇人	30,856	1,067,617.60	0.05
428	688398	赛特新材	51,313	1,062,692.23	0.05
429	688283	坤恒顺维	38,650	1,060,942.50	0.05
430	688057	金达莱	86,723	1,058,020.60	0.05
431	688416	恒烁股份	26,150	1,052,799.00	0.05
432	688358	祥生医疗	35,390	1,049,313.50	0.05
433	688129	东来技术	38,329	1,042,548.80	0.05
434	688509	正元地信	241,963	1,038,021.27	0.05
435	688500	慧辰股份	23,384	1,021,880.80	0.05
436	688786	悦安新材	43,750	1,019,375.00	0.05
437	688028	沃尔德	46,854	1,016,731.80	0.05
438	688571	杭华股份	131,351	1,012,716.21	0.05
439	688558	国盛智科	40,091	1,011,896.84	0.05
440	688662	富信科技	27,650	1,007,842.50	0.05
441	688682	霍莱沃	32,115	1,005,199.50	0.05
442	688379	华光新材	28,795	998,034.70	0.05
443	688053	思科瑞	31,800	983,574.00	0.05
444	688585	上纬新材	126,292	982,551.76	0.05

445	688020	方邦股份	25,900	980,833.00	0.05
446	688291	金橙子	32,250	977,497.50	0.05
447	688557	兰剑智能	32,555	974,371.15	0.05
448	688071	华依科技	26,605	969,752.25	0.04
449	688480	赛恩斯	30,100	967,715.00	0.04
450	688419	耐科装备	25,950	967,416.00	0.04
451	688600	皖仪科技	41,102	965,897.00	0.04
452	688316	青云科技-U	15,199	963,160.63	0.04
453	688369	致远互联	36,350	959,276.50	0.04
454	688132	邦彦技术	47,206	958,281.80	0.04
455	688285	高铁电气	116,771	957,522.20	0.04
456	688273	麦澜德	31,500	951,615.00	0.04
457	688125	安达智能	25,868	949,355.60	0.04
458	688560	明冠新材	62,398	946,577.66	0.04
459	688589	力合微	44,208	945,609.12	0.04
460	688689	银河微电	40,914	943,885.98	0.04
461	688529	豪森智能	52,262	937,580.28	0.04
462	688292	浩瀚深度	48,585	934,775.40	0.04
463	688576	西山科技	14,524	923,726.40	0.04
464	688288	鸿泉物联	31,600	916,716.00	0.04
465	688793	倍轻松	27,407	912,379.03	0.04
466	688468	科美诊断	123,514	909,063.04	0.04
467	688592	司南导航	19,589	906,774.81	0.04
468	688308	欧科亿	49,018	904,382.10	0.04
469	688357	建龙微纳	31,302	901,184.58	0.04
470	688030	山石网科	56,076	896,655.24	0.04
471	688657	浩辰软件	21,002	891,954.94	0.04
472	688345	博力威	32,336	890,856.80	0.04
473	688435	英方软件	26,698	879,432.12	0.04
474	688121	卓然股份	71,864	868,117.12	0.04
475	688667	菱电电控	16,300	867,323.00	0.04
476	688655	迅捷兴	40,823	865,039.37	0.04
477	688610	埃科光电	21,636	858,083.76	0.04
478	688393	安必平	29,850	857,889.00	0.04
479	688148	芳源股份	158,569	857,858.29	0.04
480	688338	赛科希德	33,928	854,307.04	0.04
481	688137	近岸蛋白	22,299	854,051.70	0.04
482	688130	晶华微	38,590	852,839.00	0.04
483	688618	三旺通信	34,806	849,266.40	0.04
484	688237	超卓航科	28,497	832,967.31	0.04
485	688479	友车科技	43,995	831,505.50	0.04
486	688011	新光光电	31,784	831,151.60	0.04
487	688170	德龙激光	32,899	829,054.80	0.04

488	688171	纬德信息	26,864	826,336.64	0.04
489	688218	江苏北人	37,950	823,515.00	0.04
490	688597	煜邦电力	104,702	819,816.66	0.04
491	688175	高凌信息	40,320	819,705.60	0.04
492	688737	中自科技	38,050	818,075.00	0.04
493	688022	瀚川智能	55,028	815,514.96	0.04
494	688651	盛邦安全	23,827	813,215.51	0.04
495	688323	瑞华泰	55,965	812,052.15	0.04
496	688370	从麟科技	42,195	806,346.45	0.04
497	688203	海正生材	63,364	802,188.24	0.04
498	688530	欧莱新材	48,700	802,089.00	0.04
499	688613	奥精医疗	41,859	800,344.08	0.04
500	688695	中创股份	26,800	795,960.00	0.04
501	688314	康拓医疗	25,721	794,264.48	0.04
502	688307	中润光学	27,850	792,054.00	0.04
503	688265	南模生物	24,579	791,689.59	0.04
504	688426	康为世纪	35,669	790,781.73	0.04
505	688551	科威尔	26,520	779,422.80	0.04
506	688455	科捷智能	55,208	776,776.56	0.04
507	688216	气派科技	33,866	776,547.38	0.04
508	688096	京源环保	50,988	776,037.36	0.04
509	688109	品茗科技	24,800	772,024.00	0.04
510	688098	申联生物	126,253	771,405.83	0.04
511	688619	罗普特	57,470	764,351.00	0.04
512	688310	迈得医疗	51,793	763,428.82	0.04
513	688045	必易微	22,150	761,960.00	0.04
514	688693	锴威特	23,050	760,880.50	0.04
515	688013	天臣医疗	26,000	759,980.00	0.04
516	688078	龙软科技	23,238	736,644.60	0.03
517	688113	联测科技	20,229	732,087.51	0.03
518	688669	聚石化学	38,386	724,343.82	0.03
519	688058	宝兰德	24,950	715,316.50	0.03
520	688616	西力科技	56,164	714,406.08	0.03
521	688060	云涌科技	19,318	706,845.62	0.03
522	688026	洁特生物	43,088	706,643.20	0.03
523	688229	博睿数据	13,850	705,657.50	0.03
524	688056	莱伯泰科	21,071	703,349.98	0.03
525	688466	金科环境	39,609	700,287.12	0.03
526	688069	德林海	35,881	697,885.45	0.03
527	688355	明志科技	39,600	695,772.00	0.03
528	688638	誉辰智能	17,549	681,954.14	0.03
529	688328	深科达	30,000	679,500.00	0.03
530	688081	兴图新科	32,524	676,824.44	0.03

531	688718	唯赛勃	54,458	674,190.04	0.03
532	688420	美腾科技	28,136	670,762.24	0.03
533	688163	赛伦生物	34,450	670,052.50	0.03
534	688448	磁谷科技	22,500	659,025.00	0.03
535	688272	富吉瑞	24,200	654,610.00	0.03
536	688118	普元信息	29,049	649,245.15	0.03
537	688260	昀冢科技	38,650	636,952.00	0.03
538	688189	南新制药	85,472	635,911.68	0.03
539	688215	瑞晟智能	16,600	631,132.00	0.03
540	688350	富淼科技	39,347	627,191.18	0.03
541	688395	正弦电气	27,650	627,102.00	0.03
542	688178	万德斯	26,677	614,104.54	0.03
543	688051	佳华科技	24,299	604,802.11	0.03
544	688517	金冠电气	42,031	604,405.78	0.03
545	688679	通源环境	40,328	603,710.16	0.03
546	688251	井松智能	27,850	600,446.00	0.03
547	688092	爱科科技	26,350	587,605.00	0.03
548	688038	中科通达	36,887	585,396.69	0.03
549	688335	复洁环保	45,661	557,064.20	0.03
550	688670	金迪克	39,626	552,782.70	0.03
551	688450	光格科技	20,664	545,942.88	0.03
552	688156	路德环境	32,154	543,724.14	0.03
553	688528	秦川物联	51,338	531,861.68	0.02
554	688193	仁度生物	12,649	531,637.47	0.02
555	688671	碧兴物联	24,550	524,142.50	0.02
556	688607	康众医疗	27,480	515,250.00	0.02
557	688004	博汇科技	25,049	498,475.10	0.02
558	688367	工大高科	28,148	496,812.20	0.02
559	688485	九州一轨	45,560	496,148.40	0.02
560	688329	艾隆科技	24,550	472,342.00	0.02
561	688067	爱威科技	21,761	468,079.11	0.02
562	688309	恒誉环保	25,899	463,851.09	0.02
563	688681	科汇股份	32,550	455,700.00	0.02
564	688296	和达科技	34,350	451,015.50	0.02
565	688217	睿昂基因	17,328	438,398.40	0.02
566	688565	力源科技	47,221	436,794.25	0.02
567	688659	元琛科技	49,150	429,079.50	0.02
568	688021	奥福科技	24,200	370,018.00	0.02
569	688701	卓锦股份	40,565	334,255.60	0.02

### 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

注：无。

## 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末基金资产净值 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	95,059,603.73	4.40
2	688256	寒武纪-U	78,631,076.47	3.64
3	688981	中芯国际	51,855,414.60	2.40
4	688111	金山办公	44,156,883.84	2.04
5	688012	中微公司	33,679,382.35	1.56
6	688271	联影医疗	29,368,155.15	1.36
7	688036	传音控股	28,184,778.77	1.30
8	688008	澜起科技	23,747,170.86	1.10
9	688506	百利天恒	23,378,625.25	1.08
10	688608	恒玄科技	17,935,032.01	0.83
11	688223	晶科能源	17,794,608.09	0.82
12	688396	华润微	16,583,650.27	0.77
13	688617	惠泰医疗	15,665,577.63	0.72
14	688047	龙芯中科	14,110,215.18	0.65
15	688169	石头科技	13,504,167.65	0.62
16	688009	中国通号	13,070,272.51	0.60
17	688072	拓荆科技	12,847,916.02	0.59
18	688082	盛美上海	12,444,869.35	0.58
19	688249	晶合集成	12,429,331.51	0.57
20	688126	沪硅产业	12,188,455.44	0.56

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末基金资产净值 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	688041	海光信息	6,959,850.76	0.32
2	688111	金山办公	5,489,421.51	0.25
3	688608	恒玄科技	4,265,067.50	0.20
4	688200	华峰测控	3,785,115.29	0.18
5	688169	石头科技	3,346,867.41	0.15
6	688617	惠泰医疗	3,158,735.89	0.15
7	688052	纳芯微	3,073,859.89	0.14
8	688301	奕瑞科技	2,877,459.93	0.13
9	688536	思瑞浦	2,862,832.08	0.13
10	688012	中微公司	2,847,865.95	0.13
11	688198	佰仁医疗	2,777,843.73	0.13
12	688027	国盾量子	2,544,687.01	0.12

13	688235	百济神州-U	2,501,141.78	0.12
14	688318	财富趋势	2,415,209.83	0.11
15	688017	绿的谐波	2,383,040.48	0.11
16	688188	柏楚电子	2,331,790.79	0.11
17	688019	安集科技	2,325,306.07	0.11
18	688256	寒武纪-U	2,289,929.62	0.11
19	688521	芯原股份	2,033,643.52	0.09
20	688279	峰昭科技	1,951,973.01	0.09

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	2,039,861,150.60
卖出股票收入（成交）总额	270,810,397.07

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

深圳传音控股股份有限公司在报告编制日前一年内受到广东省深圳市住房和建设局的处罚。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	418,775.57
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	81,877.50
8	其他	-
9	合计	500,653.07

### 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

注：无。

## 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（%）
7,295	302,939.50	1,649,270,366.00	74.63	560,673,300.00	25.37

## 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	299,976,500.00	13.57

## 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	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	467,598,200.00	21.16
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-分红资本-自主（建行）	204,299,400.00	9.24
3	中国人寿保险股份有限公司	159,420,700.00	7.21
4	中国平安人寿保险股份有限公司-寿险传统-自主	98,231,800.00	4.44
5	新华人寿保险股份有限公司	61,000,100.00	2.76
6	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	49,198,900.00	2.23

7	中国银河证券股份有限公司	46,792,000.00	2.12
8	方正证券股份有限公司	32,443,898.00	1.47
9	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	29,945,400.00	1.36
10	和泰人寿保险股份有限公司—传统保险产品	26,000,000.00	1.18
-	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	299,976,500.00	13.57

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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。

### 8.4 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

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
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	2,300,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末 基金总赎回份额	1,820,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,209,943,666.00

## § 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：

无。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

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

本基金管理人聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所。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

注：无。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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 (%)	
国信证券	3	2,310,671,547.67	100.00	452,915.84	100.00	本报告期新增

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。

4. 国泰海通会商并获得上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国结算、各签约存管银行及基金管理公司等相关单位的协同支持，拟定于 2025 年 9 月 12 日的日终清算后，于上述单位实施法人切换、客户及业务迁移合并，将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。截止本报告期末，原租用海通证券、国泰君安的交易单元未完成迁移合并，故本表列示的海通证券、国泰君安数据包含本基金在本报告期内通过原交易单元交易的情况。

### 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基金产品资料概要	《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	2025 年 02 月 13 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份额发售公告	《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	2025 年 02 月 13 日
3	鹏华上证科创板综合交易型开放式	《证券日报》、基金管	2025 年 02 月 13 日

	指数证券投资基金基金合同	理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	
4	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	《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	2025 年 02 月 13 日
5	鹏华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	《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	2025 年 02 月 13 日
6	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生效公告	《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	2025 年 02 月 27 日
7	鹏华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	《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	2025 年 02 月 28 日
8	鹏华上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	《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	2025 年 02 月 28 日
9	鹏华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	《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	2025 年 03 月 05 日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部证券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	2025 年 03 月 05 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	20250417~20250515	0.00	1,340,143,200.00	1,040,166,700.00	299,976,500.00	13.57
	2	20250610~20250630	0.00	551,986,400.00	84,388,200.00	467,598,200.00	21.16
产品特有风险							
<p>基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，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。</p>							

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 2025 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：4006788999。

鹏华基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日