

中海科技创新主题混合型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：长沙银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人长沙银行股份有限公司(以下简称“长沙银行”)根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45

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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海科技创新主题混合型证券投资基金	
基金简称	中海科技创新混合	
基金主代码	022995	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 7 月 21 日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
基金托管人	长沙银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	45,282,456.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中海科技创新混合 A	中海科技创新混合 C
下属分级基金的交 易代码	022995	022996
报告期末下属分级 基金的份额总额	8,967,390.79 份	36,315,065.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选科技创新主题相关优质上市公司进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）大类资产配置 本基金基于对国内外宏观经济走势、财政货币政策分析、不同行业发展趋势等分析判断，采取自上而下的分析方法，比较不同证券子市场和金融产品的收益及风险特征，动态确定本基金在股票、债券等各大类资产之间的投资比例。 （二）股票投资策略 本基金所定义的“科技创新”主题相关上市公司是指符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高，属于新一代信息技术产业、高端装备制造产业、生物产业、新材料产业、节能环保产业、新能源汽车产业、新能源产业等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业。本基金参照 2018 年 11 月国家统计局发布的《战略性新兴产业分类》，将“科技创新”的领域进一步细分为若干重点产业。本基金将根据科技创新主题范畴初步选出备选股票池，之后在此基础上通过自上而下和自下而上相结合的方法挖掘出优质上市公司，精选个股构成投资组合。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。A 股市场和港股市场互联互通机制的开通将为港股带来长期的价值重估机遇，在选择具体投资标的时，本基金将参考前述科技创新类股票的投资策略，优先将香港市场中具备优质成长属性且估值合理或被低估的上市公司纳入本基金的股票投资组合。

	（三）债券投资策略 包括：久期配置、期限结构配置、债券类别配置/个券选择、信用债投资策略、可转换债券以及可交换债券投资策略。 （四）资产支持证券投资策略 本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。 （五）衍生品投资策略 本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，根据风险管理原则，以套期保值为目的，参与股指期货投资。本基金将通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，结合对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，与现货组合进行匹配，采用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将在股指期货套期保值过程中，定期测算投资组合与股指期货的相关性，根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金运作效率，降低投资组合的整体风险。 本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。 本基金按照风险管理的原则，以套期保值为目的，在严格控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进行投资。本基金基于对证券市场的判断，选择估值合理的股票期权合约。 （六）同业存单投资策略 本基金根据对存单发行银行的信用资质和存单流动性进行分析，严控信用风险底线的前提下，根据信用资质、流动性、收益率的综合考虑，选择具有良好投资价值的存单品种进行投资。信用资质分析，采用外部评级机构和内部评级相结合的方式，对信用风险进行审慎甄别。 （七）融资业务投资策略 本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资业务。利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+恒生港股通中国科技指数收益率×10%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

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		中海基金管理有限公司	长沙银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄乐军	段昱奇
	联系电话	021-38429808	0731-81633546
	电子邮箱	xxpl@zhfund.com	xxpl@cscb.cn
客户服务电话		400-888-9788、021-38789788	0731-96511
传真		021-68419525	0731-85817550
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	长沙市岳麓区滨江路 53 号楷林商务中心 B 座
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层	长沙市岳麓区滨江路 53 号楷林商务中心 B 座
邮政编码		200120	410205
法定代表人		曾杰	张曼

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zhfund.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

§ 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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
和指标	中海科技创新混合 A	中海科技创新混合 C
本期已实现收益	1,323,653.06	9,866,217.74
本期利润	6,265,646.49	27,963,090.77
加权平均基金份 额本期利润	1.8964	1.5394
本期加权平均净 值利润率	134.90%	115.62%
本期基金份额净	139.68%	138.75%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	6,401,111.60	25,436,409.26
期末可供分配基金份额利润	0.7138	0.7004
期末基金资产净值	21,245,147.95	85,389,474.54
期末基金份额净值	2.3692	2.3514
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	136.92%	135.14%

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

中海科技创新混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	137.70%	2.71%	48.26%	2.07%	89.44%	0.64%
过去六个月	139.68%	2.75%	40.54%	1.81%	99.14%	0.94%
自基金合同生效起至今	136.92%	2.17%	85.29%	1.80%	51.63%	0.37%

中海科技创新混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	137.23%	2.71%	48.26%	2.07%	88.97%	0.64%
过去六个月	138.75%	2.75%	40.54%	1.81%	98.21%	0.94%
自基金合同生效起至今	135.14%	2.17%	85.29%	1.80%	49.85%	0.37%

注：1. “自基金合同生效起至今”指 2025 年 7 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

2. 本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+恒生港股通中国科技指数收益率*10%+1 年期定期存款利率（税后）*10%。

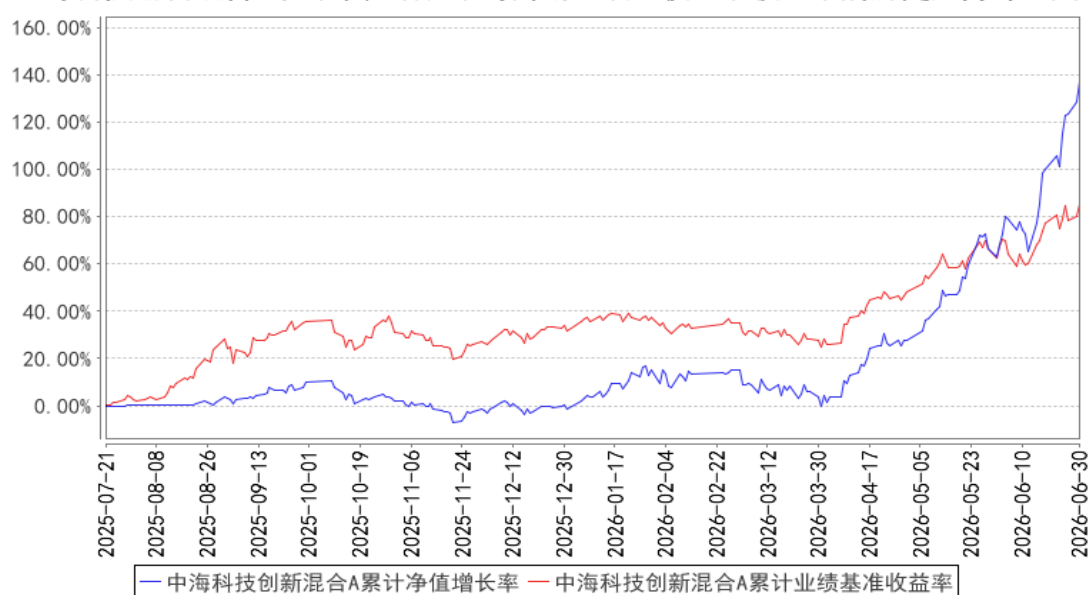
中国战略新兴产业成份指数由中证指数有限公司编制，该指数选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域的公司证券作为指数样本，以反映中国战略新兴产业公司证券的整体表现。

恒生港股通中国科技指数收益率是由恒生指数有限公司编制，选取恒生综合指数成份股中符合港股通资格的内地企业，采用流通市值加权，反映可经港股通买卖，从事科技业务并于香港上市的中国内地公司之表现。

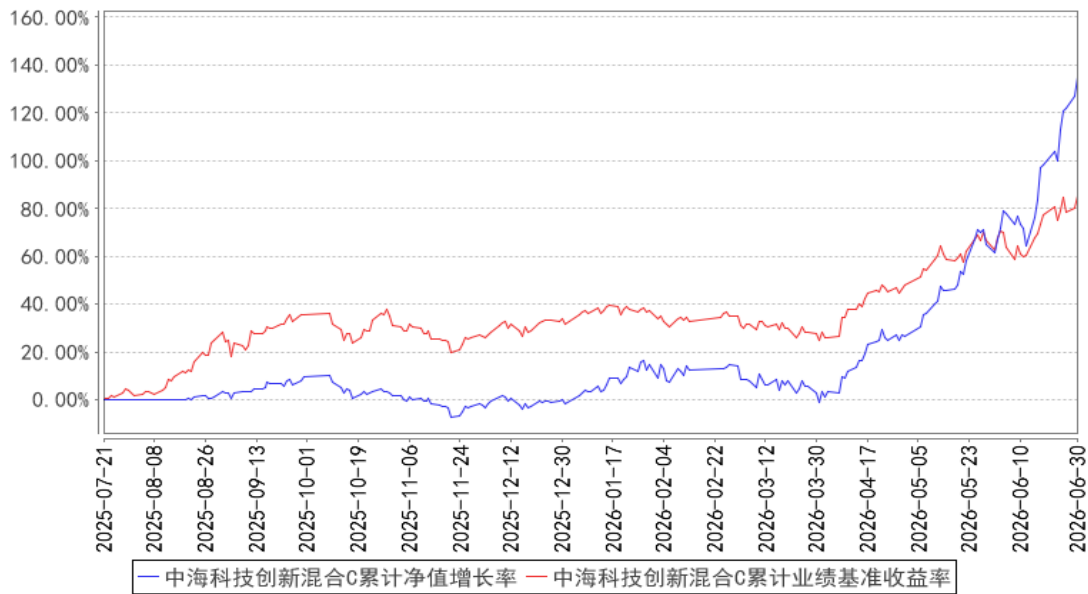
根据本基金的投资范围和投资比例，设定本基金的业绩比较基准为：“中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+恒生港股通中国科技指数收益率*10%+1 年期定期存款利率（税后）*10%”，该基准能客观衡量本基金的投资绩效。

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

中海科技创新混合A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



中海科技创新混合C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. 按相关法规规定，本基金自基金合同 2025 年 7 月 21 日生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

2. 本基金合同生效日 2025 年 7 月 21 日起至披露时点不满一年。

§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2026 年 6 月 30 日，共管理证券投资基金 37 只。

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		
姚晨曦	权益中心副总经理兼权益投资部总经理兼权益投资副总监、本基金基金经理	2025 年 7 月 21 日	—	18 年	姚晨曦先生，复旦大学金融学专业硕士。曾任上海申银万国证券研究所二级分析师。2009 年 5 月进入本公司工作，曾任分析师、分析师兼基金经理助理、权益投资部副总经理，现任权益中心副总经理兼权益投资部总经理兼权益投资副总监、基金经理。2016 年 4 月至 2021 年 7 月任中海沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资

理、中海能源策略混合型证券投资基金基金经理、中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理、中海新兴成长六个月持有期混合型证券投资基金基金经理、中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金基金经理				基金基金经理，2015 年 4 月至 2024 年 9 月任中海消费主题精选混合型证券投资基金基金经理，2015 年 4 月至今任中海能源策略混合型证券投资基金基金经理，2021 年 6 月至今任中海信息产业精选混合型证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任中海新兴成长六个月持有期混合型证券投资基金基金经理，2022 年 9 月至今任中海环保新能源主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月至今任中海积极增利灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 7 月至今任中海科技创新主题混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的行为。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度，公司从研究、投资、交易、风险管理事后分析等环节，对股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动的全程公平交易进行了明确约定。公司通过制定研究、交易等相关制度，要求公司各组合研究成果共享，投资交易指令统一下达至交易室，由交易室通过启用公平交易模块并具体执行相关交易，使公平交易制度中要求的时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡得以落实；同时，根据公司制度，通过系统禁止公司组合之间（除指数组合外）的同日反向交易。对于发生在银行间市场的债券买卖交易及交易所市场的大宗交易，由公司对相关交易价格进行事前审核，风控的事前介入有效防范了可能出现的非公平交易行为。

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，进行了相关的假设检验，对于相关溢价金额对组合收益率的贡献进行了重要性分析，并针对交易占优次数进行了时间序列分析。多维度的公平交易监控指标使公平交易事后分析更全面、有效。

本报告期，公司根据制度要求，对不同组合不同时间段的反向交易进行了统计分析，对于出现的公司制度中规定的异常交易，均要求相关当事人和审批人按照公司制度要求予以留痕。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，对于一级市场证券申购、二级市场证券交易中出现的可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易情况，公司均根据制度规定要求组合经理提供相关情况说明予以留痕。

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

今年上半年，国内经济整体保持相对平稳运行，GDP 增速符合预期目标，但内部结构冷热不均的现象依然明显。一方面，经济呈现明显的外热内冷格局，受益于 AI 基建投资拉动和中东地缘冲突的影响，出口保持了相当高的景气度，而国内投资和消费则受制于信心不足和通缩压力，表现持续低迷。另一方面，伴随经济转型和产业升级，不同行业间的差异也异常显著。上半年，以高端制造、数智经济、现代服务为代表的新动能对经济增长的贡献率超过四成，经济向新向优的特点十分鲜明；与之相对应的是，部分传统行业始终面临持续的调整压力。3 月两会正式通过的“十五五”规划纲要中，进一步强化了“建设现代化产业体系、培育壮大新兴产业和未来产业、科技自立自强”等发展方向。预计宏观经济整体平稳、内部结构持续调整的局面，将在未来相当

长一段时间内维持。

海外方面，美国虽然在年初通过空袭快速完成了委内瑞拉政权更替，但 3 月联合以色列对伊朗发动的攻击却遭遇顽强抵抗，导致霍尔木兹海峡陷入长时间封锁，暴涨的油价继而引发全球供应链和通胀危机。目前美伊双方仍在谈判与军事冲突之间来回摇摆博弈，预计这种僵持局面可能还会维持一段时间。上半年，美联储也完成了主席更替，新任主席凯文·沃什上任即面临通胀和加息压力。不过，相比于下半年模糊不定的加息预期，美联储正在推动的制度性改革更值得关注。

权益市场方面，面对全球经济和政策环境的不确定性，全球资本最终选择在科技产业中寻找发展的确定性。随着 AI 大模型持续迭代以及 AI 智能体（Agent）的兴起，算力需求进一步快速抬升，AI 基础设施建设不断加快。包括存储、GPU、CPU、光模块，以及 PCB、各类被动元器件和电子半导体材料在内的相关产业，均处于极高的景气度中。越来越多的资金开始从其他行业向 AI 相关产业做配置迁移，这也导致上半年国内外资本市场走出了科技板块一枝独秀的极致化结构行情。

上半年，本产品投资组合始终围绕 AI 相关产业链，尤其是算力硬件领域进行投资和配置。前期重点配置海外链相关的光通信和电子板块。进入 5 月，我们重新审视了整个 AI 产业链不同环节的潜在增长空间和相对估值水平，发现半导体领域的先进封装环节因多种原因被市场相对忽视和低估，但产业链中封装的价值量和重要性实际上在大幅提升，华为之后提出的“ π 定律”也验证了我们的判断。因此，后期产品策略和投资组合显著向先进封装领域倾斜，配置了封装设备、封装材料和第三方封测厂等方向，并重点挖掘了玻璃基板这一封装领域重要革新材料的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金 A 类份额净值 2.3692 元（累计净值 2.3692 元）。报告期内本基金 A 类净值增长率为 139.68%，高于业绩比较基准 99.14 个百分点。本基金 C 类份额净值 2.3514 元（累计净值 2.3514 元）。报告期内本基金 C 类净值增长率为 138.75%，高于业绩比较基准 98.21 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为以 AI 为代表的科技板块大概率仍是市场的核心主线和投资机会所在。

近期关于 AI 泡沫是否即将破裂的争议不断，市场层面也出现了一定幅度的调整。我们的判断是，行业基本面目前并未出现拐点信号，短期股价回调更多源于市场交易层面的内生调整需求。毕竟上半年积累了巨大涨幅，交易拥挤度过高，同时海外局部市场交易杠杆过高，这些都容易引发阶段性震荡调整，但这种调整不会改变向上的方向，也不是行情的终结。虽然 AI 产业投资规模不断扩大，大量算力中心陆续投入使用，相关硬件产业链加速扩产，但模型用量和算力需求也在

同步持续提升。尤其上半年 Agent 的爆发带来了 token 使用量快速攀升，龙头模型厂商收入也在快速增长。虽然目前大模型创造的价值主要体现在编程领域，过高的 token 消化和使用成本也持续被客户诟病，但随着模型不断迭代，尤其 Agent 能力和运行框架持续优化发展，叠加硬件算力效率不断提高，我们判断未来一段时间大模型的使用场景和需求仍有希望进一步快速增长。当然，除 Agent 外，世界模型、多模态、递归自我进化等新技术突破也可能带来新的需求增长点。我们认为，只要需求还在持续增长，那么目前算力中心的建设投入和产业链扩产就能持续被吸收消化，行业发展和二级市场股价的拐点就不会出现。

下半年，本产品投资策略仍将重点聚焦于 AI 产业链，尤其是国产算力链的先进封装环节。我们判断，随着国产算力芯片持续放量，配套的先进封装环节将迎来较大发展机遇。

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，公司分管运营副总担任估值委员会主任委员，其他委员有风险管理负责人、合规管理负责人、基金运营负责人、相关基金经理等。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。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，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值委员会会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中证指数有限公司以及中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供证券交易所及银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关约定，本基金本报告期内未发生利润分配。

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

自 2026 年 1 月 5 日至 6 月 8 日期间，本基金曾出现超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，公司已向中国证券监督管理委员会上报相关后续运作方案。

§ 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、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本基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，经托管人复核审查的有关本基金的中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中海科技创新主题混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,310,287.57	1,651,581.11
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	96,957,882.68	20,047,334.78
其中：股票投资		96,957,882.68	20,047,334.78
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		-	1,997,019.10
应收股利		-	-
应收申购款		5,970,031.20	699.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		108,238,201.45	23,696,634.09
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,502,080.08	8,787.89
应付管理人报酬		59,937.09	36,756.26
应付托管费		9,989.53	6,126.04
应付销售服务费		31,557.62	20,688.63
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	14.64	71,866.21
负债合计		1,603,578.96	144,225.03
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	45,282,456.50	23,893,055.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	61,352,165.99	-340,646.48
净资产合计		106,634,622.49	23,552,409.06
负债和净资产总计		108,238,201.45	23,696,634.09

注：1、本基金合同生效日为 2025 年 7 月 21 日，2025 年度实际报告期间为 2025 年 7 月 21 日至 2025 年 12 月 31 日。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，中海科技创新混合 A 基金份额净值 2.3692 元，基金份额总额 8,967,390.79 份；中海科技创新混合 C 基金份额净值 2.3514 元，基金份额总额 36,315,065.71 份。中海科技创新混合基金份额总额合计为 45,282,456.50 份。

6.2 利润表

会计主体：中海科技创新主题混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		34,524,281.96
1. 利息收入		1,276.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,276.76
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）		11,085,469.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,001,554.38
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	83,914.93
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	23,038,866.46
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	398,669.43
减：二、营业总支出		295,544.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	171,125.74
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,521.00
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	95,897.96
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	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		34,228,737.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,228,737.26
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		34,228,737.26
----------	--	---------------

注：本基金合同生效日为 2025 年 7 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：中海科技创新主题混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	23,893,055.54	-	-340,646.48	23,552,409.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	23,893,055.54	-	-340,646.48	23,552,409.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,389,400.96	-	61,692,812.47	83,082,213.43
（一）、综合收益总额	-	-	34,228,737.26	34,228,737.26
（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）	21,389,400.96	-	27,464,075.21	48,853,476.17
其中：1. 基金申购款	74,150,103.85	-	61,865,181.87	136,015,285.72
2. 基金赎回款	-52,760,702.89	-	-34,401,106.66	-87,161,809.55
（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	45,282,456.50	-	61,352,165.99	106,634,622.49

注：本基金合同生效日为 2025 年 7 月 21 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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：

<u>曾杰</u>	<u>李俊</u>	<u>周琳</u>
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

中海科技创新主题混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由中海基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及有关法规规定，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[2024]1506 号《关于准予中海科技创新主题混合型证券投资基金注册的批复》核准募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人和注册登记机构均为中海基金管理有限公司，基金托管人为长沙银行股份有限公司，有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案，基金合同于 2025 年 7 月 21 日生效，该日的基金份额总额为 211,589,317.63 份。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

本基金投资于国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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。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。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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的

比例为60-95%(其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内股票不低于非现金基金资产的80%;港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的50%)。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金业绩比较基准为:中国战略新兴产业成份指数收益率*80%+恒生港股通中国科技指数收益率*10%+1年期定期存款利率(税后)*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号—年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、自2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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〔2014〕81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《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号文《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号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税〔2025〕4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税〔2026〕10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c)对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,903,318.85
等于：本金	1,903,149.19
加：应计利息	169.66
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	3,406,968.72
等于：本金	3,406,938.50
加：应计利息	30.22
减：坏账准备	-
合计	5,310,287.57

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	73,607,987.46	-	96,957,882.68	23,349,895.22
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	73,607,987.46	-	96,957,882.68	23,349,895.22

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：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金在本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金在本报告期末未持有黄金衍生品。

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：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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

本基金在本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金在本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期末无债权投资，不需计提减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金在本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金在本报告期末无其他债权投资，不需计提减值准备。

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：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金在本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.64
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	-
合计	14.64

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中海科技创新混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,447,894.52	5,447,894.52
本期申购	13,269,992.76	13,269,992.76
本期赎回（以“-”号填列）	-9,750,496.49	-9,750,496.49
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	8,967,390.79	8,967,390.79

中海科技创新混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,445,161.02	18,445,161.02
本期申购	60,880,111.09	60,880,111.09
本期赎回（以“-”号填列）	-43,010,206.40	-43,010,206.40
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	36,315,065.71	36,315,065.71

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

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

中海科技创新混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-88,184.34	25,541.40	-62,642.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-88,184.34	25,541.40	-62,642.94
本期利润	1,323,653.06	4,941,993.43	6,265,646.49
本期基金份额交易产生的变动数	5,165,642.88	909,110.73	6,074,753.61
其中：基金申购款	8,493,085.15	2,573,915.19	11,067,000.34

基金赎回款	-3,327,442.27	-1,664,804.46	-4,992,246.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,401,111.60	5,876,645.56	12,277,757.16

中海科技创新混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-365,303.35	87,299.81	-278,003.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-365,303.35	87,299.81	-278,003.54
本期利润	9,866,217.74	18,096,873.03	27,963,090.77
本期基金份额交易产生的变动数	15,935,494.87	5,453,826.73	21,389,321.60
其中：基金申购款	38,766,609.36	12,031,572.17	50,798,181.53
基金赎回款	-22,831,114.49	-6,577,745.44	-29,408,859.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,436,409.26	23,637,999.57	49,074,408.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	755.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	521.26
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,276.76

注：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产生的利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,001,554.38
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	11,001,554.38

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	86,247,895.47
减：卖出股票成本总额	75,089,176.12
减：交易费用	157,164.97
买卖股票差价收入	11,001,554.38

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期无股票投资收益—证券出借差价收入。

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：本基金在本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

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：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

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：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

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：本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益－赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期无贵金属投资收益－申购差价收入。

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：本基金在本报告期无衍生工具收益－买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金在本报告期无衍生工具收益－其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	83,914.93
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	83,914.93

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,038,866.46
股票投资	23,038,866.46
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	23,038,866.46

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	398,621.88
基金转换费收入	47.55
合计	398,669.43

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

注：本基金在本报告期无其他费用。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期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
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
长沙银行股份有限公司（“长沙银行”）	基金托管人
民生证券股份有限公司（“民生证券”）	基金管理人的股东的控股子公司、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期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
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	171,125.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,560.75
应支付基金管理人的净管理费	136,564.99

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 1.20\%/ \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,521.00

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中海科技创新混合 A	中海科技创新混合 C	合计
中海基金	-	256.76	256.76
合计	-	256.76	256.76

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%,C 类基金

份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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：本基金在本报告期末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

注：本基金在本报告期末未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期末未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金在本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金在本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
长沙银行	1,903,318.85	755.50

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认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	3,649	2,276,875.07	3,035,968.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了《中海基金管理有限公司投资决策委员会议事规则》、《中海基金管理有限公司公募基金投资管理团队管理办法》、《中海基金管理有限公司研究部管理办法》、《中海基金管理有限公司基金股票库管理办法》、《中海基金管理有限公司基金债券库管理办法》、《中海基金管理有限公司投资组合信用债业务运作管理办法》、《中海基金管理有限公司基金流动性风险及巨额赎回管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理部门、合规管理部门、

相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人管理的托管户中，因而与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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券均在证券交易所上市或在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

下表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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,310,287.57	-	-	-	-	-	5,310,287.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	96,957,882.68	96,957,882.68
应收申购款	-	-	-	-	-	5,970,031.20	5,970,031.20
资产总计	5,310,287.57	-	-	-	-	102,927,913.88	108,238,201.45
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,502,080.08	1,502,080.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,937.09	59,937.09
应付托管费	-	-	-	-	-	9,989.53	9,989.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,557.62	31,557.62
其他负债	-	-	-	-	-	14.64	14.64
负债总计	-	-	-	-	-	1,603,578.96	1,603,578.96
利率敏感度缺口	5,310,287.57	-	-	-	-	-101,324,334.92	106,634,622.49
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,651,581.11	-	-	-	-	-	1,651,581.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	20,047,334.78	20,047,334.78
应收申购款	-	-	-	-	-	699.10	699.10
应收清算款	-	-	-	-	-	1,997,019.10	1,997,019.10
资产总计	1,651,581.11	-	-	-	-	22,045,052.98	23,696,634.09
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,787.89	8,787.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,756.26	36,756.26
应付托管费	-	-	-	-	-	6,126.04	6,126.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,688.63	20,688.63
其他负债	-	-	-	-	-	71,866.21	71,866.21
负债总计	-	-	-	-	-	144,225.03	144,225.03
利率敏感度缺口	1,651,581.11	-	-	-	-	-21,900,827.95	23,552,409.06

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末和上年度末均未持有交易性债券投资，银行存款、结算备付金及存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动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。本基金在购买港股时会存在人民币与港币之间的转换，因此

存在相应的外汇风险。

6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	5,953,474.00	-	5,953,474.00
资产合计	-	5,953,474.00	-	5,953,474.00
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	5,953,474.00	-	5,953,474.00

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）

分析	所有外币均相对人民币升值 5%	-	297,673.70
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-	-297,673.70

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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：股票资产占基金资产的比例为 60-95%（其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过本基金股票资产的 50%）。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	96,957,882.68	90.93	20,047,334.78	85.12
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	96,957,882.68	90.93	20,047,334.78	85.12

注：由于四舍五入的原因，上表“占基金资产净值的比例”列数据可能与实际值存在微小的误差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为沪深 300 指数与北证 50 指数同时变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深 300 指数与北证 50 指数同时变化 5%，其他市场变量均不发生变化		
	Beta 系数是根据报表日持仓资产在过去 100 个交易日收益率与其对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于 100 个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	8,799,713.82	2,196,189.69
	-5%	-8,799,713.82	-2,196,189.69

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。		
	根据基金单位净值收益率在报表日过去 100 个交易日的分布情况。		
	以 95%的置信区间计算基金日收益率的绝对 VaR 值（不足 100 个交易日不予计算）。		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	收益率绝对 VaR（%）	3.99	2.11
	合计	－	－

注：上述分析衡量了在 95%的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	93,921,914.68	19,477,349.98
第二层次	3,035,968.00	569,984.80
第三层次	-	-
合计	96,957,882.68	20,047,334.78

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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2025 年 12 月 31 日：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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金在本报告期末无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	96,957,882.68	89.58
	其中：股票	96,957,882.68	89.58
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	5,310,287.57	4.91
8	其他各项资产	5,970,031.20	5.52
9	合计	108,238,201.45	100.00

注：本基金在本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

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	96,957,882.68	90.93
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	96,957,882.68	90.93

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金在本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

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

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	688820	盛合晶微	26,056	5,044,702.16	4.73
2	002156	通富微电	65,200	4,946,724.00	4.64
3	600584	长电科技	47,700	4,939,335.00	4.63
4	688630	芯碁微装	8,658	4,756,618.62	4.46
5	000021	深科技	63,800	4,100,426.00	3.85
6	000725	京东方 A	469,300	4,073,524.00	3.82
7	688120	华海清科	12,435	4,006,308.30	3.76
8	688082	盛美上海	8,809	3,805,488.00	3.57
9	688403	汇成股份	93,160	3,698,452.00	3.47
10	688352	顾中科技	146,688	3,546,915.84	3.33
11	688362	甬矽电子	33,801	3,258,416.40	3.06
12	920438	戈碧迦	20,271	3,220,251.06	3.02
13	688079	美迪凯	104,719	3,220,109.25	3.02
14	920186	中科仪	27,225	3,125,430.00	2.93
15	688012	中微公司	6,583	3,084,135.50	2.89
16	688072	拓荆科技	3,649	3,035,968.00	2.85
17	688603	天承科技	14,297	2,973,061.15	2.79
18	603005	晶方科技	53,600	2,887,432.00	2.71
19	002436	兴森科技	54,300	2,766,585.00	2.59
20	002409	雅克科技	11,600	2,604,200.00	2.44
21	688172	燕东微	30,115	2,519,420.90	2.36
22	300776	帝尔激光	11,500	2,472,040.00	2.32
23	603203	快克智能	31,680	2,432,390.40	2.28
24	688700	东威科技	26,664	2,383,761.60	2.24
25	600707	彩虹股份	134,300	2,268,327.00	2.13
26	300331	苏大维格	30,500	2,168,855.00	2.03
27	301392	汇成真空	7,400	2,135,936.00	2.00
28	002185	华天科技	88,300	1,969,973.00	1.85
29	688300	联瑞新材	7,957	1,944,690.80	1.82
30	603773	沃格光电	11,700	1,906,749.00	1.79

31	688019	安集科技	4,895	1,661,656.70	1.56
----	--------	------	-------	--------------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002156	通富微电	5,823,949.00	24.73
2	688630	芯碁微装	5,496,756.19	23.34
3	688820	盛合晶微	5,288,367.94	22.45
4	600584	长电科技	4,783,097.79	20.31
5	688079	美迪凯	3,819,670.17	16.22
6	000725	京东方 A	3,467,302.00	14.72
7	688700	东威科技	3,434,348.80	14.58
8	000021	深科技	3,397,276.00	14.42
9	301392	汇成真空	3,234,599.00	13.73
10	688603	天承科技	3,076,047.06	13.06
11	688019	安集科技	3,022,251.65	12.83
12	920186	中科仪	2,929,869.49	12.44
13	688082	盛美上海	2,912,445.42	12.37
14	688352	颀中科技	2,863,917.16	12.16
15	688403	汇成股份	2,863,043.53	12.16
16	002185	华天科技	2,640,216.00	11.21
17	920438	戈碧迦	2,633,916.40	11.18
18	688072	拓荆科技	2,598,844.80	11.03
19	688120	华海清科	2,596,248.97	11.02
20	300776	帝尔激光	2,554,127.00	10.84
21	603005	晶方科技	2,401,262.00	10.20
22	688012	中微公司	2,329,764.45	9.89
23	002008	大族激光	2,261,320.00	9.60
24	603773	沃格光电	2,260,305.00	9.60
25	688172	燕东微	2,232,183.98	9.48
26	603203	快克智能	2,188,991.30	9.29
27	688362	甬矽电子	2,114,728.48	8.98
28	300331	苏大维格	2,097,612.00	8.91
29	600707	彩虹股份	2,072,811.00	8.80
30	002436	兴森科技	2,019,727.00	8.58
31	002273	水晶光电	2,004,618.00	8.51
32	688300	联瑞新材	2,000,933.26	8.50
33	002409	雅克科技	1,671,173.00	7.10
34	688008	澜起科技	1,575,951.06	6.69
35	688535	华海诚科	1,555,273.59	6.60
36	300236	上海新阳	1,548,819.00	6.58
37	300757	罗博特科	1,284,245.00	5.45

38	600714	金瑞矿业	1,217,920.00	5.17
39	688498	源杰科技	1,188,600.59	5.05
40	300308	中际旭创	1,182,403.00	5.02
41	688123	聚辰股份	1,096,901.20	4.66
42	300842	帝科股份	1,010,133.00	4.29
43	300456	赛微电子	982,987.00	4.17
44	300502	新易盛	970,034.00	4.12
45	300751	迈为股份	936,684.00	3.98
46	300731	科创新源	892,475.00	3.79
47	688170	德龙激光	862,395.48	3.66
48	688521	芯原股份	796,483.74	3.38
49	688668	鼎通科技	745,625.06	3.17
50	688347	华虹宏力	738,018.76	3.13
51	300316	晶盛机电	723,115.00	3.07
52	603986	兆易创新	702,468.00	2.98
53	300782	卓胜微	698,100.00	2.96
54	002384	东山精密	694,575.00	2.95
55	688195	腾景科技	691,559.93	2.94
56	02577	英诺赛科	683,123.21	2.90
57	301486	致尚科技	671,676.00	2.85
58	002245	蔚蓝锂芯	661,250.00	2.81
59	688220	翱捷科技	634,100.73	2.69
60	688702	盛科通信	622,962.23	2.65
61	688313	仕佳光子	611,001.39	2.59
62	300394	天孚通信	607,232.00	2.58
63	002837	英维克	487,974.00	2.07
64	300054	鼎龙股份	486,504.00	2.07
65	688037	芯源微	479,223.07	2.03
66	688127	蓝特光学	477,754.72	2.03

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	2,895,299.00	12.29
2	688498	源杰科技	2,871,790.39	12.19
3	300308	中际旭创	2,449,436.26	10.40
4	688630	芯碁微装	2,233,962.96	9.49
5	002273	水晶光电	2,107,036.00	8.95
6	603773	沃格光电	2,055,434.00	8.73
7	688048	长光华芯	2,020,973.39	8.58

8	688008	澜起科技	1,890,115.33	8.03
9	300502	新易盛	1,722,914.50	7.32
10	002156	通富微电	1,677,414.00	7.12
11	300757	罗博特科	1,674,452.00	7.11
12	603986	兆易创新	1,623,206.00	6.89
13	300751	迈为股份	1,621,186.00	6.88
14	601231	环旭电子	1,580,768.00	6.71
15	300223	北京君正	1,551,041.00	6.59
16	688019	安集科技	1,536,801.20	6.53
17	300236	上海新阳	1,530,000.00	6.50
18	600584	长电科技	1,507,936.00	6.40
19	688079	美迪凯	1,482,689.89	6.30
20	688535	华海诚科	1,440,832.00	6.12
21	01347	华虹宏力	781,103.80	3.32
22	688347	华虹宏力	620,180.32	2.63
23	688521	芯原股份	1,353,685.30	5.75
24	688700	东威科技	1,313,580.62	5.58
25	920438	戈碧迦	1,294,225.45	5.50
26	00981	中芯国际	1,279,842.39	5.43
27	301392	汇成真空	1,251,897.00	5.32
28	600714	金瑞矿业	1,197,636.00	5.08
29	688702	盛科通信	1,187,095.40	5.04
30	688012	中微公司	1,138,195.28	4.83
31	688195	腾景科技	1,122,930.15	4.77
32	300842	帝科股份	1,118,958.00	4.75
33	002384	东山精密	1,071,830.00	4.55
34	300731	科创新源	1,067,039.00	4.53
35	000021	深科技	1,036,908.00	4.40
36	688170	德龙激光	970,045.02	4.12
37	300776	帝尔激光	928,217.00	3.94
38	09988	阿里巴巴-W	899,511.61	3.82
39	688820	盛合晶微	893,100.94	3.79
40	300456	赛微电子	890,734.00	3.78
41	002185	华天科技	885,978.00	3.76
42	300394	天孚通信	870,909.00	3.70
43	300433	蓝思科技	852,405.00	3.62
44	600707	彩虹股份	850,015.00	3.61
45	688072	拓荆科技	842,345.70	3.58
46	00700	腾讯控股	833,568.53	3.54
47	688313	仕佳光子	828,135.11	3.52
48	688249	晶合集成	817,594.28	3.47
49	688123	聚辰股份	796,830.30	3.38
50	000725	京东方 A	790,987.00	3.36

51	301486	致尚科技	721,426.00	3.06
52	300316	晶盛机电	699,768.00	2.97
53	688041	海光信息	691,515.02	2.94
54	688668	鼎通科技	684,507.10	2.91
55	300782	卓胜微	666,192.00	2.83
56	688603	天承科技	663,529.90	2.82
57	002475	立讯精密	661,606.00	2.81
58	02577	英诺赛科	659,303.54	2.80
59	01211	比亚迪股份	652,255.00	2.77
60	688220	翱捷科技	639,472.39	2.72
61	002245	蔚蓝锂芯	596,786.00	2.53
62	300724	捷佳伟创	572,857.00	2.43
63	688027	国盾量子	560,599.04	2.38
64	02359	药明康德	555,667.65	2.36
65	688127	蓝特光学	554,428.33	2.35
66	300054	鼎龙股份	526,198.00	2.23
67	688256	寒武纪	483,761.19	2.05
68	688147	微导纳米	480,528.56	2.04

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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	128,960,857.56
卖出股票收入（成交）总额	86,247,895.47

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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：本基金在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

注：本基金在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

注：本基金在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

注：本基金在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

注：本基金在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

本基金在本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在本报告期末投资国债期货。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,970,031.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,970,031.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金在本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金在本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
中海科技 创新混合 A	1,276	7,027.74	0.00	0.00	8,967,390.79	100.00
中海科技 创新混合 C	3,792	9,576.76	188,593.28	0.52	36,126,472.43	99.48
合计	5,068	8,934.98	188,593.28	0.42	45,093,863.22	99.58

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中海科技创新混合 A	3,204.76	0.0357
	中海科技创新混合 C	19,966.82	0.0550
	合计	23,171.58	0.0512

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	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	中海科技创新混合 A	0~10
	中海科技创新混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中海科技创新混合 A	0
	中海科技创新混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中海科技创新混合 A	中海科技创新混合 C
基金合同生效日 （2025 年 7 月 21 日） 基金份额总额	27,262,688.23	184,326,629.40
本报告期期初基金份 额总额	5,447,894.52	18,445,161.02
本报告期基金总申购 份额	13,269,992.76	60,880,111.09
减：本报告期基金总 赎回份额	9,750,496.49	43,010,206.40

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,967,390.79	36,315,065.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

根据本基金管理人于 2026 年 5 月 27 日发布的《中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海科技创新主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于中海科技创新主题混合型证券投资基金持续运作的议案》。

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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经托管人长沙银行股份有限公司研究决定，罗旺林不再担任资产托管部副总经理职务。上述人事变动已按相关监管规定备案。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内本基金管理人高级管理人员、相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人不存在应披露的受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人相关从业人员不存在应披露的受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
江海证券	3	215,208,753.03	100.00	95,076.88	100.00	-
财通证券	3	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据基金管理人合规风控能力、信息系统建设、产品管理规模等情况，选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并合理选择证券交易模式，降低交易成本。

2、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。根据基金管理人及基金法律文件中对证券公司交易单元的选择标准，确定拟合作证券公司白名单，在券商交易模式合作白名单中，以券商交易服务能力、降低业务成本作为交易单元的主要选择标准。由基金管理人相关部门与券商对应部门进行商务谈判，经公司审核后完成协议签署以及交易单元办理。

3、本报告期内所有交易单元均为新增。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
江海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

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	中海科技创新主题混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
2	中海科技创新主题混合型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-30
3	中海科技创新主题混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
4	中海基金管理有限公司关于以通讯方	报刊及规定网站	2026-05-27

	式召开中海科技创新主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告		
5	中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海科技创新主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	报刊及规定网站	2026-05-28
6	中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海科技创新主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	报刊及规定网站	2026-05-29
7	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市排排网基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2026-06-11
8	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司申购（含定期定额申购）费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2026-06-12
9	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司转换费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2026-06-12

§ 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	2026-01-01 至 2026-05-27	17,500,000.00	0.00	17,500,000.00	0.00	0.00
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							
2、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。							
3、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。							
4、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。							

5、提前终止基金合同的风险

持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人于 2026 年 5 月 27 日发布的《中海基金管理有限公司关于以通讯方式召开中海科技创新主题混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于中海科技创新主题混合型证券投资基金持续运作的议案》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海科技创新主题混合型证券投资基金的文件
- 2、中海科技创新主题混合型证券投资基金基金合同
- 3、中海科技创新主题混合型证券投资基金托管协议
- 4、中海科技创新主题混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日