

东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金联接 基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月27日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	60
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.13 投资组合报告附注	60

§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	65
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	东财上证科创200ETF联接	
基金主代码	026117	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年01月27日	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	67,735,007.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财上证科创200ETF 联接A	东财上证科创200ETF 联接C
下属分级基金的交易代码	026117	026118
报告期末下属分级基金的份额总额	43,651,529.51份	24,083,478.06份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	589330
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026-05-21
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2026-05-29
基金管理人名称	东财基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于

	目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。 1、资产配置策略 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股及其备选成份股、债券、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、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的相关规定）。 2、目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的两种方式如下： （1）申购和赎回：以申购/赎回对价进行申购赎回目标ETF或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购赎回目标ETF。 （2）二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申购赎回的方式或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整。 3、股票投资策略 基金可投资于标的指数成份股及其备选成份股，以更好的跟踪标的指数。同时，还可通过买入标的指数成份股及其备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对标的指数成份股及其备选成份股的投资，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过
--	---

	投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 4、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	上证科创板200指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，且目标ETF为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。特殊情形包括但不限于：1、法律法规的限制；2、标的指数成份股流动性严重不足；3、标的指数的成份股长期停牌；4、标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；5、标的指数成份股派发现金股息；6、指数成份股定期或临时调整；7、标的指数编制方法发生变化；8、其他基金管理人认定不适合投资的股票或

	可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。
业绩比较基准	上证科创板200指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东财基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	王小飞
	联系电话	021-23526999	021-6063 7103
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-9210-107	021-60637228
传真		021-23526940	021-60635778
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200030	100033
法定代表人		戴彦	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告置备地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼
--------	------------	-------------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月27日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	东财上证科创200E TF联接A	东财上证科创200E TF联接C
本期已实现收益	11,990,922.03	6,400,042.49
本期利润	23,178,237.65	12,200,162.94
加权平均基金份额本期利润	0.2206	0.1985
本期加权平均净值利润率	21.34%	19.27%
本期基金份额净值增长率	30.94%	30.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	8,700,368.52	4,781,071.97
期末可供分配基金份额利润	0.1993	0.1985
期末基金资产净值	57,155,384.21	31,513,383.92
期末基金份额净值	1.3094	1.3085
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	30.94%	30.85%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金的基金合同生效日为2026年1月27日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2026年6月30日数据，特此说明。

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

东财上证科创200ETF联接A

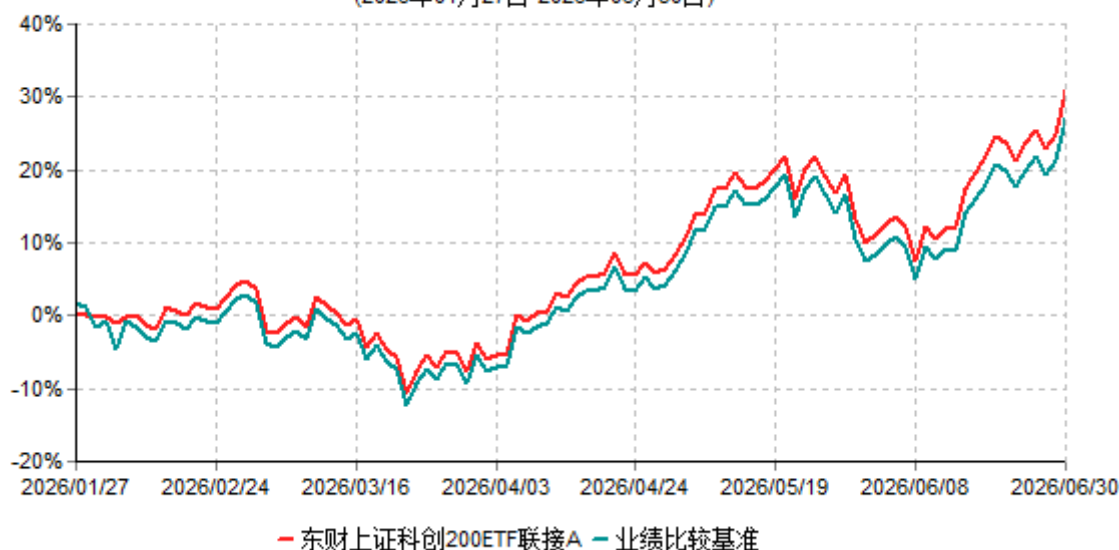
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	41.71%	2.26%	40.06%	2.25%	1.65%	0.01%
自基金合同 生效起至今	30.94%	2.21%	27.06%	2.31%	3.88%	-0.10%

东财上证科创200ETF联接C

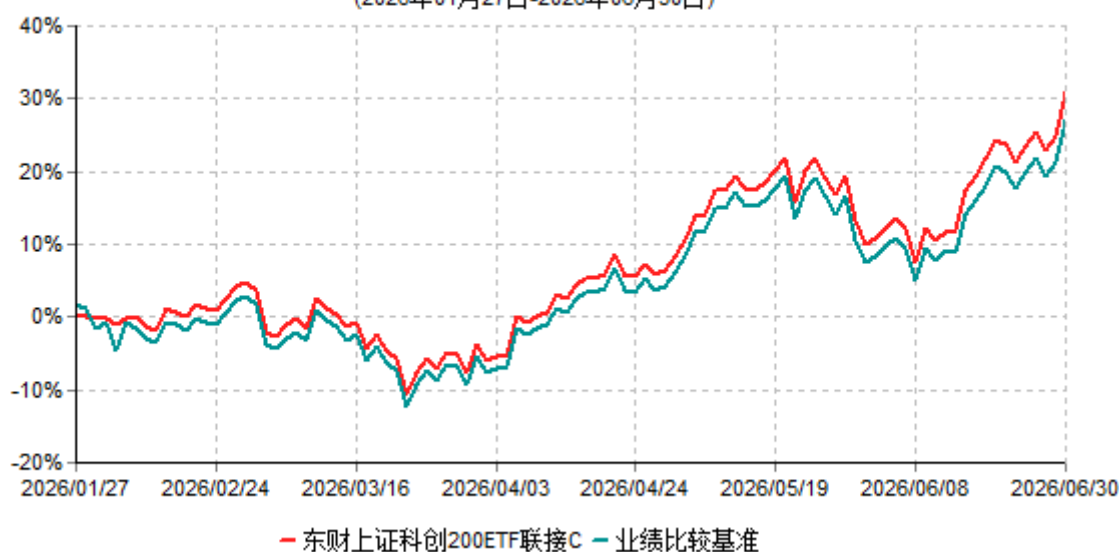
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	41.64%	2.26%	40.06%	2.25%	1.58%	0.01%
自基金合同 生效起至今	30.85%	2.21%	27.06%	2.31%	3.79%	-0.10%

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

东财上证科创200ETF联接A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年01月27日-2026年06月30日)



东财上证科创200ETF联接C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年01月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2026年1月27日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、按本基金基金合同约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵肖萌	本基金基金经理	2026-01-27	-	12年	复旦大学国际贸易学硕士。曾任海通证券股份有限公司（现国泰海通证券股份有限公司）管理培训生、申万宏源证券有限公司做市经理，现任东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。
姚楠燕	本基金基金经理助理	2026-01-27	-	9年	美国南加利福尼亚大学公共政策硕士。曾任中欧国际工商学院金融学/会计学研究助理、东财基金管理有限公司筹备组成员，现任东财基金管理有限公司基金经理兼基金经理助理。

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

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金费用、申购赎回、交易成本、网下新股申购等因素。当申赎变动、成份股调整、成份股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，保持基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，东财上证科创200ETF联接A份额净值为1.3094元，报告期内基金份额净值增长率为30.94%，同期业绩比较基准收益率为27.06%；东财上证科创200ETF联接C份额净值为1.3085元，报告期内基金份额净值增长率为30.85%，同期业绩比较基准收益率为27.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日
资 产:		
货币资金	6.4.7.1	5,278,707.12
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	84,905,529.57
其中：股票投资		84,905,529.57
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		114,642.89
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		90,298,879.58
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,538,938.82

应付管理人报酬		10,956.78
应付托管费		3,652.24
应付销售服务费		3,880.77
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	72,682.84
负债合计		1,630,111.45
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	67,735,007.57
未分配利润	6.4.7.8	20,933,760.56
净资产合计		88,668,768.13
负债和净资产总计		90,298,879.58

注：1、报告截止日2026年6月30日，东财上证科创200ETF联接A基金份额净值人民币1.3094元，基金份额总额43,651,529.51份；东财上证科创200ETF联接C基金份额净值人民币1.3085元，基金份额总额24,083,478.06份。基金份额总额合计为67,735,007.57份。

2、本基金基金合同生效日为2026年1月27日，本期是指2026年1月27日至2026年6月30日，无上年度末可比数据。

6.2 利润表

会计主体：东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月27日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		35,641,419.14
1.利息收入		27,019.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	27,019.07
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）		18,587,150.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	18,354,125.37
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	233,025.28
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,987,436.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	39,813.35
减：二、营业总支出		263,018.55
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	109,563.75
2.托管费	6.4.10.2.2	36,521.23
3.销售服务费	6.4.10.2.3	40,257.33
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	6.4.7.19	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.20	76,676.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,378,400.59
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,378,400.59
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		35,378,400.59
----------	--	---------------

注：本基金基金合同生效日为2026年1月27日，本期是指2026年1月27日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	323,894,074.11	-	323,894,074.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-256,159,066.54	20,933,760.56	-235,225,305.98
（一）、综合收益总额	-	35,378,400.59	35,378,400.59
（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）	-256,159,066.54	-14,444,640.03	-270,603,706.57
其中：1.基金申购款	37,466,069.72	2,068,374.47	39,534,444.19
2.基金赎回款	-293,625,136.26	-16,513,014.50	-310,138,150.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	67,735,007.57	20,933,760.56	88,668,768.13
-----------	---------------	---------------	---------------

注：本基金基金合同生效日为2026年1月27日，本期是指2026年1月27日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

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：

顾勇	侯福岩	陆文澄
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东财上证科创板200指数型证券投资基金（以下简称“原基金”）系由基金管理人东财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》等法律法规以及《东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同》、《东财上证科创板200指数型证券投资基金招募说明书》的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025] 2496 号文准予公开募集注册。原基金首次设立募集基金份额为323,894,074.11份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（26）第00020号验资报告。经向中国证监会备案，原基金合同于2026年1月27日正式生效。

根据基金管理人于2026年6月10日发布的《东财基金管理有限公司关于东财上证科创板200指数型证券投资基金转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》，原基金变更为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”），《东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他法律文件自2026年6月11日起生效，原《东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为人中国建设银行股份有限公司。

本基金为东财上证科创板 200 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标ETF”）的联接基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。在正常市场情况下，本基金力争将基金份额净值的增长率与业绩比较基准的收益率的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款等）、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：上证科创板200指数收益率×95%+活期存款基准利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月27日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年1月27日（基金合同生效日）至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

（2）金融负债的分类

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

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证

券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。

（2）投资收益

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

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

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

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

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

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

基金投资在持有期间应取得的红利于除权除息日确认为投资收益。

（3）公允价值变动收益

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

（4）信用减值损失

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

(5) 其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金管理人可每月进行分红评估，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，并于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值；

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

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

（4）根据中基协字[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》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

（4）对证券投资基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	2,497,615.79
等于：本金	2,497,328.05
加：应计利息	287.74
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	2,781,091.33
等于：本金	2,781,045.56
加：应计利息	45.77
减：坏账准备	-
合计	5,278,707.12

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		67,918,093.50	-	84,905,529.57	16,987,436.07
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		67,918,093.50	-	84,905,529.57	16,987,436.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	16,459.45
预提费用-信息披露费	54,866.90
其他应付	1,356.49
合计	72,682.84

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财上证科创200ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (东财上证科创200ETF联接A)	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	199,946,818.20	199,946,818.20
本期申购	15,393,844.72	15,393,844.72
本期赎回（以“-”号填列）	-171,689,133.41	-171,689,133.41
本期末	43,651,529.51	43,651,529.51

6.4.7.7.2 东财上证科创200ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (东财上证科创200ETF联接C)	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	123,947,255.91	123,947,255.91
本期申购	22,072,225.00	22,072,225.00
本期赎回（以“-”号填列）	-121,936,002.85	-121,936,002.85
本期末	24,083,478.06	24,083,478.06

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

2、本基金自2026年1月14日至2026年1月23日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币323,859,791.25元（其中A类人民币199,925,481.42元，C类人民币123,934,309.83元）。根据《东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》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34,282.86元（其中A类人民币21,336.78元，C类人民币12,946.08元），在本基金成立后，折算为323,894,074.11份基金份额（其中A类199,946,818.20份，C类123,947,255.91份），划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财上证科创200ETF联接A

单位：人民币元

项目 (东财上证科创200ETF 联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,990,922.03	11,187,315.62	23,178,237.65
本期基金份额交易产生的变动数	-3,290,553.51	-6,383,829.44	-9,674,382.95
其中：基金申购款	550,987.06	332,992.78	883,979.84
基金赎回款	-3,841,540.57	-6,716,822.22	-10,558,362.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,700,368.52	4,803,486.18	13,503,854.70

6.4.7.8.2 东财上证科创200ETF联接C

单位：人民币元

项目 (东财上证科创200ETF 联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,400,042.49	5,800,120.45	12,200,162.94
本期基金份额交易产生的变动数	-1,618,970.52	-3,151,286.56	-4,770,257.08
其中：基金申购款	657,371.23	527,023.40	1,184,394.63

基金赎回款	-2,276,341.75	-3,678,309.96	-5,954,651.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,781,071.97	2,648,833.89	7,429,905.86

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	24,632.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,387.00
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	27,019.07

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	18,354,125.37
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	18,354,125.37

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30
----	---------------------------------------

	日
卖出股票成交总额	261,046,853.78
减：卖出股票成本总额	242,413,697.41
减：交易费用	279,031.00
买卖股票差价收入	18,354,125.37

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30
----	---------------------------------------

	日
股票投资产生的股利收益	233,025.28
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	233,025.28

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	16,987,436.07
——股票投资	16,987,436.07
——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	16,987,436.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	39,813.35

合计	39,813.35
----	-----------

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	16,459.45
信息披露费	54,866.90
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,949.89
开户费	400.00
合计	76,676.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银	基金托管人

行”)	
东方财富证券股份有限公司 (“东财证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
上海天天基金销售有限公司 (“天天基金”)	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构
东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未发生应付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年
----	----------------------------------

	06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	109,563.75
其中：应支付销售机构的客户维护费	54,459.14
应支付基金管理人的净管理费	55,104.61

注：1、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则E取0；

2、由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,521.23

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产净值后的余额，若为负数，则E取0

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日
--------------	--

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财上证科创200ETF联接A	东财上证科创200ETF联接C	合计
天天基金	0.00	1,710.06	1,710.06
东财证券	0.00	14,418.20	14,418.20
合计	0.00	16,128.26	16,128.26

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0.15%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.15%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

（1）基金管理人直销渠道：对于基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。基金销售子公司销售母公司所管理基金的，按照本条要求执行。

（2）代销渠道：对于投资者持续持有期限未超过一年（即365天，下同）的基金份额计提的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。对于持续持有期限超过一年的基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 1、本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2、本基金基金合同生效日为2026年1月27日，本期是指2026年1月27日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

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

- 1、本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。
- 2、本基金基金合同生效日为2026年1月27日，本期是指2026年1月27日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月27日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	2,497,615.79	24,632.07

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股限售	81.88	1,584.33	47	3,848.36	74,463.51	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股限售	26.28	172.09	153	4,020.84	26,329.77	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股限售	40.98	308.19	57	2,335.86	17,566.83	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股限售	6.41	24.13	609	3,903.69	14,695.17	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股限售	17.70	84.32	124	2,194.80	10,455.68	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股限售	13.86	73.46	114	1,580.04	8,374.44	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股限售	15.76	46.71	71	1,118.96	3,316.41	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月	新股限售	22.68	47.61	68	1,542.24	3,237.48	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股限售	33.49	33.93	35	1,172.15	1,187.55	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为ETF联接基金，采用把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资的方法，且目标ETF为采用指数化操作的股票型基金，因此本基金的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。本基金在日常经营活动中面临的与本基金所投资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。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡以实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金本报告期末未持有债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,278,707.12	-	-	-	5,278,707.12
交易性金融资产	-	-	-	84,905,529.57	84,905,529.57
应收申购款	-	-	-	114,642.89	114,642.89
资产总计	5,278,707.12	-	-	85,020,172.46	90,298,879.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,538,938.82	1,538,938.82
应付管理人报酬	-	-	-	10,956.78	10,956.78
应付托管费	-	-	-	3,652.24	3,652.24
应付销售服务费	-	-	-	3,880.77	3,880.77
其他负债	-	-	-	72,682.84	72,682.84
负债总计	-	-	-	1,630,111.45	1,630,111.45
利率敏感度缺	5,278,707.12	-	-	83,390,061.01	88,668,768.13

□					
---	--	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股及其备选成份股，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股及其备选成份股进行被动式指数化投资，且本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。本基金可以申购/赎回对价进行申购赎回目标ETF或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购赎回目标ETF，也可以在二级市场进行目标ETF基金份额交易的方式投资目标ETF。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	84,905,529.57	95.76
交易性金融资产—基金投资	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	84,905,529.57	95.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	业绩比较基准上升5%	4,066,083.44
	业绩比较基准下降5%	-4,066,083.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	84,745,902.73

第二层次	-
第三层次	159,626.84
合计	84,905,529.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	84,905,529.57	94.03
	其中：股票	84,905,529.57	94.03
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	5,278,707.12	5.85
8	其他各项资产	114,642.89	0.13
9	合计	90,298,879.58	100.00

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

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	68,980,484.21	77.80
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	10,866,972.54	12.26
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	5,058,072.82	5.70
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	84,905,529.57	95.76
--	----	---------------	-------

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688668	鼎通科技	4,712	1,758,989.60	1.98
2	688403	汇成股份	44,262	1,757,201.40	1.98
3	688025	杰普特	3,738	1,756,860.00	1.98
4	688362	甬矽电子	17,619	1,698,471.60	1.92
5	688388	嘉元科技	36,845	1,621,180.00	1.83
6	688503	聚和材料	10,718	1,422,278.60	1.60
7	688372	伟测科技	7,582	1,410,252.00	1.59
8	688257	新锐股份	13,788	1,404,997.20	1.58
9	688545	兴福电子	10,150	1,350,559.00	1.52
10	688300	联瑞新材	5,446	1,331,002.40	1.50
11	688596	正帆科技	16,386	1,295,477.16	1.46
12	688233	神工股份	5,676	1,217,047.92	1.37
13	688531	日联科技	6,454	1,147,779.36	1.29
14	688652	京仪装备	5,578	1,116,548.26	1.26
15	688127	蓝特光学	11,244	1,097,414.40	1.24
16	688392	骄成超声	4,433	1,007,088.94	1.14
17	688268	华特气体	3,638	973,165.00	1.10
18	688800	瑞可达	9,730	933,788.10	1.05
19	688028	沃尔德	5,958	928,673.46	1.05
20	688559	海目星	10,977	921,189.84	1.04
21	688700	东威科技	10,096	902,582.40	1.02
22	688535	华海诚科	4,721	882,827.00	1.00

23	688507	索辰科技	3,078	830,075.04	0.94
24	688059	华锐精密	3,972	793,248.12	0.89
25	688131	皓元医药	8,372	791,991.20	0.89
26	688359	三孚新科	3,918	777,487.92	0.88
27	688150	莱特光电	11,146	764,838.52	0.86
28	688158	优刻得	20,578	756,447.28	0.85
29	688106	金宏气体	17,914	743,072.72	0.84
30	688368	晶丰明源	3,429	742,447.08	0.84
31	688381	帝奥微	13,756	735,946.00	0.83
32	688401	路维光电	7,621	731,463.58	0.82
33	688380	中微半导	11,088	730,810.08	0.82
34	688003	天准科技	5,478	697,349.40	0.79
35	688319	欧林生物	15,814	695,499.72	0.78
36	688661	和林微纳	4,331	688,542.38	0.78
37	688515	裕太微	2,602	647,273.52	0.73
38	688262	国芯科技	14,957	646,591.11	0.73
39	688206	概伦电子	14,571	646,515.27	0.73
40	688378	奥来德	10,119	627,378.00	0.71
41	688275	万润新能	4,914	626,780.70	0.71
42	688757	胜科纳米	9,097	606,769.90	0.68
43	688593	新相微	15,348	597,344.16	0.67
44	688690	纳微科技	13,462	593,674.20	0.67
45	688605	先锋精科	5,706	593,538.12	0.67
46	688518	联赢激光	19,047	588,552.30	0.66
47	688603	天承科技	2,768	575,605.60	0.65
48	688598	金博股份	11,505	568,922.25	0.64
49	688258	卓易信息	4,697	556,782.38	0.63
50	688508	芯朋微	5,973	555,250.08	0.63
51	688711	宏微科技	11,816	537,037.20	0.61
52	688031	星环科技	4,638	534,204.84	0.60
53	688717	艾罗能源	6,315	521,429.55	0.59

54	688353	华盛锂电	4,479	519,877.53	0.59
55	688239	航宇科技	8,599	514,478.17	0.58
56	688556	高测股份	37,108	492,794.24	0.56
57	688625	呈和科技	5,838	492,785.58	0.56
58	688677	海泰新光	4,731	478,446.03	0.54
59	688691	灿芯股份	4,008	464,647.44	0.52
60	688321	微芯生物	17,284	455,087.72	0.51
61	688376	美埃科技	3,813	443,451.90	0.50
62	688261	东微半导	4,129	433,255.97	0.49
63	688108	赛诺医疗	23,336	432,416.08	0.49
64	688222	成都先导	13,356	428,861.16	0.48
65	688428	诺诚健华	14,933	425,142.51	0.48
66	688107	安路科技	9,041	412,269.60	0.46
67	688383	新益昌	2,177	409,363.08	0.46
68	688191	智洋创新	10,897	389,022.90	0.44
69	688678	福立旺	15,712	379,759.04	0.43
70	688016	心脉医疗	4,212	373,351.68	0.42
71	688083	中望软件	5,739	371,600.25	0.42
72	688049	炬芯科技	7,902	370,682.82	0.42
73	688371	菲沃泰	9,458	368,767.42	0.42
74	688591	泰凌微	10,697	367,762.86	0.41
75	688202	美迪西	4,540	366,423.40	0.41
76	688418	震有科技	7,585	364,686.80	0.41
77	688035	德邦科技	3,940	361,692.00	0.41
78	688386	泛亚微透	3,952	355,047.68	0.40
79	688209	英集芯	12,030	349,832.40	0.39
80	688277	天智航	20,367	348,275.70	0.39
81	688499	利元亨	6,602	346,935.10	0.39
82	688306	均普智能	34,290	346,329.00	0.39
83	688686	奥普特	2,010	338,463.90	0.38
84	688550	瑞联新材	5,816	336,455.60	0.38

85	688543	国科军工	8,479	334,496.55	0.38
86	688512	慧智微	20,852	333,006.44	0.38
87	688138	清溢光电	7,065	332,055.00	0.37
88	688653	康希通信	18,949	329,333.62	0.37
89	688486	龙迅股份	5,175	329,026.50	0.37
90	688325	赛微微电	2,490	324,720.90	0.37
91	688337	普源精电	4,254	318,752.22	0.36
92	688601	力芯微	5,245	317,584.75	0.36
93	688685	迈信林	5,720	314,028.00	0.35
94	688698	伟创电气	5,985	313,913.25	0.35
95	688611	杭州柯林	4,376	312,665.20	0.35
96	688787	海天瑞声	2,297	308,831.65	0.35
97	688125	安达智能	1,852	302,802.00	0.34
98	688165	埃夫特	14,511	296,024.40	0.33
99	688305	科德数控	4,472	291,887.44	0.33
100	688182	灿勤科技	6,720	289,430.40	0.33
101	688155	先惠技术	3,494	282,629.66	0.32
102	688103	国力电子	3,781	281,344.21	0.32
103	688226	威腾电气	6,549	280,493.67	0.32
104	688091	上海谊众	6,972	280,274.40	0.32
105	688289	圣湘生物	19,403	279,403.20	0.32
106	688221	前沿生物	12,473	279,395.20	0.32
107	688050	爱博医疗	7,635	278,295.75	0.31
108	688139	海尔生物	10,508	277,621.36	0.31
109	688788	科思科技	6,172	277,616.56	0.31
110	688510	航亚科技	11,525	275,217.00	0.31
111	688046	药康生物	11,360	274,912.00	0.31
112	688299	长阳科技	16,006	267,460.26	0.30
113	688160	步科股份	2,437	265,072.49	0.30
114	688231	隆达股份	7,180	263,721.40	0.30
115	688112	鼎阳科技	3,588	263,574.48	0.30

116	688710	益诺思	3,891	261,475.20	0.29
117	688210	统联精密	6,394	259,020.94	0.29
118	688707	振华新材	19,881	255,470.85	0.29
119	688439	振华风光	5,521	255,070.20	0.29
120	688758	赛分科技	11,542	254,039.42	0.29
121	688320	禾川科技	5,961	247,083.45	0.28
122	688583	思看科技	2,813	241,271.01	0.27
123	688007	光峰科技	17,942	238,628.60	0.27
124	688408	中信博	7,412	238,295.80	0.27
125	688219	会通股份	18,395	238,031.30	0.27
126	688621	阳光诺和	4,319	237,156.29	0.27
127	688190	云路股份	2,602	236,027.42	0.27
128	688093	世华科技	6,324	233,355.60	0.26
129	688739	成大生物	11,542	224,953.58	0.25
130	688185	康希诺	4,377	223,183.23	0.25
131	688553	汇宇制药	20,967	222,879.21	0.25
132	688176	亚虹医药	22,323	221,444.16	0.25
133	688252	天德钰	9,226	221,424.00	0.25
134	688721	龙图光罩	3,764	219,742.32	0.25
135	688173	希荻微	11,476	219,650.64	0.25
136	688377	迪威尔	9,219	217,384.02	0.25
137	688087	英科再生	6,491	216,929.22	0.24
138	688513	苑东生物	4,836	212,590.56	0.24
139	688586	江航装备	17,649	206,316.81	0.23
140	688339	亿华通	10,840	202,708.00	0.23
141	688696	极米科技	3,090	199,428.60	0.22
142	688105	诺唯赞	11,461	198,848.35	0.22
143	688697	纽威数控	14,242	193,548.78	0.22
144	688658	悦康药业	15,025	193,221.50	0.22
145	688443	智翔金泰	8,270	192,277.50	0.22
146	688522	纳睿雷达	9,564	191,471.28	0.22

147	688290	景业智能	2,873	190,652.28	0.22
148	688186	广大特材	12,453	188,662.95	0.21
149	688365	光云科技	11,806	186,180.62	0.21
150	688351	微电生理	7,961	180,396.26	0.20
151	688488	艾迪药业	14,037	180,375.45	0.20
152	688776	国光电气	2,938	180,216.92	0.20
153	688212	澳华内镜	6,075	178,605.00	0.20
154	688311	盟升电子	6,799	178,065.81	0.20
155	688095	福昕软件	2,991	177,755.13	0.20
156	688631	莱斯信息	3,684	172,816.44	0.19
157	688750	金天钛业	10,232	170,158.16	0.19
158	688023	安恒信息	4,609	169,242.48	0.19
159	688575	亚辉龙	19,132	167,596.32	0.19
160	688562	航天软件	11,078	166,834.68	0.19
161	688225	亚信安全	13,334	165,608.28	0.19
162	688799	华纳药厂	3,675	164,897.25	0.19
163	688539	高华科技	5,146	164,054.48	0.19
164	688128	中国电研	6,805	161,550.70	0.18
165	688577	浙海德曼	3,506	160,679.98	0.18
166	688639	华恒生物	9,873	159,350.22	0.18
167	688552	航天南湖	5,604	157,640.52	0.18
168	688626	翔宇医疗	3,557	157,432.82	0.18
169	688356	键凯科技	1,986	153,080.88	0.17
170	688228	开普云	1,957	151,354.38	0.17
171	688590	新致软件	12,149	151,012.07	0.17
172	688230	芯导科技	1,889	148,872.09	0.17
173	688505	复旦张江	19,834	146,374.92	0.17
174	688085	三友医疗	12,210	146,153.70	0.16
175	688648	中邮科技	3,834	140,132.70	0.16
176	688389	普门科技	14,297	139,967.63	0.16
177	688109	品茗科技	1,770	133,989.00	0.15

178	688656	浩欧博	1,350	130,639.50	0.15
179	688276	百克生物	9,330	130,060.20	0.15
180	688334	西高院	7,136	129,447.04	0.15
181	688232	新点软件	7,262	129,118.36	0.15
182	688293	奥浦迈	3,065	127,779.85	0.14
183	688399	硕世生物	2,806	127,364.34	0.14
184	688101	三达膜	7,489	123,793.17	0.14
185	688588	凌志软件	13,334	121,206.06	0.14
186	688348	昱能科技	3,420	118,947.60	0.13
187	688177	百奥泰	6,985	117,487.70	0.13
188	688315	诺禾致源	9,387	117,431.37	0.13
189	688136	科兴制药	5,565	115,251.15	0.13
190	688157	松井股份	4,305	113,608.95	0.13
191	688197	首药控股	3,382	112,992.62	0.13
192	688073	毕得医药	1,983	106,725.06	0.12
193	688084	晶品特装	2,112	106,191.36	0.12
194	688526	科前生物	7,885	95,408.50	0.11
195	688581	安杰思	1,826	94,422.46	0.11
196	688161	威高骨科	4,496	94,326.08	0.11
197	688566	吉贝尔	3,411	87,287.49	0.10
198	688151	华强科技	5,759	85,636.33	0.10
199	688196	卓越新能	2,141	76,861.90	0.09
200	688808	联讯仪器	47	74,463.51	0.08
201	688236	春立医疗	4,805	69,480.30	0.08
202	688813	泰金新能	153	26,329.77	0.03
203	688635	长进光子	57	17,566.83	0.02
204	688811	有研复材	609	14,695.17	0.02
205	603459	红板科技	124	10,455.68	0.01
206	603407	长裕集团	114	8,374.44	0.01
207	603435	嘉德利	71	3,316.41	0.00
208	688781	视涯科技	68	3,237.48	0.00

209	603293	埃泰克	35	1,187.55	0.00
-----	--------	-----	----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	688270	ST臻镭	7,477,552.15	8.43
2	688766	普冉股份	5,555,188.12	6.27
3	688627	精智达	5,084,177.51	5.73
4	688195	腾景科技	4,698,748.98	5.30
5	688167	炬光科技	4,688,467.29	5.29
6	688205	德科立	4,627,783.36	5.22
7	688388	嘉元科技	4,155,219.46	4.69
8	688048	长光华芯	3,799,187.22	4.28
9	688031	星环科技	3,750,996.83	4.23
10	688372	伟测科技	3,603,054.53	4.06
11	688630	芯碁微装	3,531,255.32	3.98
12	688102	斯瑞新材	3,516,771.84	3.97
13	688668	鼎通科技	3,209,828.69	3.62
14	688503	聚和材料	3,179,025.20	3.59
15	688158	优刻得	3,079,463.06	3.47
16	688362	甬矽电子	3,068,961.02	3.46
17	688403	汇成股份	2,953,959.19	3.33
18	688652	京仪装备	2,762,047.83	3.12
19	688559	海目星	2,693,932.55	3.04
20	688025	杰普特	2,667,307.77	3.01
21	688717	艾罗能源	2,593,901.33	2.93
22	688585	上纬新材	2,549,684.16	2.88
23	688131	皓元医药	2,448,032.13	2.76

24	688258	卓易信息	2,442,846.35	2.76
25	688800	瑞可达	2,386,802.82	2.69
26	688239	航宇科技	2,377,240.24	2.68
27	688556	高测股份	2,348,395.58	2.65
28	688518	联赢激光	2,331,390.43	2.63
29	688127	蓝特光学	2,304,679.21	2.60
30	688262	国芯科技	2,253,970.90	2.54
31	688392	骄成超声	2,239,580.52	2.53
32	688321	微芯生物	2,222,818.40	2.51
33	688233	神工股份	2,204,740.73	2.49
34	688698	伟创电气	2,190,025.15	2.47
35	688691	灿芯股份	2,149,918.45	2.42
36	688380	中微半导	2,055,243.66	2.32
37	688068	热景生物	2,016,479.75	2.27
38	688596	正帆科技	1,988,543.20	2.24
39	688206	概伦电子	1,984,711.87	2.24
40	688531	日联科技	1,933,230.53	2.18
41	688543	国科军工	1,925,152.19	2.17
42	688510	航亚科技	1,889,378.76	2.13
43	688108	赛诺医疗	1,884,095.26	2.12
44	688277	天智航	1,809,225.97	2.04
45	688523	航天环宇	1,789,522.95	2.02
46	688003	天准科技	1,781,393.12	2.01

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	688048	长光华芯	8,224,377.06	9.28

2	688167	炬光科技	6,956,016.03	7.84
3	688270	ST臻镭	6,137,398.53	6.92
4	688195	腾景科技	6,065,456.60	6.84
5	688627	精智达	5,920,714.53	6.68
6	688205	德科立	5,710,655.51	6.44
7	688766	普冉股份	5,104,961.68	5.76
8	688519	南亚新材	4,177,013.81	4.71
9	688630	芯碁微装	3,763,190.79	4.24
10	688102	斯瑞新材	3,515,510.71	3.96
11	688025	杰普特	3,437,076.66	3.88
12	688388	嘉元科技	3,345,001.97	3.77
13	688372	伟测科技	2,986,062.81	3.37
14	688503	聚和材料	2,954,364.04	3.33
15	688668	鼎通科技	2,894,942.11	3.26
16	688158	优刻得	2,760,881.14	3.11
17	688362	甬矽电子	2,463,544.64	2.78
18	688127	蓝特光学	2,424,177.47	2.73
19	688031	星环科技	2,411,923.85	2.72
20	688585	上纬新材	2,264,417.46	2.55
21	688800	瑞可达	2,228,172.33	2.51
22	688652	京仪装备	2,191,504.98	2.47
23	688559	海目星	2,132,781.87	2.41
24	688717	艾罗能源	2,130,446.52	2.40
25	688403	汇成股份	2,076,304.00	2.34
26	688531	日联科技	2,032,441.63	2.29
27	688131	皓元医药	1,900,421.25	2.14
28	688068	热景生物	1,878,509.71	2.12
29	688262	国芯科技	1,843,035.45	2.08
30	688239	航宇科技	1,820,773.08	2.05
31	688700	东威科技	1,802,924.88	2.03
32	688523	航天环宇	1,799,971.95	2.03

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	310,331,790.91
卖出股票收入（成交）总额	261,046,853.78

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

汇成股份：2026年5月15日，中国证券监督管理委员会安徽监管局对合肥新汇成微电子股份有限公司采取出具警示函的监管措施。2026年5月15日，上海证券交易所对合肥新汇成微电子股份有限公司给予通报批评的处分。

本基金为ETF联接基金，对标的指数成份股及其备选成份股的投资，主要采取复制法，跟踪的标的指数为上证科创板200指数，以上股票为指数成份股。以上股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	114,642.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,642.89

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
东财 上证 科创2 00ET F联接 A	957	45,612.88	0.00	0.00%	43,651,529.51	100.00%
东财 上证 科创2 00ET F联接 C	981	24,549.93	0.00	0.00%	24,083,478.06	100.00%
合计	1,881	36,010.11	0.00	0.00%	67,735,007.57	100.00%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	东财上证科创200E	-	-

持有本基金	TF联接A		
	东财上证科创200E		
	TF联接C	-	-
	合计	-	-

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	东财上证科创200E	0
	TF联接A	
	东财上证科创200E	0
	TF联接C	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东财上证科创200E	0
	TF联接A	
	东财上证科创200E	0
	TF联接C	
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财上证科创200ETF联接A	东财上证科创200ETF联接C
基金合同生效日(2026年01月27日)基金份额总额	199,946,818.20	123,947,255.91
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	15,393,844.72	22,072,225.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	171,689,133.41	121,936,002.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	43,651,529.51	24,083,478.06

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人：无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	
平安证券	4	571,170,354.00	100.00%	111,894.95	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
 - (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
 - (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

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	东财上证科创板200指数型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定网站及报刊	2026-01-28
2	东财基金管理有限公司关于	证监会规定网站及报刊	2026-01-29

	更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告		
3	东财上证科创板200指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-02
4	东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-14
5	东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
6	东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
7	东财基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	证监会规定网站及报刊	2026-03-31
8	东财上证科创板200指数型证券投资基金2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
9	东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告	证监会规定网站及报刊	2026-05-13
10	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-10
11	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书	证监会规定网站	2026-06-10
12	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	证监会规定网站	2026-06-10
13	东财上证科创板200交易型	证监会规定网站	2026-06-10

	开放式指数证券投资基金联接基金基金合同		
14	东财基金管理有限公司关于东财上证科创板200指数型证券投资基金转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告	证监会规定网站及报刊	2026-06-10
15	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
16	东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书更新	证监会规定网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2026年6月11日起，东财上证科创板200指数型证券投资基金转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金，详见基金管理人发布的《东财基金管理有限公司关于东财上证科创板200指数型证券投资基金转型为东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告》及相关法律文件。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予东财上证科创板200指数型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 三、《东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

四、法律意见书

五、基金管理人业务资格批件、营业执照

六、基金托管人业务资格批件、营业执照

七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日