

博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:博道基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
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	9
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	67
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	70
§9 开放式基金份额变动	70
§10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
10.4 基金投资策略的改变	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	71
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	71
10.8 其他重大事件	73
§11 备查文件目录	74
11.1 备查文件目录	74
11.2 存放地点	74
11.3 查阅方式	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	博道上证科创板综合指数增强	
基金主代码	023901	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月29日	
基金管理人	博道基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	266,639,481.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博道上证科创板综合指数增强A	博道上证科创板综合指数增强C
下属分级基金的交易代码	023901	023902
报告期末下属分级基金的份额总额	69,003,121.09份	197,636,359.96份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，通过量化选股模型构建股票组合，在控制跟踪误差的基础上力求获得超越标的指数的业绩表现。首先，综合考虑股票的市值、盈利情况、风险情况等因素，筛选出满足一定基本面要求的股票，构建备选股票池。然后，综合考虑股票的估值、成长、盈利能力、营运质量、事件性因素、价量特征等因子，对股票进行综合评价后，挑选符合一定标准的股票用于构建股票组合。最后，利用投资组合优化工具，在控制跟踪偏离过大风险的同时，最大化组合的预期收益，以此来确定个股的投资权重。其中，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资

	产的80%。股票组合构建完成后，本基金管理人将对组合运作绩效持续跟踪，根据市场的变化及时调整投资组合。本基金的股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，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		博道基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶文瑛	罗琦
	联系电话	021-80226288	020-66338888
	电子邮箱	yewy@bdfund.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-085-2888	95575
传真		021-80226289	020-87553363-6847
注册地址		上海市虹口区东大名路1158号301室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200122	510627
法定代表人		莫泰山	林传辉

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.bdfund.cn

基金中期报告置备地点	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室
------------	---------------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	博道基金管理有限公司	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心1601室

§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01日-2026年06月30日)	
	博道上证科创板综合指数增强A	博道上证科创板综合指数增强C
本期已实现收益	29,077,253.89	118,081,462.93
本期利润	47,120,598.00	175,229,372.71
加权平均基金份额本期利润	0.8067	0.6767
本期加权平均净值利润率	48.35%	41.53%
本期基金份额净值增长率	53.60%	53.29%
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	63,504,738.30	180,087,375.83
期末可供分配基金份额利润	0.9203	0.9112
期末基金资产净值	150,706,215.04	429,622,933.34
期末基金份额净值	2.1840	2.1738
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	118.40%	117.38%

注：

1、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，计入费用后的实际收

益水平要低于所列数字；

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

3.2 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

博道上证科创板综合指数增强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	53.81%	2.21%	52.44%	2.24%	1.37%	-0.03%
过去六个月	53.60%	2.05%	50.92%	2.11%	2.68%	-0.06%
过去一年	107.86%	1.80%	98.19%	1.86%	9.67%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	118.40%	1.69%	109.73%	1.76%	8.67%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

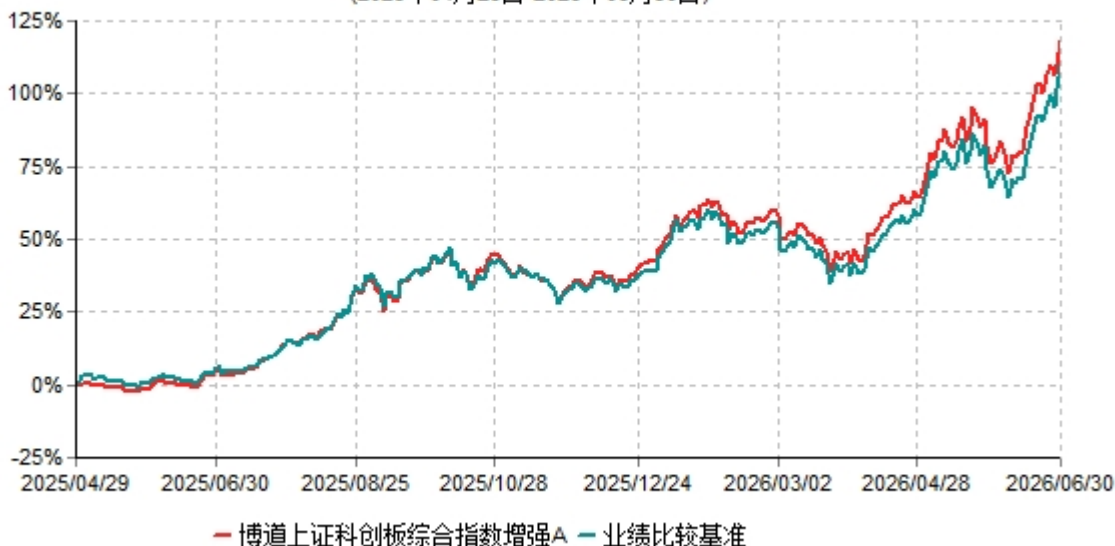
博道上证科创板综合指数增强C

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	53.67%	2.21%	52.44%	2.24%	1.23%	-0.03%
过去六个月	53.29%	2.05%	50.92%	2.11%	2.37%	-0.06%
过去一年	107.03%	1.80%	98.19%	1.86%	8.84%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	117.38%	1.69%	109.73%	1.76%	7.65%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准请见"2.2 基金产品说明"，每日进行再平衡过程。

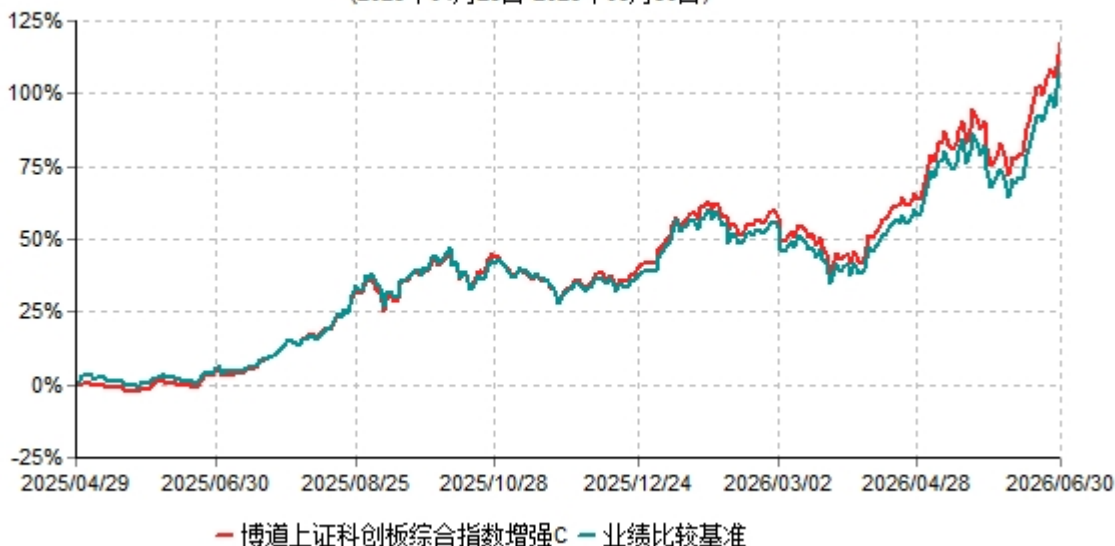
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

博道上证科创板综合指数增强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
(2025年04月29日-2026年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2025年4月29日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

博道上证科创板综合指数增强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
(2025年04月29日-2026年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2025年4月29日，建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§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

博道基金管理有限公司由中国证监会证监许可〔2017〕822号文核准设立，于2017年6月12日成立，注册地在中国上海，注册资本为1亿元人民币。公司具备公开募集证券投资基金管理、私募资产管理等业务资格。公司管理的首只公募基金于2018年8月10日成立。截至报告期末，公司旗下管理的公募基金涵盖股票型基金、混合型基金、债券型基金等多种类型。

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		
杨梦	博道中证500增强、博道沪深300增强、博道远航混合、博道伍佰智航、博道成长智航股票、博道中证1000指数增强、博道大盘成长股票、博道沪深300指数量化增强、博道中证A500指数增强、博道中证800指数增强、博道上证科创板综合指数增强、博道中证全指指数增强、博道星航混合、博道衍和债券的基金经理、量化投资总监兼量化投资部总经理	2025-04-29	-	15年	杨梦女士，中国籍，经济学硕士。2011年7月至2014年6月担任农银汇理基金管理有限公司量化研究员，2014年6月至2014年11月担任华泰资产管理有限公司量化研究员，2014年11月至2017年7月担任上海博道投资管理有限公司投资经理助理、投资经理。2017年8月加入博道基金管理有限公司。具有基金从业资格。

注：

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定；
- 3、在本报告截止日至报告批准送出日之间，增聘刘兆阳担任本基金基金经理，详见基金管理人于2026年7月10日发布的《博道基金管理有限公司关于博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理变更公告》。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生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

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，本公司管理的所有投资组合参与交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况共发生4次，经检查未发现异常；本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，受美以伊冲突、油价波动和流动性预期变化影响，全球市场剧烈震荡，风险偏好先抑后扬。A股主要宽基指数多数上涨，但结构分化明显，上证指数上涨3.16%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。风格上，中信成长风格指数上涨36.71%，中信周期风格指数下跌4.31%，中信消费风格指数下跌

13.46%，中信金融风格指数下跌12.58%，中信稳定风格指数下跌6.36%。行业层面，电子、通信、建材涨幅居前，分别上涨85.49%、74.54%、43.70%，消费者服务、综合金融、综合跌幅较大，分别下跌31.88%、29.59%、25.09%。

从因子层面来看，表征景气度的基本面因子表现较好，价值类因子创下历史最大回撤，AI量价因子表现差异较大，部分因子策略捕捉到了较强的动量效应，部分因子策略偏量价反转逻辑。极致的抱团风格下，量化策略的环境并不友好。研究层面，博道量化团队继续围绕双均衡框架进行升级，以及推动组合优化与风控模块持续迭代。

报告期间，本基金维持配置上证科创综指多因子选股增强模型。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金份额净值及业绩表现请见"3.1 主要会计数据和财务指标"及"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"部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，主要宽基指数的预期盈利增速仍处于抬升阶段，预计市场重心将继续围绕基本面和产业趋势展开；对于量化产品而言，需重点关注三四季度动量反转的可能性并做好防范应对。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有竞争力的超额收益。

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，估值委员会成员由营运分管领导、督察长、基金事务部负责人、投委会主席、研究部负责人、投资运营部负责人、监察稽核部负责人及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的投资研究相关人员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司估值委员会审批。

估值委员会会定期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。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

无。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，博道基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对博道基金管理有限公司编制和披露的博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金2026年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	上年度末 2025年12月31日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	21,098,354.28	20,890,239.47
结算备付金		116,073.34	115,281.28
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	560,707,363.55	497,335,237.57
其中：股票投资		532,196,944.66	470,573,374.78
基金投资		-	-
债券投资		28,510,418.89	26,761,862.79
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		7,215,458.97	1,763,338.87
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		589,137,250.14	520,104,097.19
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		-	6,298,811.56
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,152,348.74	12,607,653.49
应付管理人报酬		348,203.07	358,083.29
应付托管费		43,525.39	44,760.43
应付销售服务费		130,352.43	156,036.39

应付投资顾问费		-	-
应交税费		885.53	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	132,786.60	130,000.00
负债合计		8,808,101.76	19,595,345.16
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	266,639,481.05	352,813,619.07
未分配利润	6.4.7.7	313,689,667.33	147,695,132.96
净资产合计		580,329,148.38	500,508,752.03
负债和净资产总计		589,137,250.14	520,104,097.19

注：本报告期末基金份额净值请见"3.1 主要会计数据和财务指标"；基金份额请见"2.1 基金基本情况"。

6.2 利润表

会计主体：博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01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01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月29日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		225,612,365.32	47,516,524.12
1.利息收入		17,228.15	230,689.45
其中：存款利息收入	6.4.7.8	17,228.10	166,405.79
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		0.05	64,283.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”		150,277,772.22	27,095,389.50

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.9	148,876,491.62	23,128,326.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	164,831.68	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.11	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,236,448.92	3,967,063.32
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	75,191,253.89	20,190,445.17
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15	126,111.06	-
减：二、营业总支出		3,262,394.61	1,977,561.48
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,065,847.95	1,234,497.95
2.托管费	6.4.10.2.2	258,231.04	154,312.23
3.销售服务费		840,459.89	554,393.77
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		18,261.45	-
其中：卖出回购金融资产 支出		18,261.45	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		251.12	-
8.其他费用	6.4.7.16	79,343.16	34,357.53
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		222,349,970.71	45,538,962.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		222,349,970.71	45,538,962.64

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		222,349,970.71	45,538,962.64

6.3 净资产变动表

会计主体：博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01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	352,813,619.07	147,695,132.96	500,508,752.03
二、本期期初净资产	352,813,619.07	147,695,132.96	500,508,752.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-86,174,138.02	165,994,534.37	79,820,396.35
（一）、综合收益总额	-	222,349,970.71	222,349,970.71
（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）	-86,174,138.02	-56,355,436.34	-142,529,574.36
其中：1.基金申购款	386,101,142.52	261,044,454.49	647,145,597.01
2.基金赎回款	-472,275,280.54	-317,399,890.83	-789,675,171.37
（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	266,639,481.05	313,689,667.33	580,329,148.38
项 目	上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日）至2025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	909,111,778.94	-	909,111,778.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	45,538,962.64	45,538,962.64
（一）、综合收益总额	-	45,538,962.64	45,538,962.64
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	909,111,778.94	45,538,962.64	954,650,741.58

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：

莫泰山

张丽

严娅

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

博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]582号《关于准予博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由博道基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币908,836,875.35元，业经容诚会计师事务所（特殊普通合伙）容诚验字[2025]200Z0060号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年4月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为909,111,778.94份基金份额，其中认购资金利息折合274,903.59份基金份额。本基金的基金管理人为博道基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》和《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。相关费率的设置及费率水平在招募说明书或相关公告中列示。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含科创板、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、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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）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、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、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。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：本基金股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为上证科创板综合指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《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》、本基金合同和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年01月01日至2026年06月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年01月01日至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第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》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	597,285.92
等于：本金	597,053.85
加：应计利息	232.07
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	20,501,068.36
等于：本金	20,500,404.78
加：应计利息	663.58
减：坏账准备	-
合计	21,098,354.28

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	436,530,098.65	-	532,196,944.66	95,666,846.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	28,349,218.26	157,969.02	28,510,418.89	3,231.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	28,349,218.26	157,969.02	28,510,418.89	3,231.61
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		464,879,316.91	157,969.02	560,707,363.55	95,670,077.62

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	19,835.79
预提费用-信息披露费	59,507.37

其他应付	53,443.44
合计	132,786.60

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 博道上证科创板综合指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (博道上证科创板综合指数增强A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,649,938.43	48,649,938.43
本期申购	102,153,027.47	102,153,027.47
本期赎回（以“-”号填列）	-81,799,844.81	-81,799,844.81
本期末	69,003,121.09	69,003,121.09

6.4.7.6.2 博道上证科创板综合指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (博道上证科创板综合指数增强C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,163,680.64	304,163,680.64
本期申购	283,948,115.05	283,948,115.05
本期赎回（以“-”号填列）	-390,475,435.73	-390,475,435.73
本期末	197,636,359.96	197,636,359.96

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 博道上证科创板综合指数增强A

单位：人民币元

项目 (博道上证科创板综合	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
------------------	-------	-------	---------

指数增强A)			
上年度末	20,792,278.91	-265,459.51	20,526,819.40
本期期初	20,792,278.91	-265,459.51	20,526,819.40
本期利润	29,077,253.89	18,043,344.11	47,120,598.00
本期基金份额交易产生的变动数	13,635,205.50	420,471.05	14,055,676.55
其中：基金申购款	68,938,297.18	5,583,013.39	74,521,310.57
基金赎回款	-55,303,091.68	-5,162,542.34	-60,465,634.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,504,738.30	18,198,355.65	81,703,093.95

6.4.7.7.2 博道上证科创板综合指数增强C

单位：人民币元

项目 (博道上证科创板综合 指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	128,808,568.89	-1,640,255.33	127,168,313.56
本期期初	128,808,568.89	-1,640,255.33	127,168,313.56
本期利润	118,081,462.93	57,147,909.78	175,229,372.71
本期基金份额交易产生的变动数	-66,802,655.99	-3,608,456.90	-70,411,112.89
其中：基金申购款	175,621,300.25	10,901,843.67	186,523,143.92
基金赎回款	-242,423,956.24	-14,510,300.57	-256,934,256.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	180,087,375.83	51,899,197.55	231,986,573.38

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	6,497.73
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	9,938.31
结算备付金利息收入	792.06
其他	-
合计	17,228.10

6.4.7.9 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01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	3,050,818,006.76
减：卖出股票成本总额	2,898,876,947.88
减：交易费用	3,064,567.26
买卖股票差价收入	148,876,491.62

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	169,032.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,201.03
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	164,831.68

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	35,601,743.58

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,210,417.97
减：应计利息总额	395,477.58
减：交易费用	49.06
买卖债券差价收入	-4,201.03

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,236,448.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,236,448.92

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	75,191,253.89
——股票投资	75,192,224.92
——债券投资	-971.03
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	75,191,253.89

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	125,291.11
转换费收入	819.95
合计	126,111.06

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产；
 - 2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。
- 具体以本基金最新的招募说明书为准。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
合计	79,343.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项
无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
博道基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	3,060,864,950.29	51.74%	861,285,590.49	35.31%

6.4.10.1.2 权证交易
无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
广发证券 股份有限 公司	49,031,774.00	98.99%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
广发证券 股份有限 公司	216,502,000.00	100.00%	138,311,000.00	14.57%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
广发证券股份有限公司	599,908.58	51.75%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	168,869.86	35.32%	-	-

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，为本基金证券交易提供支持服务。上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,065,847.95	1,234,497.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	878,558.39	543,347.92
应支付基金管理人的净管理费	1,187,289.56	691,150.03

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至2026年06月30日	2025年04月29日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	258,231.04	154,312.23

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道上证科创板综合指数增强A	博道上证科创板综合指数增强C	合计
博道基金管理有限公司	-	58,835.23	58,835.23
广发证券股份有限公司	-	114,195.01	114,195.01
合计	-	173,030.24	173,030.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博道上证科创板综合指数增强A	博道上证科创板综合指数增强C	合计
博道基金管理有限公司	-	81.58	81.58
广发证券股份有限公司	-	146,470.44	146,470.44

公司			
合计	-	146,552.02	146,552.02

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，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。其计算公式为：日基金销售服务费＝前一日C类基金份额对应的基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

博道上证科创板综合指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01 日至2026年06 月30日	上年度可比期间 2025年04月29日（基金 合同生效日）至2025年0 6月30日
基金合同生效日（2025年04月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,893,826.91	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,893,826.91	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.19%	-

博道上证科创板综合指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01 日至2026年06 月30日	上年度可比期间 2025年04月29日（基金 合同生效日）至2025年0
----	---------------------------------------	--

	月30日	6月30日
基金合同生效日（2025年04月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	725,110.58	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	725,110.58	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.37%	-

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务；
- 3、如果本报告期间发生认购、申购、转换入、红利再投、赎回、转换出等业务，本基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.4.2 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为50~100万份。（上年度末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为50~100万份。）

6.4.10.5 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01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月29日（基金合同生效日） 至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	9,140,376.29	1,995.19	20,113,735.73	5,441.04

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026年01月01日至2026年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	网下发行	1,031	16,248.56

6.4.10.7 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

无。

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
688008	澜起科技	2026-05-29	6个月	询价转让限售	250.08	276.82	30,000	7,502,400.00	8,304,600.00	-
688082	盛美上海	2026-02-09	6个月	询价转让限售	160.00	399.91	20,000	3,200,000.00	7,998,200.00	-
688200	华峰测控	2026-06-02	6个月	询价转让限售	262.82	469.54	7,400	1,944,900.00	3,474,596.00	-

688234	天岳先进	2026-04-22	6个月	询价转让限售	82.32	155.45	17,000	1,399,440.00	2,642,650.00	-
688047	龙芯中科	2026-06-17	6个月	询价转让限售	120.00	139.86	16,000	1,920,000.00	2,237,760.00	-
688248	南网科技	2026-01-16	6个月	询价转让限售	42.89	66.89	20,000	857,800.00	1,337,800.00	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	科创板打新限售	104.66	768.89	1,598	167,246.68	1,228,686.22	-
688380	中微半导体	2026-03-04	6个月	询价转让限售	43.35	61.01	20,000	867,000.00	1,220,200.00	-
688205	德科立	2026-01-19	6个月	询价转让限售	126.35	199.52	6,000	758,100.00	1,197,120.00	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	科创板打新限售	22.68	42.16	4,888	110,859.84	206,078.08	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	126	10,316.88	199,625.58	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,598	15,133.06	112,083.72	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打	19.68	141.49	745	14,661.60	105,410.05	-

				新限售						
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	主板打新限售	17.70	84.32	329	5,823.30	27,741.28	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	主板打新限售	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	主板打新限售	11.18	17.59	506	5,657.08	8,900.54	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	主板打新限售	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	主板打新限售	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	主板打新限售	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	主板打新限售	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026-06-24	1个月内（含）	配债未上市	100.00	100.00	300	29,999.87	30,000.40	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日	停牌原	期末估	复牌日	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-------	--------	--------	----

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
688 072	拓 荆 科 技	202 6-0 6-2 9	重 大 事 项	879. 53	202 6-07 -13	890. 99	8,203	3,653,715.6 0	7,214,784.5 9	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 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政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系，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人广发证券开立于交通银行股份有限公司的托管账户，其他存款存放于广发证券和财通证券股份有限公司，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，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.01%(2025年12月31日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为6.53%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2026年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为543,101,332.37元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

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、结算备付金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06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	21,098,354.28	-	-	-	-	-	21,098,354.28
结算备付金	116,073.34	-	-	-	-	-	116,073.34
交易性金融资产	-	-	28,480,418.49	-	30,000.40	532,196,944.66	560,707,363.55
应收申购款	-	-	-	-	-	7,215,458.97	7,215,458.97
资产总计	21,214,427.62	-	28,480,418.49	-	30,000.40	539,412,403.63	589,137,250.14
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,152,348.74	8,152,348.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,203.07	348,203.07
应付托管费	-	-	-	-	-	43,525.39	43,525.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	130,352.43	130,352.43
应交税费	-	-	-	-	-	885.53	885.53
其他负债	-	-	-	-	-	132,786.60	132,786.60
负债总计	-	-	-	-	-	8,808,101.76	8,808,101.76
利率敏感度缺口	21,214,427.62	-	28,480,418.49	-	30,000.40	530,604,301.87	580,329,148.38
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	20,890,239.47	-	-	-	-	-	20,890,239.47
结算备付金	115,281.28	-	-	-	-	-	115,281.28
交易性	-	-	26,761,862.79	-	-	470,573,374.78	497,335,237.57

金融资产							
应收申购款	-	-	-	-	-	1,763,338.87	1,763,338.87
资产总计	21,005,520.75	-	26,761,862.79	-	-	472,336,713.65	520,104,097.19
负债							
卖出回购金融资产款	6,298,811.56	-	-	-	-	-	6,298,811.56
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,607,653.49	12,607,653.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	358,083.29	358,083.29
应付托管费	-	-	-	-	-	44,760.43	44,760.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	156,036.39	156,036.39
其他负债	-	-	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	6,298,811.56	-	-	-	-	13,296,533.60	19,595,345.16
利率敏感度缺口	14,706,709.19	-	26,761,862.79	-	-	459,040,180.05	500,508,752.03

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为4.91%(2025年12月31日：5.35%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

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。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金主要投资于股票，股票资产在基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券比例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。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，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06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	532,196,944.66	91.71	470,573,374.78	94.02
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	532,196,944.66	91.71	470,573,374.78	94.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证科创板综合指数收益率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	上年度末 2025年12月31日
	1.上证科创板综合指数收益率上升5%	29,462,784.63	25,447,861.61
	2.上证科创板综合指数收益率下降5%	-29,462,784.63	-25,447,861.61

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	494,344,312.93	443,160,360.76
第二层次	35,725,203.48	33,396,322.23
第三层次	30,637,847.14	20,778,554.58
合计	560,707,363.55	497,335,237.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期

间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	532,196,944.66	90.33
	其中：股票	532,196,944.66	90.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,510,418.89	4.84
	其中：债券	28,510,418.89	4.84
	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	21,214,427.62	3.60
8	其他各项资产	7,215,458.97	1.22

9	合计	589,137,250.14	100.00
---	----	----------------	--------

注：银行存款和结算备付金合计余额包含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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	363,315,097.56	62.61
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	83,256,323.97	14.35
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	7,228,968.01	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	937,213.00	0.16
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	454,737,602.54	78.36

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,490,571.00	0.43
C	制造业	63,257,755.12	10.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	743,990.00	0.13
E	建筑业	153,732.00	0.03
F	批发和零售业	1,719,153.00	0.30
G	交通运输、仓储和邮政业	462,923.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,083,764.00	0.19
J	金融业	3,976,938.00	0.69
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	68,856.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,117,451.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	1,320,975.00	0.23
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	63,234.00	0.01
	合计	77,459,342.12	13.35

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	27,954	44,602,004.70	7.69
2	688041	海光信息	98,630	36,522,689.00	6.29
3	688012	中微公司	42,010	19,681,685.00	3.39
4	688981	中芯国际	114,019	18,108,497.58	3.12
5	688525	佰维存储	23,381	11,567,282.13	1.99
6	688008	澜起科技	40,164	11,454,423.60	1.97
7	688082	盛美上海	21,200	8,516,600.00	1.47
8	688766	普冉股份	9,800	7,512,680.00	1.29
9	688072	拓荆科技	8,203	7,214,784.59	1.24
10	688347	华虹宏力	20,290	6,823,527.00	1.18
11	688110	东芯股份	32,078	6,534,288.60	1.13
12	688183	生益电子	41,058	5,436,079.20	0.94
13	688361	中科飞测	12,200	5,246,000.00	0.90
14	688409	富创精密	16,200	4,961,250.00	0.85
15	688503	聚和材料	34,798	4,617,694.60	0.80
16	688536	思瑞浦	12,000	4,369,080.00	0.75
17	688531	日联科技	24,202	4,304,083.68	0.74
18	688120	华海清科	13,294	4,283,060.92	0.74
19	688593	新相微	109,000	4,242,280.00	0.73
20	688025	杰普特	9,000	4,230,000.00	0.73
21	688200	华峰测控	8,400	3,999,696.00	0.69
22	688146	中船特气	11,400	3,989,886.00	0.69
23	688249	晶合集成	67,046	3,957,725.38	0.68
24	688378	奥来德	63,349	3,927,638.00	0.68
25	688195	腾景科技	20,200	3,890,116.00	0.67

26	688390	固德威	35,600	3,862,956.00	0.67
27	688111	金山办公	17,984	3,831,491.20	0.66
28	688279	峰昭科技	16,800	3,770,592.00	0.65
29	688717	艾罗能源	43,600	3,600,052.00	0.62
30	688266	泽璟制药	29,800	3,476,468.00	0.60
31	688353	华盛锂电	29,800	3,458,886.00	0.60
32	688720	艾森股份	34,200	3,454,200.00	0.60
33	688235	百济神州	13,549	3,449,710.89	0.59
34	688668	鼎通科技	9,200	3,434,360.00	0.59
35	688362	甬矽电子	34,600	3,335,440.00	0.57
36	688388	嘉元科技	74,320	3,270,080.00	0.56
37	688508	芯朋微	35,057	3,258,898.72	0.56
38	688385	复旦微电	45,107	3,215,678.03	0.55
39	688400	凌云光	47,602	3,151,252.40	0.54
40	688002	睿创微纳	20,271	3,135,720.99	0.54
41	688518	联赢激光	101,332	3,131,158.80	0.54
42	688239	航宇科技	52,000	3,111,160.00	0.54
43	688221	前沿生物	135,675	3,039,120.00	0.52
44	688159	有方科技	67,400	2,991,886.00	0.52
45	688358	祥生医疗	93,388	2,854,871.16	0.49
46	688486	龙迅股份	44,623	2,837,130.34	0.49
47	688510	航亚科技	117,200	2,798,736.00	0.48
48	688697	纽威数控	204,760	2,782,688.40	0.48
49	688579	地纬智能	364,198	2,764,262.82	0.48
50	688396	华润微	28,140	2,745,057.00	0.47
51	688252	天德钰	114,200	2,740,800.00	0.47
52	688799	华纳药厂	60,580	2,718,224.60	0.47
53	688627	精智达	3,800	2,717,000.00	0.47
54	688516	奥特维	47,200	2,708,808.00	0.47
55	688234	天岳先进	17,000	2,642,650.00	0.46
56	688001	华兴源创	30,800	2,639,560.00	0.45

57	688018	乐鑫科技	18,880	2,415,129.60	0.42
58	688013	天臣医疗	95,821	2,363,904.07	0.41
59	688127	蓝特光学	24,200	2,361,920.00	0.41
60	688639	华恒生物	145,000	2,340,300.00	0.40
61	688571	杭华股份	261,817	2,290,898.75	0.39
62	688047	龙芯中科	16,000	2,237,760.00	0.39
63	688618	三旺通信	70,229	2,160,946.33	0.37
64	688558	国盛智科	62,600	2,057,036.00	0.35
65	688380	中微半导	32,581	2,049,413.71	0.35
66	688153	唯捷创芯	63,094	2,026,579.28	0.35
67	688108	赛诺医疗	102,178	1,893,358.34	0.33
68	688698	伟创电气	35,600	1,867,220.00	0.32
69	688182	灿勤科技	42,493	1,830,173.51	0.32
70	688301	奕瑞科技	14,720	1,825,280.00	0.31
71	688328	深科达	18,400	1,760,880.00	0.30
72	688208	道通科技	69,600	1,753,224.00	0.30
73	688027	国盾量子	3,400	1,713,634.00	0.30
74	688523	航天环宇	32,600	1,708,240.00	0.29
75	688148	芳源股份	197,061	1,690,783.38	0.29
76	688135	利扬芯片	39,932	1,680,338.56	0.29
77	688371	菲沃泰	42,800	1,668,772.00	0.29
78	688199	久日新材	48,190	1,664,000.70	0.29
79	688248	南网科技	24,600	1,656,028.00	0.29
80	688010	福光股份	33,688	1,638,247.44	0.28
81	688689	银河微电	25,200	1,630,944.00	0.28
82	688169	石头科技	15,905	1,510,497.85	0.26
83	688205	德科立	7,400	1,488,586.00	0.26
84	688123	聚辰股份	6,976	1,483,097.60	0.26
85	688293	奥浦迈	35,000	1,459,150.00	0.25
86	688419	耐科装备	18,045	1,419,239.25	0.24
87	688787	海天瑞声	10,420	1,400,969.00	0.24

88	688372	伟测科技	7,497	1,394,442.00	0.24
89	688309	恒誉环保	22,856	1,391,473.28	0.24
90	688109	品茗科技	17,840	1,350,488.00	0.23
91	688636	智明达	35,641	1,291,273.43	0.22
92	688586	江航装备	105,814	1,236,965.66	0.21
93	688802	沐曦股份	1,598	1,228,686.22	0.21
94	688095	福昕软件	20,600	1,224,258.00	0.21
95	688236	春立医疗	81,800	1,182,828.00	0.20
96	688577	浙海德曼	25,240	1,156,749.20	0.20
97	688028	沃尔德	7,400	1,153,438.00	0.20
98	688648	中邮科技	31,000	1,133,050.00	0.20
99	688222	成都先导	35,000	1,123,850.00	0.19
100	688103	国力电子	14,700	1,093,827.00	0.19
101	688800	瑞可达	11,320	1,086,380.40	0.19
102	688275	万润新能	8,400	1,071,420.00	0.18
103	688247	宣泰医药	138,200	1,039,264.00	0.18
104	688677	海泰新光	10,200	1,031,526.00	0.18
105	688716	中研股份	32,800	1,030,904.00	0.18
106	688261	东微半导	9,800	1,028,314.00	0.18
107	688401	路维光电	10,633	1,020,555.34	0.18
108	688468	科美诊断	176,234	1,002,771.46	0.17
109	688775	影石创新	7,200	998,280.00	0.17
110	688410	山外山	69,273	994,760.28	0.17
111	688656	浩欧博	10,200	987,054.00	0.17
112	688480	赛恩斯	10,700	937,213.00	0.16
113	688360	德马科技	51,600	923,640.00	0.16
114	688652	京仪装备	4,600	920,782.00	0.16
115	688608	恒玄科技	5,200	869,388.00	0.15
116	688073	毕得医药	15,665	843,090.30	0.15
117	688433	华曙高科	9,800	838,880.00	0.14
118	688286	敏芯股份	7,272	836,789.04	0.14

119	688045	必易微	9,807	792,209.46	0.14
120	688615	合合信息	7,000	791,700.00	0.14
121	688475	萤石网络	28,793	787,488.55	0.14
122	688700	东威科技	8,600	768,840.00	0.13
123	688539	高华科技	24,000	765,120.00	0.13
124	688519	南亚新材	1,800	684,072.00	0.12
125	688631	莱斯信息	14,200	666,122.00	0.11
126	688181	八亿时空	10,600	663,560.00	0.11
127	688630	芯碁微装	1,200	659,268.00	0.11
128	688006	杭可科技	18,000	657,900.00	0.11
129	688591	泰凌微	18,800	646,344.00	0.11
130	688357	建龙微纳	21,600	636,552.00	0.11
131	688230	芯导科技	7,303	575,549.43	0.10
132	688484	南芯科技	9,942	561,623.58	0.10
133	688049	炬芯科技	11,754	551,380.14	0.10
134	688257	新锐股份	5,400	550,260.00	0.09
135	688676	金盘科技	6,400	541,696.00	0.09
136	688678	福立旺	22,400	541,408.00	0.09
137	688037	芯源微	1,200	526,860.00	0.09
138	688628	优利德	5,200	514,488.00	0.09
139	688513	苑东生物	11,400	501,144.00	0.09
140	688035	德邦科技	5,000	459,000.00	0.08
141	688699	明微电子	5,600	458,920.00	0.08
142	688271	联影医疗	4,509	456,446.07	0.08
143	688386	泛亚微透	5,000	449,200.00	0.08
144	688313	仕佳光子	2,400	443,160.00	0.08
145	688315	诺禾致源	35,121	439,363.71	0.08
146	688099	晶晨股份	4,000	411,600.00	0.07
147	688059	华锐精密	2,000	399,420.00	0.07
148	688166	博瑞医药	11,400	399,114.00	0.07
149	688080	映翰通	8,942	386,741.50	0.07

150	688288	鸿泉技术	21,228	377,221.56	0.07
151	688196	卓越新能	10,245	367,795.50	0.06
152	688122	西部超导	5,800	364,298.00	0.06
153	688162	巨一科技	14,729	348,193.56	0.06
154	688231	隆达股份	9,320	342,323.60	0.06
155	688687	凯因科技	20,882	340,585.42	0.06
156	688633	星球石墨	11,400	338,922.00	0.06
157	688629	华丰科技	1,600	300,016.00	0.05
158	688530	欧莱新材	2,982	288,955.80	0.05
159	688501	青达环保	14,865	285,408.00	0.05
160	688613	奥精医疗	20,200	285,022.00	0.05
161	688709	成都华微	6,200	236,158.00	0.04
162	688273	麦澜德	6,000	232,440.00	0.04
163	688161	威高骨科	10,800	226,584.00	0.04
164	688711	宏微科技	4,800	218,160.00	0.04
165	688088	虹软科技	6,101	216,890.55	0.04
166	688626	翔宇医疗	4,800	212,448.00	0.04
167	688009	中国通号	42,800	203,728.00	0.04
168	688048	长光华芯	400	200,800.00	0.03
169	688778	厦钨新能	3,675	199,920.00	0.03
170	688213	思特威	1,800	192,726.00	0.03
171	688215	瑞晟智能	4,780	191,964.80	0.03
172	688657	浩辰软件	5,200	186,004.00	0.03
173	688151	华强科技	11,800	175,466.00	0.03
174	688411	海博思创	600	174,720.00	0.03
175	688318	财富趋势	2,400	171,144.00	0.03
176	688819	天能股份	7,600	168,720.00	0.03
177	688757	胜科纳米	2,400	160,080.00	0.03
178	688545	兴福电子	1,200	159,672.00	0.03
179	688617	惠泰医疗	800	145,248.00	0.03
180	688563	航材股份	2,600	133,198.00	0.02

181	688425	铁建重工	33,000	132,660.00	0.02
182	688283	坤恒顺维	3,400	112,574.00	0.02
183	688750	金天钛业	6,600	109,758.00	0.02
184	688428	诺诚健华	3,800	108,186.00	0.02
185	688535	华海诚科	576	107,712.00	0.02
186	688459	哈铁科技	12,800	106,624.00	0.02
187	688375	国博电子	1,000	104,300.00	0.02
188	688570	天玛智控	7,200	102,456.00	0.02
189	688300	联瑞新材	400	97,760.00	0.02
190	688295	中复神鹰	1,600	96,864.00	0.02
191	688758	赛分科技	4,400	96,844.00	0.02
192	688065	凯赛生物	2,000	95,700.00	0.02
193	688297	中无人机	2,200	91,410.00	0.02
194	688334	西高院	4,800	87,072.00	0.02
195	688233	神工股份	400	85,768.00	0.01
196	688090	瑞松科技	800	85,160.00	0.01
197	688350	富淼科技	2,400	82,872.00	0.01
198	688187	时代电气	1,200	82,392.00	0.01
199	688085	三友医疗	6,400	76,608.00	0.01
200	688439	振华风光	1,600	73,920.00	0.01
201	688548	广钢气体	1,400	72,940.00	0.01
202	688308	欧科亿	400	72,724.00	0.01
203	688662	富信科技	400	67,200.00	0.01
204	688621	阳光诺和	1,200	65,892.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002716	湖南白银	338,800	2,740,892.00	0.47

2	001359	平安电工	21,100	2,642,775.00	0.46
3	603986	兆易创新	3,000	2,445,000.00	0.42
4	301369	联动科技	9,480	2,322,600.00	0.40
5	002969	嘉美包装	158,000	2,224,640.00	0.38
6	300121	阳谷华泰	172,500	2,173,500.00	0.37
7	001309	德明利	2,200	2,074,380.00	0.36
8	300604	长川科技	5,500	1,877,810.00	0.32
9	300308	中际旭创	1,300	1,651,000.00	0.28
10	301086	鸿富瀚	7,860	1,644,940.80	0.28
11	301150	中一科技	24,500	1,546,195.00	0.27
12	300475	香农芯创	4,900	1,470,000.00	0.25
13	002415	海康威视	41,500	1,419,300.00	0.24
14	300416	苏试试验	69,400	1,414,372.00	0.24
15	600030	中信证券	49,200	1,413,516.00	0.24
16	000534	万泽股份	50,100	1,370,736.00	0.24
17	301377	鼎泰高科	2,400	1,322,160.00	0.23
18	300870	欧陆通	3,660	1,265,225.40	0.22
19	002049	紫光国微	13,000	1,153,750.00	0.20
20	603083	剑桥科技	4,300	1,095,941.00	0.19
21	300164	通源石油	135,700	1,085,600.00	0.19
22	000811	冰轮环境	18,600	1,045,692.00	0.18
23	601138	工业富联	13,900	1,002,885.00	0.17
24	002636	金安国纪	7,900	947,763.00	0.16
25	002643	万润股份	44,000	921,800.00	0.16
26	300223	北京君正	3,600	896,040.00	0.15
27	300986	志特新材	51,700	886,655.00	0.15
28	002645	华宏科技	31,140	856,661.40	0.15
29	300102	乾照光电	32,800	854,112.00	0.15
30	300857	协创数据	2,440	829,356.00	0.14
31	002851	麦格米特	4,900	819,182.00	0.14
32	300803	指南针	8,100	742,527.00	0.13

33	002328	新朋股份	101,000	741,340.00	0.13
34	001339	智微智能	7,220	738,461.60	0.13
35	603516	淳中科技	5,400	726,894.00	0.13
36	603228	景旺电子	10,000	724,100.00	0.12
37	002938	鹏鼎控股	6,400	674,432.00	0.12
38	300602	飞荣达	12,900	660,480.00	0.11
39	600999	招商证券	30,400	641,440.00	0.11
40	300073	当升科技	13,300	638,932.00	0.11
41	300774	倍杰特	53,300	572,975.00	0.10
42	603067	振华股份	12,300	569,367.00	0.10
43	000657	中钨高新	5,900	564,748.00	0.10
44	301021	英诺激光	4,400	536,360.00	0.09
45	603588	高能环境	27,900	535,680.00	0.09
46	300129	泰胜风能	58,400	499,320.00	0.09
47	301308	江波龙	700	492,660.00	0.08
48	000426	兴业银锡	14,300	471,328.00	0.08
49	600460	士兰微	8,500	464,610.00	0.08
50	603061	金海通	900	451,998.00	0.08
51	300760	迈瑞医疗	3,100	421,073.00	0.07
52	300004	南风股份	39,400	397,940.00	0.07
53	002384	东山精密	1,400	367,290.00	0.06
54	002134	天津普林	11,400	346,788.00	0.06
55	301626	苏州天脉	900	345,564.00	0.06
56	301222	浙江恒威	10,900	326,564.00	0.06
57	003018	金富科技	4,200	320,166.00	0.06
58	603217	元利科技	14,100	316,263.00	0.05
59	300638	广和通	17,000	314,670.00	0.05
60	300254	仟源医药	39,100	313,191.00	0.05
61	300988	津荣天宇	18,600	290,718.00	0.05
62	603993	洛阳钼业	16,400	287,820.00	0.05
63	601136	首创证券	19,700	274,815.00	0.05

64	002947	恒铭达	3,600	273,780.00	0.05
65	000949	新乡化纤	42,500	269,450.00	0.05
66	300277	汽轮科技	17,400	261,696.00	0.05
67	601059	信达证券	16,100	260,659.00	0.04
68	002475	立讯精密	3,700	260,480.00	0.04
69	600590	泰豪科技	24,800	250,480.00	0.04
70	300758	七彩化学	19,900	249,745.00	0.04
71	300461	田中精机	6,700	248,168.00	0.04
72	000969	安泰科技	10,000	245,400.00	0.04
73	300590	移为通信	16,600	238,210.00	0.04
74	300905	宝丽迪	4,700	237,820.00	0.04
75	603019	中科曙光	2,200	235,906.00	0.04
76	300458	全志科技	5,900	232,814.00	0.04
77	000001	平安银行	23,000	231,150.00	0.04
78	603897	长城科技	7,100	230,466.00	0.04
79	300215	电科院	32,700	215,493.00	0.04
80	688781	视涯科技	4,888	206,078.08	0.04
81	605117	德业股份	1,900	201,742.00	0.03
82	002402	和而泰	7,800	201,474.00	0.03
83	688808	联讯仪器	126	199,625.58	0.03
84	002922	伊戈尔	6,000	196,800.00	0.03
85	300275	梅安森	24,300	195,129.00	0.03
86	300715	凯伦股份	11,800	194,228.00	0.03
87	002156	通富微电	2,500	189,675.00	0.03
88	301120	新特电气	11,300	187,919.00	0.03
89	301127	武汉天源	9,000	186,480.00	0.03
90	002916	深南电路	400	183,160.00	0.03
91	002600	领益智造	10,500	182,070.00	0.03
92	002990	盛视科技	2,300	181,700.00	0.03
93	603186	华正新材	800	180,240.00	0.03
94	301196	唯科科技	1,400	175,588.00	0.03

95	002787	华源控股	5,400	173,880.00	0.03
96	300456	赛微电子	4,000	169,880.00	0.03
97	300033	同花顺	700	168,700.00	0.03
98	002859	洁美科技	1,500	164,265.00	0.03
99	000506	招金黄金	13,800	161,736.00	0.03
100	301016	雷尔伟	11,300	157,861.00	0.03
101	601061	中信金属	14,500	156,165.00	0.03
102	001360	南矿集团	8,700	153,903.00	0.03
103	600176	中国巨石	2,100	153,048.00	0.03
104	300666	江丰电子	400	147,440.00	0.03
105	000919	金陵药业	25,200	146,916.00	0.03
106	601083	锦江航运	14,500	144,130.00	0.02
107	300752	隆利科技	10,600	142,782.00	0.02
108	605196	华通线缆	5,400	140,940.00	0.02
109	601022	宁波远洋	18,000	137,160.00	0.02
110	605318	法狮龙	1,200	135,432.00	0.02
111	302132	中航成飞	2,300	134,136.00	0.02
112	301217	铜冠铜箔	800	132,056.00	0.02
113	600925	苏能股份	32,100	128,721.00	0.02
114	301238	瑞泰新材	5,100	124,440.00	0.02
115	300139	晓程科技	3,400	124,270.00	0.02
116	300606	金太阳	2,900	123,424.00	0.02
117	300450	先导智能	3,000	122,160.00	0.02
118	002918	蒙娜丽莎	11,900	119,595.00	0.02
119	601033	永兴股份	8,900	119,260.00	0.02
120	002534	西子洁能	6,400	118,720.00	0.02
121	600918	中泰证券	22,200	118,104.00	0.02
122	001286	陕西能源	11,600	117,624.00	0.02
123	301262	海看股份	6,400	115,008.00	0.02
124	301339	通行宝	11,200	114,576.00	0.02
125	301289	国缆检测	2,400	112,824.00	0.02

126	688818	电科蓝天	1,598	112,083.72	0.02
127	603395	红四方	5,400	108,000.00	0.02
128	600995	南网储能	8,700	107,010.00	0.02
129	003020	立方制药	7,200	106,632.00	0.02
130	002064	华峰化学	11,200	106,288.00	0.02
131	688820	盛合晶微	745	105,410.05	0.02
132	600796	钱江生化	22,500	104,400.00	0.02
133	301508	中机认检	4,500	104,130.00	0.02
134	301360	荣旗科技	1,500	102,735.00	0.02
135	002975	博杰股份	700	99,400.00	0.02
136	001208	华菱线缆	7,000	99,330.00	0.02
137	002265	建设工业	5,700	99,180.00	0.02
138	600720	中交设计	20,500	98,810.00	0.02
139	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02
140	600726	华电能源	13,200	93,984.00	0.02
141	002648	卫星化学	4,000	93,960.00	0.02
142	603153	上海建科	7,400	93,832.00	0.02
143	300843	胜蓝股份	600	93,750.00	0.02
144	001328	登康口腔	3,600	93,276.00	0.02
145	301175	中科环保	18,800	93,060.00	0.02
146	000019	深粮控股	16,400	92,988.00	0.02
147	002060	广东建工	30,400	92,112.00	0.02
148	603088	宁波精达	9,100	91,546.00	0.02
149	300153	科泰电源	3,900	88,218.00	0.02
150	603933	睿能科技	3,900	87,945.00	0.02
151	002395	双象股份	7,300	87,308.00	0.02
152	002297	博云新材	3,000	86,970.00	0.01
153	301551	无线传媒	4,400	86,812.00	0.01
154	002028	思源电气	500	86,500.00	0.01
155	600301	华锡有色	1,400	85,848.00	0.01
156	300286	安科瑞	3,500	84,525.00	0.01

157	301081	严牌股份	6,100	83,448.00	0.01
158	000880	潍柴重机	3,600	82,836.00	0.01
159	300446	航天智造	4,900	82,467.00	0.01
160	601121	宝地矿业	14,200	80,088.00	0.01
161	002498	汉缆股份	11,600	79,112.00	0.01
162	603257	中国瑞林	1,000	77,990.00	0.01
163	001338	永顺泰	9,200	77,188.00	0.01
164	603920	世运电路	1,600	76,864.00	0.01
165	603082	北自科技	1,800	75,672.00	0.01
166	002222	福晶科技	800	73,824.00	0.01
167	001391	国货航	17,500	71,225.00	0.01
168	001258	立新能源	10,100	69,892.00	0.01
169	603373	安邦护卫	1,900	68,856.00	0.01
170	300413	芒果超媒	4,500	65,835.00	0.01
171	600938	中国海油	2,400	65,160.00	0.01
172	000791	甘肃能源	8,500	64,600.00	0.01
173	600816	建元信托	26,300	64,172.00	0.01
174	300567	精测电子	200	63,520.00	0.01
175	300401	花园生物	2,900	63,481.00	0.01
176	000833	粤桂股份	2,700	63,234.00	0.01
177	301316	慧博云通	1,600	63,008.00	0.01
178	001236	弘业期货	8,900	61,855.00	0.01
179	000628	高新发展	1,300	61,620.00	0.01
180	002096	易普力	7,000	61,460.00	0.01
181	603115	海星股份	500	61,235.00	0.01
182	601156	东航物流	3,500	56,420.00	0.01
183	000088	盐田港	13,200	53,988.00	0.01
184	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
185	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
186	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
187	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01

188	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.01
189	603459	红板科技	329	27,741.28	0.00
190	301165	锐捷网络	300	24,135.00	0.00
191	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
192	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
193	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
194	601112	振石股份	506	8,900.54	0.00
195	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
196	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
197	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
198	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	35,641,155.84	7.12
2	688256	寒武纪	31,986,583.21	6.39
3	688041	海光信息	31,621,741.57	6.32
4	688012	中微公司	25,497,995.47	5.09
5	688183	生益电子	24,572,506.70	4.91
6	688766	普冉股份	24,084,629.99	4.81
7	688525	佰维存储	22,783,084.21	4.55
8	688981	中芯国际	21,067,186.02	4.21
9	688668	鼎通科技	20,104,459.13	4.02
10	688375	国博电子	19,130,283.11	3.82
11	688630	芯碁微装	17,536,548.64	3.50
12	688249	晶合集成	17,194,704.86	3.44
13	688361	中科飞测	16,998,755.05	3.40

14	688362	甬矽电子	16,641,688.72	3.32
15	688111	金山办公	16,264,889.76	3.25
16	688037	芯源微	15,552,382.41	3.11
17	688385	复旦微电	15,328,097.48	3.06
18	688372	伟测科技	14,505,508.01	2.90
19	688025	杰普特	13,994,439.43	2.80
20	688663	新风光	13,952,264.94	2.79
21	688181	八亿时空	13,586,833.32	2.71
22	688516	奥特维	13,392,168.58	2.68
23	688347	华虹宏力	13,138,245.75	2.62
24	688072	拓荆科技	12,986,318.46	2.59
25	688146	中船特气	12,832,173.33	2.56
26	688313	仕佳光子	12,830,785.27	2.56
27	688127	蓝特光学	12,218,098.49	2.44
28	688082	盛美上海	12,185,103.84	2.43
29	688390	固德威	11,620,036.61	2.32
30	688258	卓易信息	11,562,746.67	2.31
31	688689	银河微电	11,492,197.34	2.30
32	688036	传音控股	11,416,285.41	2.28
33	688280	精进电动	11,276,673.84	2.25
34	688358	祥生医疗	11,199,050.37	2.24
35	688301	奕瑞科技	11,076,573.26	2.21
36	688396	华润微	11,029,578.76	2.20
37	688048	长光华芯	10,982,017.13	2.19
38	688013	天臣医疗	10,978,501.32	2.19
39	688230	芯导科技	10,824,219.96	2.16
40	688498	源杰科技	10,744,802.53	2.15
41	688778	厦钨新能	10,707,338.48	2.14
42	688371	菲沃泰	10,503,697.53	2.10
43	688433	华曙高科	10,266,801.43	2.05
44	688580	伟思医疗	10,246,183.40	2.05

45	688627	精智达	10,214,519.83	2.04
46	688059	华锐精密	10,188,005.85	2.04
47	688257	新锐股份	10,137,211.51	2.03
48	688536	思瑞浦	10,084,218.27	2.01
49	688551	科威尔	10,043,614.13	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	42,907,054.46	8.57
2	688041	海光信息	41,630,305.07	8.32
3	688256	寒武纪	39,557,599.45	7.90
4	688766	普冉股份	25,221,945.34	5.04
5	688012	中微公司	23,472,287.54	4.69
6	688183	生益电子	21,554,927.13	4.31
7	688111	金山办公	20,303,766.95	4.06
8	688668	鼎通科技	20,234,908.06	4.04
9	688362	甬矽电子	19,773,981.91	3.95
10	688375	国博电子	19,200,233.73	3.84
11	688630	芯碁微装	18,866,084.07	3.77
12	688525	佰维存储	18,812,271.47	3.76
13	688385	复旦微电	18,369,545.41	3.67
14	688663	新风光	17,835,296.51	3.56
15	688372	伟测科技	17,253,991.00	3.45
16	688981	中芯国际	17,083,054.00	3.41
17	688025	杰普特	16,466,076.78	3.29
18	688778	厦钨新能	16,332,426.43	3.26

19	688361	中科飞测	15,738,517.47	3.14
20	688300	联瑞新材	15,675,765.84	3.13
21	688127	蓝特光学	15,621,803.83	3.12
22	688551	科威尔	15,551,936.43	3.11
23	688249	晶合集成	15,474,674.98	3.09
24	688390	固德威	15,437,878.07	3.08
25	688037	芯源微	15,224,385.60	3.04
26	688689	银河微电	14,743,566.63	2.95
27	688048	长光华芯	13,917,598.80	2.78
28	688322	奥比中光	13,601,572.94	2.72
29	688181	八亿时空	13,542,030.68	2.71
30	688498	源杰科技	13,268,070.93	2.65
31	688313	仕佳光子	13,243,797.76	2.65
32	688396	华润微	13,061,152.86	2.61
33	688258	卓易信息	13,014,221.14	2.60
34	688347	华虹宏力	12,961,738.86	2.59
35	688678	福立旺	12,843,338.22	2.57
36	688006	杭可科技	12,787,876.84	2.55
37	688072	拓荆科技	12,692,439.44	2.54
38	688519	南亚新材	12,526,365.31	2.50
39	688036	传音控股	12,281,720.34	2.45
40	688580	伟思医疗	12,105,285.21	2.42
41	688257	新锐股份	12,044,227.71	2.41
42	688521	芯原股份	11,853,075.90	2.37
43	688182	灿勤科技	11,834,117.70	2.36
44	688618	三旺通信	11,788,472.19	2.36
45	688610	埃科光电	11,679,634.79	2.33
46	688531	日联科技	11,654,335.83	2.33
47	688281	华秦科技	11,631,544.30	2.32
48	688099	晶晨股份	11,353,870.84	2.27
49	688002	睿创微纳	11,241,003.09	2.25

50	688319	欧林生物	11,028,825.94	2.20
51	688280	精进电动	11,018,894.06	2.20
52	688146	中船特气	10,944,067.65	2.19
53	688059	华锐精密	10,905,096.48	2.18
54	688371	菲沃泰	10,773,490.36	2.15
55	688271	联影医疗	10,646,916.23	2.13
56	688661	和林微纳	10,608,639.31	2.12
57	688786	悦安新材	10,501,343.13	2.10
58	688516	奥特维	10,166,884.46	2.03
59	688082	盛美上海	10,154,229.53	2.03
60	688627	精智达	10,143,774.17	2.03
61	688162	巨一科技	10,068,235.88	2.01
62	688772	珠海冠宇	10,010,897.77	2.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,885,308,292.84
卖出股票收入（成交）总额	3,050,818,006.76

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	28,480,418.49	4.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	30,000.40	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,510,418.89	4.91

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26国债01	242,000	24,356,862.41	4.20
2	019835	26国债09	22,000	2,203,620.66	0.38
3	019792	25国债19	19,000	1,919,935.42	0.33
4	118071	华峰转债	300	30,000.40	0.01

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
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的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	7,215,458.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,215,458.97

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	688008	澜起科技	8,304,600.00	1.43	询价转让限售
2	688082	盛美上海	7,998,200.00	1.38	询价转让限售
3	688072	拓荆科技	7,214,784.59	1.24	停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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
博道 上证 科创 板综 合指 数增 强A	4,005	17,229.24	6,215,184.83	9.01%	62,787,936.26	90.99%
博道 上证 科创 板综 合指 数增 强C	20,449	9,664.84	12,187,982.85	6.17%	185,448,377.11	93.83%
合计	24,015	11,103.04	18,403,167.68	6.90%	248,236,313.37	93.10%

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	博道上证科创板综合指数增强A	1,472,015.75	2.13%
	博道上证科创板综合指数增强C	16,521.80	0.01%

	合计	1,488,537.55	0.56%
--	----	--------------	-------

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	博道上证科创板综合指数增强A	50~100
	博道上证科创板综合指数增强C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	博道上证科创板综合指数增强A	0~10
	博道上证科创板综合指数增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	博道上证科创板综合指数增强A	博道上证科创板综合指数增强C
基金合同生效日(2025年04月29日)基金份额总额	92,548,029.59	816,563,749.35
本报告期期初基金份额总额	48,649,938.43	304,163,680.64
本报告期基金总申购份额	102,153,027.47	283,948,115.05
减：本报告期基金总赎回份额	81,799,844.81	390,475,435.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	69,003,121.09	197,636,359.96

注：

- 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
- 2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	股票交易		应支付该券商的佣金		备 注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
财通证券	2	2,855,473,380.19	48.26%	559,420.74	48.25%	-
广发证券	2	3,060,864,950.29	51.74%	599,908.58	51.75%	-

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
财通证券	500,521.00	1.01%	-	-	-	-	-	-
广发证券	49,031,774.00	98.99%	216,502,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：

- 1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；
- 2、基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：
 - （1）经营行为稳健规范，财务状况良好；
 - （2）具备良好的合规风控能力，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
 - （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
 - （4）具有较强的全方位金融服务及研究能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。
- 3、基金交易单元的选择程序如下：
 - （1）本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用提供证券交易服务的证券公司；
 - （2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订相关协议。
- 4、报告期内，本基金已严格遵守证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
2	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金2025年第四季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金（更新）招募说明书（2026年第1号）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27
4	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27
5	博道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）	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	博道基金管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
7	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金2025年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	博道基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
9	博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金2026年第一季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
10	2025年度博道基金管理有限公司以股东身份（通过公募	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30

	基金持股）参与股东大会投票信息披露		
11	博道基金管理有限公司关于旗下基金投资基金托管人承销证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
12	博道基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-03

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内博道上证科创板综合指数增强型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站（www.bdfund.cn）查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博道基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-085-2888（免长途话费）。

博道基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日