

天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年02月26日起至2025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	6
§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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	68
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	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.12 投资组合报告附注	68
§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 期末上市基金前十名持有人	70

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
§9 开放式基金份额变动	71
§10 重大事件揭示	71
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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
10.8 其他重大事件	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘上证科创板综合ETF
场内简称	科创综指ETF天弘
基金主代码	589860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025年02月26日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	810,224,000.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025年03月05日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金可以选择采取完全复制策略或抽样复制策略构建基金股票投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金的投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率

风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金跟踪标的指数的表现，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。
--------	--

2.3 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	天弘基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名 童建林 联系电话 022-83310208 电子邮箱 service@thfund.com.cn	杨军智 010-60834299 yjz@citics.com
客户服务电话	95046	010-60836588
传真	022-83865564	010-60834004
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦2 3层	广东省深圳市福田区中心三 路8号卓越时代广场（二期） 北座
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16 层	北京市朝阳区亮马桥路48号 中信证券大厦5层
邮政编码	300203	100125
法定代表人	黄辰立	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年02月26日（基金合同生效日） - 2025年06月30日)
本期已实现收益	-19,328,631.50
本期利润	-24,770,345.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0261
本期加权平均净值利润率	-2.77%
本期基金份额净值增长率	-3.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	-24,596,105.25
期末可供分配基金份额利润	-0.0304
期末基金资产净值	785,627,894.75
期末基金份额净值	0.9696
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-3.04%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、本基金合同于2025年02月26日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

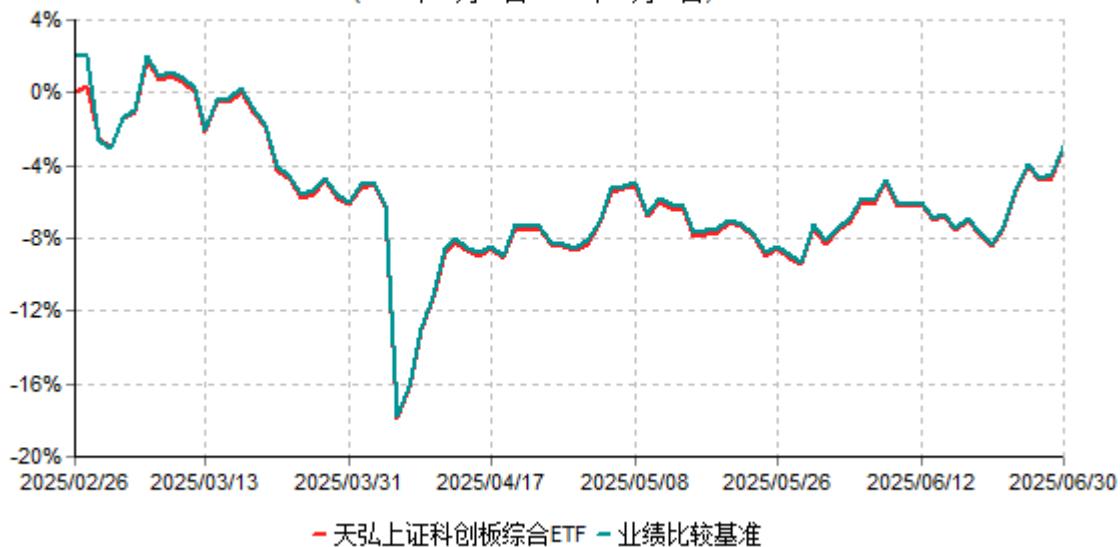
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.75%	1.01%	5.71%	1.01%	0.04%	0.00%
过去三个月	3.29%	1.99%	3.27%	1.99%	0.02%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-3.04%	1.82%	-2.89%	1.88%	-0.15%	-0.06%

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

天弘上证科创板综合ETF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02月26日-2025年06月30日)



注：1、本基金合同于2025年02月26日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。
2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2025年02月26日至2025年08月25日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2025年06月30日，公司共管理运作223只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		
张戈	本基金基金经理	2025年02月	-	12年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不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

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，未发生不公平交易和利益输送。

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，本基金管理人以降低跟踪误差为操作目标，按照基金合同约定采用完全复制的策略进行投资运作。日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金持仓结构变化以及打新收益的小幅影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年06月30日，本基金份额净值为0.9696元，本报告期份额净值增长率-3.04%，同期业绩比较基准增长率-2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年A股市场在宏观经济温和复苏与政策持续发力的背景下，呈现出中枢震荡上移的态势。尽管短期面临关税扰动和内需修复强度的挑战，但管理人对中期市场持积极观点，结构性机会将成为市场主导力量。财政与货币政策的“双宽松”格局为市场奠定基础——专项债额度扩容，3000亿“以旧换新”特别国债刺激消费；同时央行呵护市场，流动性环境整体充裕。出口方面，上半年“抢出口”效应支撑韧性，但下半年关税滞后影响可能显现，需关注中美关税停战后的贸易修复情况以及美国“大而美”法案对需求的潜在提振。

资金流向的积极变化或将进一步强化市场动能。外资态度正从“去中国化”转向“再中国化”，巴克莱、瑞银等机构二季度新进科技等细分领域龙头，对科技硬资产和核心企业的配置兴趣显著提升。内资方面，“资产荒”背景下理财资金加速转向权益市场，预计公募与险资增量规模将继续上升。资本市场政策周期亦提供支撑，回购增持再贷款等工具为A股注入流动性。

科技革命正在成为持续3-5年的投资主线，AI与高端制造领域正从技术突破转向产业落地。政策明确支持AI大模型商业化，北京、上海等地加速建设算力中心，国产化进程推动芯片企业受益；人形机器人产业链迎来爆发，特斯拉Optimus量产在即，行星滚柱丝杠、六维力传感器等核心部件需求激增。半导体国产替代逻辑强化，创新药凭借研发优势加速出海，BD合作与关税豁免预期打开空间。

消费与周期板块则提供配置选择。消费电子、新能源汽车在政策补贴下显现拐点，龙头企业深度绑定新品迭代与智驾升级趋势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委

员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（基金经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，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的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	13,109,253.75
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	776,442,151.30
其中：股票投资		776,442,151.30
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		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	81,877.50

资产总计		789,633,282.55
负债和净资产	附注号	本期末 2025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		3,847,534.33
应付赎回款		-
应付管理人报酬		99,276.35
应付托管费		33,092.12
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	25,485.00
负债合计		4,005,387.80
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	810,224,000.00
未分配利润	6.4.7.8	-24,596,105.25
净资产合计		785,627,894.75
负债和净资产总计		789,633,282.55

注：1.报告截止日2025年06月30日，基金份额净值0.9696元，基金份额总额810,224,000.00份。

2.本财务报表的实际编制期间为2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年06月30日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年02月26日(基金合同 生效日)至2025年06月30 日
一、营业收入		-24,089,887.00
1.利息收入		183,681.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	183,681.43
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)		-19,027,232.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-21,782,527.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	2,755,295.38
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号 填列)	6.4.7.16	-5,441,714.14
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	195,377.99
减：二、营业总支出		680,458.64
1.管理人报酬		448,978.71
2.托管费		149,659.57
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.19	81,820.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,770,345.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,770,345.64
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-24,770,345.64

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025年02月26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	1,526,224,000.00	-	1,526,224,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-716,000,000.00	-24,596,105.25	-740,596,105.25
(一)、综合收益总额	-	-24,770,345.64	-24,770,345.64
(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）	-716,000,000.00	174,240.39	-715,825,759.61

其中：1.基金申购款	824,000,000.00	-26,548,979.69	797,451,020.31
2.基金赎回款	-1,540,000,000.00	26,723,220.08	-1,513,276,779.92
(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	810,224,000.00	-24,596,105.25	785,627,894.75

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：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系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]129号《关于准予天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司自2025年02月17日至2025年02月21日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第80007653_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2025年02月26日正式生效。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。

设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,526,224,000.00元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币95,945.25元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币1,526,319,945.25元，折合1,526,224,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2025]52号文审核同意，本基金1,526,224,000.00份基金份额于2025年03月05日在上交所挂牌交易。

本基金以标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、金融衍生工具（国债期货、股指期货、股票期权等）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）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和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：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构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。

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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年06月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况以及2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 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；
- 该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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有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。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息、股利收入和利息费用）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

（3）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（4）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

本基金收益分配方式为现金分红；

本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

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性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协

(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所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

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公

告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b)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，股息的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对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。

d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
	2025年06月30日
活期存款	2,534,168.98
等于： 本金	2,533,580.97
加： 应计利息	588.01

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	10,575,084.77
等于：本金	10,574,974.40
加：应计利息	110.37
减：坏账准备	-
合计	13,109,253.75

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	781,883,865.44	-	776,442,151.30	-5,441,714.14
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	781,883,865.44	-	776,442,151.30	-5,441,714.14

注：1、股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	81,877.50
合计	81,877.50

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025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	25,485.00
合计	25,485.00

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,526,224,000.00	1,526,224,000.00
本期申购	824,000,000.00	824,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,540,000,000.00	-1,540,000,000.00
本期末	810,224,000.00	810,224,000.00

注：本基金合同于2025年02月26日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,526,224,000.00份基金份额，其中认购资金利息折合0.00份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初(基金合同生 效日)	-	-	-
本期利润	-19,328,631.50	-5,441,714.14	-24,770,345.64
本期基金份额交易产 生的变动数	808,224.61	-633,984.22	174,240.39
其中：基金申购款	-2,645,961.61	-23,903,018.08	-26,548,979.69
基金赎回款	3,454,186.22	23,269,033.86	26,723,220.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,520,406.89	-6,075,698.36	-24,596,105.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
活期存款利息收入	74,581.27
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,154.91
结算备付金利息收入	-
其他	95,945.25
合计	183,681.43

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年0 6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,089,217.38
股票投资收益——赎回差价收入	-20,693,310.28
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	-21,782,527.66

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
卖出股票成交总额	180,561,130.91
减：卖出股票成本总额	181,033,618.42
减：交易费用	616,729.87
买卖股票差价收入	-1,089,217.38

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
赎回基金份额对价总额	1,513,276,779.92
减：现金支付赎回款总额	90,246,274.92
减：赎回股票成本总额	1,443,723,815.28
减：交易费用	-
赎回差价收入	-20,693,310.28

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
股票投资产生的股利收益	2,755,295.38
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	2,755,295.38

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-5,441,714.14
——股票投资	-5,441,714.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-
合计	-5,441,714.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	195,377.99
合计	195,377.99

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年06月30 日
审计费用	25,485.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
ETF登记结算费	55,622.50
开户费	400.00
存托服务费	312.86
合计	81,820.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	448,978.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	185,249.62
应支付基金管理人的净管理费	263,729.09

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务

及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	149,659.57

注:支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末发生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。

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

本基金本报告期末发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日
-------	--------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	78,486,700.00	9.69%
中信证券股份有限公司	2,504,400.00	0.31%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年02月26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
中信证券股份有限公司	2,534,168.98	74,581.27

注：本基金由基金托管人中信证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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
中信建投	603202	天有为	网下申购	1,221	114,163.50

证券股份有限公司					
中信证券股份有限公司	688755	汉邦科技	网下申购	2,023	46,063.71
中信证券股份有限公司	688775	影石创新	网下申购	5,725	270,620.75

注：中信建投证券股份有限公司为托管人的重要关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2025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
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	科创板打新限售	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
603049	中策橡胶	2025-05-27	6个月	新股锁定	46.50	42.85	367	17,065.50	15,725.95	-
603202	天有为	2025-04-16	6个月	新股锁定	93.50	90.66	123	11,500.50	11,151.18	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月	科创板打新限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-

				售						
6030 14	威高 血净	2025- 05-12	6个 月	新股 锁定	26.50	32.68	205	5,43 2.50	6,69 9.40	-
6032 10	泰鸿 万立	2025- 04-01	6个 月	新股 锁定	8.60	15.61	286	2,45 9.60	4,46 4.46	-
6034 00	华之 杰	2025- 06-12	6个 月	新股 锁定	19.88	43.81	57	1,13 3.16	2,49 7.17	-
6033 82	海阳 科技	2025- 06-05	6个 月	新股 锁定	11.50	22.39	105	1,20 7.50	2,35 0.95	-
6031 20	肯特 催化	2025- 04-09	6个 月	新股 锁定	15.00	33.43	65	975.0 0	2,17 2.95	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股 票 代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
688 313	仕 佳 光 子	202 5-0 6-3 0	重 大 事 项	38.0 5	202 5-07 -11	39.9 8	50,898	1,133,175.8 7	1,936,668.9 0	-

注:本基金截至2025年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末2025年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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和定期存款存放在本基金的托管人中信证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2025年06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%。本期末，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符合法律法规的相关要求。

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交易对手管理制度：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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06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	13,109,253.75	-	-	-	13,109,253.75
交易性金融资产	-	-	-	776,442,151.30	776,442,151.30
其他资产	-	-	-	81,877.50	81,877.50
资产总计	13,109,253.75	-	-	776,524,028.80	789,633,282.55
负债					
应付清算款	-	-	-	3,847,534.33	3,847,534.33
应付管理人报酬	-	-	-	99,276.35	99,276.35
应付托管费	-	-	-	33,092.12	33,092.12
其他负债	-	-	-	25,485.00	25,485.00
负债总计	-	-	-	4,005,387.80	4,005,387.80
利率敏感度缺口	13,109,253.75	-	-	772,518,641.00	785,627,894.75

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2025年06月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪上证科创板综合指数，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。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年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	776,442,151.30	98.83
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	776,442,151.30	98.83

注：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。

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 2025年06月30日
	业绩比较基准上升5%	38,948,116.02
	业绩比较基准下降5%	-38,948,116.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日
第一层次	774,381,292.67
第二层次	1,936,668.90
第三层次	124,189.73
合计	776,442,151.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年06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

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	776,442,151.30	98.33
	其中：股票	776,442,151.30	98.33
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	13,109,253.75	1.66
8	其他各项资产	81,877.50	0.01
9	合计	789,633,282.55	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下一节按行业分类股票投资组合的合计项不含可退替代款估值增值。

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	622,891,525.62	79.29
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	137,907,908.25	17.55
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	13,010,720.01	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	2,507,176.65	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	776,317,330.53	98.81

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	-	-
C	制造业	124,189.73	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,189.73	0.02

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	264,869	37,423,341.01	4.76
2	688256	寒武纪	47,570	28,613,355.00	3.64

3	688981	中芯国际	226,066	19,932,239.22	2.54
4	688111	金山办公	52,660	14,747,433.00	1.88
5	688506	百利天恒	45,774	13,554,596.88	1.73
6	688012	中微公司	70,900	12,925,070.00	1.65
7	688271	联影医疗	93,460	11,938,580.40	1.52
8	688008	澜起科技	129,935	10,654,670.00	1.36
9	688036	传音控股	129,714	10,338,205.80	1.32
10	688396	华润微	150,597	7,102,154.52	0.90
11	688047	龙芯中科	45,823	6,112,329.97	0.78
12	688223	晶科能源	1,136,148	5,896,608.12	0.75
13	688126	沪硅产业	311,865	5,838,112.80	0.74
14	688082	盛美上海	50,028	5,700,190.32	0.73
15	688521	芯原股份	56,746	5,475,989.00	0.70
16	688303	大全能源	243,746	5,196,664.72	0.66
17	688009	中国通号	978,777	5,030,913.78	0.64
18	688072	拓荆科技	31,611	4,858,926.81	0.62
19	688617	惠泰医疗	16,337	4,852,089.00	0.62
20	689009	九号公司	82,001	4,851,999.17	0.62
21	688608	恒玄科技	13,907	4,839,357.86	0.62
22	688183	生益电子	94,167	4,821,350.40	0.61
23	688578	艾力斯	50,969	4,742,155.76	0.60
24	688213	XD思特威	45,917	4,693,635.74	0.60
25	688249	晶合集成	227,932	4,620,181.64	0.59
26	688169	石头科技	29,181	4,568,285.55	0.58
27	688728	格科微	295,182	4,545,802.80	0.58
28	688120	华海清科	26,624	4,491,468.80	0.57
29	688188	柏楚电子	32,611	4,293,564.26	0.55
30	688187	时代电气	98,568	4,203,925.20	0.54
31	688297	中无人机	76,664	4,093,857.60	0.52
32	688777	中控技术	90,332	4,056,810.12	0.52
33	688375	国博电子	67,578	4,055,355.78	0.52

34	688065	凯赛生物	81,835	3,854,428.50	0.49
35	688472	阿特斯	418,689	3,831,004.35	0.49
36	688469	芯联集成	803,061	3,830,600.97	0.49
37	688122	西部超导	73,673	3,822,155.24	0.49
38	688336	三生国健	69,855	3,788,935.20	0.48
39	688220	翱捷科技	47,659	3,731,699.70	0.47
40	688538	和辉光电	1,570,813	3,675,702.42	0.47
41	688002	睿创微纳	51,725	3,606,267.00	0.46
42	688599	天合光能	247,523	3,596,509.19	0.46
43	688525	佰维存储	52,245	3,521,313.00	0.45
44	688349	三一重能	139,296	3,474,042.24	0.44
45	688099	晶晨股份	47,993	3,407,982.93	0.43
46	688278	特宝生物	46,529	3,355,206.19	0.43
47	688318	财富趋势	28,875	3,318,315.00	0.42
48	688568	中科星图	91,590	3,298,155.90	0.42
49	688027	国盾量子	11,916	3,277,019.16	0.42
50	688266	泽璟制药	30,003	3,225,622.53	0.41
51	688235	百济神州	13,331	3,114,654.84	0.40
52	688192	迪哲医药	52,030	3,111,394.00	0.40
53	688114	华大智造	47,560	3,083,314.80	0.39
54	688582	芯动联科	45,700	3,071,040.00	0.39
55	688819	天能股份	110,219	3,059,679.44	0.39
56	688361	中科飞测	36,275	3,053,992.25	0.39
57	688520	神州细胞	50,492	3,021,946.20	0.38
58	688385	复旦微电	60,948	3,002,907.96	0.38
59	688629	华丰科技	52,203	2,986,011.60	0.38
60	688180	君实生物	87,375	2,969,002.50	0.38
61	688692	达梦数据	13,121	2,924,539.69	0.37
62	688563	航材股份	50,877	2,881,164.51	0.37
63	688234	天岳先进	48,991	2,868,423.05	0.37
64	688702	盛科通信	46,500	2,840,220.00	0.36

65	688019	安集科技	18,616	2,825,908.80	0.36
66	688475	萤石网络	89,543	2,822,395.36	0.36
67	688363	华熙生物	54,720	2,809,872.00	0.36
68	688052	纳芯微	15,514	2,707,037.86	0.34
69	688322	奥比中光	45,734	2,698,763.34	0.34
70	688172	燕东微	136,556	2,684,690.96	0.34
71	688778	厦钨新能	47,944	2,681,028.48	0.34
72	688561	奇安信	77,852	2,645,410.96	0.34
73	688166	博瑞医药	48,178	2,587,640.38	0.33
74	688347	华虹公司	46,844	2,572,204.04	0.33
75	688017	绿的谐波	20,428	2,551,252.92	0.32
76	688018	乐鑫科技	17,256	2,521,101.60	0.32
77	688425	铁建重工	605,317	2,469,693.36	0.31
78	688331	荣昌生物	40,305	2,438,452.50	0.31
79	688037	芯源微	22,506	2,412,643.20	0.31
80	688709	成都华微	72,182	2,363,238.68	0.30
81	688208	道通科技	76,449	2,339,339.40	0.30
82	688200	华峰测控	15,694	2,263,074.80	0.29
83	688088	虹软科技	45,847	2,212,117.75	0.28
84	688387	信科移动	388,315	2,193,979.75	0.28
85	688382	益方生物	66,033	2,167,203.06	0.28
86	688536	思瑞浦	15,364	2,131,294.08	0.27
87	688295	中复神鹰	102,028	2,122,182.40	0.27
88	688100	威胜信息	55,874	2,070,131.70	0.26
89	688248	南网科技	64,394	2,025,835.24	0.26
90	688567	孚能科技	138,773	2,012,208.50	0.26
91	688343	云天励飞	40,286	1,990,934.12	0.25
92	688279	峰岹科技	10,701	1,985,035.50	0.25
93	688301	奕瑞科技	22,422	1,964,391.42	0.25
94	688498	源杰科技	9,955	1,941,225.00	0.25
95	688313	仕佳光子	50,898	1,936,668.90	0.25

96	688484	南芯科技	48,399	1,914,180.45	0.24
97	688116	XD天奈科	41,736	1,910,256.72	0.24
98	688409	富创精密	34,684	1,907,966.84	0.24
99	688281	华秦科技	30,773	1,862,074.23	0.24
100	688772	珠海冠宇	128,935	1,842,481.15	0.23
101	688333	铂力特	30,685	1,827,598.60	0.23
102	688005	容百科技	81,070	1,809,482.40	0.23
103	688798	艾为电子	26,161	1,784,180.20	0.23
104	688502	茂莱光学	6,127	1,762,492.82	0.22
105	688522	纳睿雷达	34,237	1,753,619.14	0.22
106	688676	金盘科技	52,017	1,739,968.65	0.22
107	688146	中船特气	60,135	1,738,502.85	0.22
108	688433	华曙高科	47,091	1,730,594.25	0.22
109	688141	杰华特	50,466	1,644,182.28	0.21
110	688631	莱斯信息	18,336	1,635,571.20	0.21
111	688198	佰仁医疗	15,915	1,634,311.35	0.21
112	688327	云从科技	117,915	1,626,047.85	0.21
113	688147	微导纳米	52,216	1,575,878.88	0.20
114	688432	有研硅	141,485	1,561,994.40	0.20
115	688110	东芯股份	50,431	1,546,214.46	0.20
116	688552	航天南湖	38,224	1,525,519.84	0.19
117	688153	唯捷创芯	49,066	1,521,536.66	0.19
118	688352	颀中科技	134,929	1,515,252.67	0.19
119	688165	埃夫特	59,256	1,512,213.12	0.19
120	688068	热景生物	10,740	1,505,103.60	0.19
121	688548	广钢气体	149,661	1,499,603.22	0.19
122	688050	爱博医疗	21,715	1,495,077.75	0.19
123	688206	概伦电子	49,783	1,447,689.64	0.18
124	688789	XD宏华数	19,789	1,445,388.56	0.18
125	688400	凌云光	52,203	1,439,236.71	0.18
126	688332	中科蓝讯	13,935	1,436,419.80	0.18

127	688032	禾迈股份	14,377	1,435,687.22	0.18
128	688123	聚辰股份	17,532	1,419,916.68	0.18
129	688543	国科军工	23,585	1,419,581.15	0.18
130	688029	南微医学	20,964	1,416,118.20	0.18
131	688097	博众精工	50,536	1,410,459.76	0.18
132	688055	龙腾光电	378,063	1,398,833.10	0.18
133	688362	甬矽电子	46,505	1,384,918.90	0.18
134	688306	均普智能	139,266	1,370,377.44	0.17
135	688686	奥普特	14,161	1,354,074.82	0.17
136	688289	圣湘生物	66,092	1,353,564.16	0.17
137	688584	上海合晶	75,379	1,347,776.52	0.17
138	688006	杭可科技	68,864	1,342,848.00	0.17
139	688700	东威科技	33,772	1,332,305.40	0.17
140	688776	国光电气	12,560	1,324,828.80	0.17
141	688076	诺泰生物	35,487	1,320,826.14	0.17
142	688660	电气风电	151,269	1,313,014.92	0.17
143	688591	泰凌微	27,293	1,307,334.70	0.17
144	688439	振华风光	22,372	1,303,169.00	0.17
145	688549	中巨芯	167,952	1,299,948.48	0.17
146	688107	安路科技	45,811	1,293,702.64	0.16
147	688190	云路股份	13,901	1,286,676.56	0.16
148	688062	迈威生物	45,412	1,284,251.36	0.16
149	688612	威迈斯	48,004	1,283,626.96	0.16
150	688001	华兴源创	50,508	1,276,337.16	0.16
151	688300	联瑞新材	27,183	1,265,368.65	0.16
152	688016	心脉医疗	14,282	1,262,814.44	0.16
153	688182	灿勤科技	45,699	1,259,464.44	0.16
154	688063	派能科技	27,703	1,248,851.24	0.16
155	688739	成大生物	47,261	1,247,690.40	0.16
156	688326	经纬恒润	13,895	1,239,989.80	0.16
157	688380	中微半导	45,734	1,239,391.40	0.16

158	688161	威高骨科	45,694	1,224,142.26	0.16
159	688083	中望软件	18,848	1,213,999.68	0.15
160	688630	芯碁微装	15,261	1,211,265.57	0.15
161	688519	南亚新材	26,823	1,201,670.40	0.15
162	688779	五矿新能	219,182	1,192,350.08	0.15
163	688177	百奥泰	47,375	1,187,217.50	0.15
164	688390	固德威	27,307	1,186,489.15	0.15
165	688127	蓝特光学	46,091	1,184,999.61	0.15
166	688516	奥特维	35,648	1,184,939.52	0.15
167	688158	优刻得	51,551	1,166,083.62	0.15
168	688443	智翔金泰	41,598	1,153,928.52	0.15
169	688408	中信博	24,581	1,147,441.08	0.15
170	688252	天德钰	46,920	1,143,909.60	0.15
171	688150	莱特光电	46,001	1,137,144.72	0.14
172	688131	皓元医药	23,444	1,133,517.40	0.14
173	688800	瑞可达	23,029	1,133,026.80	0.14
174	688048	长光华芯	19,619	1,132,801.06	0.14
175	688128	中国电研	46,236	1,132,782.00	0.14
176	688503	聚和材料	27,361	1,132,471.79	0.14
177	688698	伟创电气	23,822	1,124,398.40	0.14
178	688232	新点软件	37,324	1,121,212.96	0.14
179	688596	正帆科技	33,032	1,120,445.44	0.14
180	688270	臻镭科技	23,999	1,117,393.44	0.14
181	688102	斯瑞新材	82,874	1,117,141.52	0.14
182	688139	海尔生物	36,037	1,113,182.93	0.14
183	688366	XD昊海生	21,680	1,110,883.20	0.14
184	688321	微芯生物	46,640	1,109,099.20	0.14
185	688151	华强科技	39,002	1,099,466.38	0.14
186	688205	德科立	17,310	1,085,163.90	0.14
187	688091	上海谊众	23,150	1,082,957.00	0.14
188	688652	京仪装备	18,668	1,070,049.76	0.14

189	688690	纳微科技	46,153	1,053,672.99	0.13
190	688351	微电生理	53,173	1,047,508.10	0.13
191	688766	普冉股份	16,332	1,032,182.40	0.13
192	688486	龙迅股份	15,372	1,028,079.36	0.13
193	688105	诺唯赞	45,424	1,027,945.12	0.13
194	688262	国芯科技	38,049	1,014,766.83	0.13
195	688570	天玛智控	49,352	1,010,728.96	0.13
196	688586	江航装备	89,594	1,007,932.50	0.13
197	688668	鼎通科技	16,071	1,003,794.66	0.13
198	688523	航天环宇	46,341	996,794.91	0.13
199	688276	百克生物	47,257	992,397.00	0.13
200	688656	浩欧博	7,306	992,154.80	0.13
201	688372	伟测科技	16,397	990,378.80	0.13
202	688003	天准科技	21,562	989,695.80	0.13
203	688403	汇成股份	94,961	986,644.79	0.13
204	688106	金宏气体	54,629	977,312.81	0.12
205	688049	炬芯科技	16,126	975,623.00	0.12
206	688388	嘉元科技	48,576	975,406.08	0.12
207	688138	清溢光电	35,676	970,030.44	0.12
208	688658	悦康药业	50,923	969,573.92	0.12
209	688627	精智达	10,888	958,252.88	0.12
210	688717	艾罗能源	17,743	955,105.69	0.12
211	688531	日联科技	13,270	950,132.00	0.12
212	688575	亚辉龙	65,083	949,560.97	0.12
213	688225	亚信安全	45,704	931,904.56	0.12
214	688696	极米科技	8,113	927,802.68	0.12
215	688093	世华科技	29,628	919,949.40	0.12
216	688392	骄成超声	13,409	913,555.17	0.12
217	688559	海目星	27,573	907,151.70	0.12
218	688209	英集芯	48,922	903,589.34	0.12
219	688685	迈信林	16,070	897,509.50	0.11

220	688368	晶丰明源	10,176	893,758.08	0.11
221	688639	华恒生物	28,128	891,657.60	0.11
222	688691	灿芯股份	13,907	860,287.02	0.11
223	688305	科德数控	15,399	859,418.19	0.11
224	688562	航天软件	45,722	856,830.28	0.11
225	688136	科兴制药	22,284	851,694.48	0.11
226	688593	新相微	52,100	850,793.00	0.11
227	688508	芯朋微	15,219	849,524.58	0.11
228	688515	裕太微	9,265	848,674.00	0.11
229	688167	炬光科技	10,473	845,694.75	0.11
230	688160	步科股份	9,732	834,032.40	0.11
231	688526	科前生物	52,825	823,013.50	0.10
232	688550	瑞联新材	19,050	819,340.50	0.10
233	688513	苑东生物	19,649	806,787.94	0.10
234	688311	盟升电子	18,659	803,269.95	0.10
235	688535	华海诚科	9,329	802,200.71	0.10
236	688788	科思科技	17,404	794,840.68	0.10
237	688185	康希诺	13,299	793,019.37	0.10
238	688320	禾川科技	16,686	789,080.94	0.10
239	688025	杰普特	11,009	787,143.50	0.10
240	688518	联贏激光	38,590	786,850.10	0.10
241	688553	汇宇制药	48,297	786,758.13	0.10
242	688707	振华新材	57,822	783,488.10	0.10
243	688499	利元亨	18,739	779,729.79	0.10
244	688337	普源精电	21,682	773,396.94	0.10
245	688084	晶品特装	8,769	771,672.00	0.10
246	688212	澳华内镜	15,597	764,253.00	0.10
247	688159	有方科技	10,663	764,217.21	0.10
248	688507	索辰科技	10,328	757,352.24	0.10
249	688230	芯导科技	13,623	755,122.89	0.10
250	688007	光峰科技	52,101	753,380.46	0.10

251	688239	航宇科技	21,438	749,901.24	0.10
252	688401	路维光电	21,549	747,750.30	0.10
253	688155	先惠技术	14,484	747,664.08	0.10
254	688348	昱能科技	17,309	743,767.73	0.09
255	688648	中邮科技	15,751	742,974.67	0.09
256	688787	海天瑞声	6,987	741,879.66	0.09
257	688626	翔宇医疗	16,843	741,428.86	0.09
258	688365	光云科技	48,553	738,976.66	0.09
259	688222	成都先导	45,771	735,997.68	0.09
260	688428	诺诚健华	30,059	734,341.37	0.09
261	688319	欧林生物	46,229	723,946.14	0.09
262	688095	福昕软件	10,596	719,574.36	0.09
263	688277	天智航	51,321	713,361.90	0.09
264	688046	药康生物	46,916	705,616.64	0.09
265	688510	航亚科技	29,149	704,822.82	0.09
266	688268	华特气体	13,937	702,006.69	0.09
267	688505	复旦张江	80,747	699,269.02	0.09
268	688697	纽威数控	51,812	691,172.08	0.09
269	688186	广大特材	24,131	690,387.91	0.09
270	688023	安恒信息	12,034	682,809.16	0.09
271	688258	卓易信息	14,035	679,715.05	0.09
272	688219	会通股份	53,917	676,658.35	0.09
273	688195	腾景科技	14,979	674,055.00	0.09
274	688103	国力股份	11,043	671,856.12	0.09
275	688315	诺禾致源	47,367	668,822.04	0.09
276	688196	卓越新能	13,904	668,365.28	0.09
277	688661	和林微纳	16,792	667,817.84	0.09
278	688588	凌志软件	45,719	666,125.83	0.08
279	688488	艾迪药业	47,939	663,955.15	0.08
280	688429	时创能源	45,633	663,503.82	0.08
281	688031	星环科技	14,037	654,545.31	0.08

282	688112	鼎阳科技	17,636	652,002.92	0.08
283	688621	阳光诺和	12,984	647,771.76	0.08
284	688299	长阳科技	32,672	645,925.44	0.08
285	688622	禾信仪器	8,161	642,025.87	0.08
286	688173	希荻微	46,971	641,623.86	0.08
287	688603	天承科技	14,458	639,043.60	0.08
288	688625	呈和科技	20,866	638,082.28	0.08
289	688035	德邦科技	15,686	637,165.32	0.08
290	688389	普门科技	48,866	631,348.72	0.08
291	688168	安博通	8,908	631,309.96	0.08
292	688636	智明达	18,642	629,913.18	0.08
293	688371	菲沃泰	38,036	629,876.16	0.08
294	688799	华纳药厂	15,216	628,420.80	0.08
295	688556	高测股份	86,977	624,494.86	0.08
296	688334	西高院	36,046	619,270.28	0.08
297	688191	智洋创新	26,037	619,159.86	0.08
298	688601	力芯微	15,491	618,865.45	0.08
299	688606	奥泰生物	9,183	617,097.60	0.08
300	688298	东方生物	22,559	616,988.65	0.08
301	688290	景业智能	11,824	616,266.88	0.08
302	688073	毕得医药	10,533	611,124.66	0.08
303	688458	美芯晟	12,917	609,165.72	0.08
304	688590	新致软件	29,647	608,949.38	0.08
305	688581	安杰思	9,386	608,494.38	0.08
306	688566	吉贝尔	22,297	606,255.43	0.08
307	688236	春立医疗	32,586	605,773.74	0.08
308	688577	浙海德曼	12,893	604,552.77	0.08
309	688085	三友医疗	31,407	603,956.61	0.08
310	688233	神工股份	18,943	601,819.11	0.08
311	688383	新益昌	11,826	601,470.36	0.08
312	688381	帝奥微	27,725	600,523.50	0.08

313	688653	康希通信	48,660	596,085.00	0.08
314	688609	九联科技	56,753	594,203.91	0.08
315	688117	圣诺生物	17,625	593,081.25	0.08
316	688275	万润新能	14,611	592,476.05	0.08
317	688293	奥浦迈	13,152	591,971.52	0.08
318	688359	三孚新科	11,220	591,742.80	0.08
319	688767	博拓生物	16,510	591,058.00	0.08
320	688197	首药控股	16,309	590,385.80	0.08
321	688595	芯海科技	15,702	587,097.78	0.07
322	688261	东微半导	14,201	585,791.25	0.07
323	688353	华盛锂电	17,672	584,589.76	0.07
324	688598	金博股份	22,854	580,948.68	0.07
325	688376	美埃科技	15,581	580,703.87	0.07
326	688066	航天宏图	29,462	576,865.96	0.07
327	688176	亚虹医药	64,934	575,964.58	0.07
328	688386	泛亚微透	10,547	572,807.57	0.07
329	688512	慧智微	52,269	570,254.79	0.07
330	688418	震有科技	21,498	568,837.08	0.07
331	688719	爱科赛博	13,375	568,437.50	0.07
332	688267	中触媒	19,624	564,778.72	0.07
333	688075	安旭生物	14,719	564,768.03	0.07
334	688202	美迪西	15,607	560,759.51	0.07
335	688620	安凯微	44,747	559,784.97	0.07
336	688678	福立旺	29,221	556,367.84	0.07
337	688152	麒麟信安	11,826	554,166.36	0.07
338	688611	杭州柯林	16,977	553,959.51	0.07
339	688010	福光股份	17,812	552,884.48	0.07
340	688143	长盈通	14,168	552,552.00	0.07
341	688360	德马科技	29,771	552,252.05	0.07
342	688539	高华科技	20,624	548,598.40	0.07
343	688226	威腾电气	20,950	547,633.00	0.07

344	688677	海泰新光	13,896	542,082.96	0.07
345	688489	三未信安	13,303	541,166.04	0.07
346	688722	同益中	25,303	538,194.81	0.07
347	688087	英科再生	20,901	537,155.70	0.07
348	688302	海创药业	11,475	537,030.00	0.07
349	688119	中钢洛耐	127,956	534,856.08	0.07
350	688247	宣泰医药	51,267	529,588.11	0.07
351	688108	赛诺医疗	47,068	528,102.96	0.07
352	688101	三达膜	37,546	523,391.24	0.07
353	688459	哈铁科技	54,402	522,259.20	0.07
354	688377	迪威尔	21,761	519,435.07	0.07
355	688665	四方光电	11,591	518,349.52	0.07
356	688157	松井股份	12,955	516,645.40	0.07
357	688410	山外山	36,355	516,241.00	0.07
358	688580	伟思医疗	11,100	516,039.00	0.07
359	688259	创耀科技	12,948	513,388.20	0.07
360	688579	山大地纬	45,678	511,136.82	0.07
361	688687	凯因科技	19,019	505,715.21	0.06
362	688356	键凯科技	7,141	504,154.60	0.06
363	688269	凯立新材	15,150	502,980.00	0.06
364	688231	隆达股份	27,796	501,717.80	0.06
365	688716	中研股份	14,092	501,675.20	0.06
366	688602	康鹏科技	58,910	493,665.80	0.06
367	688478	晶升股份	16,108	492,904.80	0.06
368	688280	精进电动	67,652	491,830.04	0.06
369	688399	硕世生物	9,720	490,860.00	0.06
370	688070	纵横股份	10,124	488,989.20	0.06
371	688090	瑞松科技	14,189	487,959.71	0.06
372	688253	英诺特	15,804	487,711.44	0.06
373	688569	铁科轨道	23,624	486,654.40	0.06
374	688533	上声电子	18,062	486,409.66	0.06

375	688282	理工导航	10,192	485,546.88	0.06
376	688181	八亿时空	15,577	484,756.24	0.06
377	688211	中科微至	15,247	482,567.55	0.06
378	688179	阿拉丁	37,763	480,345.36	0.06
379	688325	赛微微电	9,981	479,088.00	0.06
380	688496	清越科技	50,967	473,993.10	0.06
381	688378	奥来德	28,089	473,299.65	0.06
382	688059	华锐精密	10,105	472,509.80	0.06
383	688089	嘉必优	18,690	470,053.50	0.06
384	688246	嘉和美康	15,942	468,535.38	0.06
385	688339	亿华通	21,898	467,522.30	0.06
386	688079	美迪凯	46,491	466,769.64	0.06
387	688135	利扬芯片	22,514	466,264.94	0.06
388	688373	盟科药业	74,224	465,384.48	0.06
389	688228	开普云	7,819	464,292.22	0.06
390	688201	信安世纪	35,715	462,509.25	0.06
391	688286	敏芯股份	6,482	458,212.58	0.06
392	688238	和元生物	73,359	454,825.80	0.06
393	688768	容知日新	10,128	449,581.92	0.06
394	688207	格灵深瞳	29,219	441,206.90	0.06
395	688663	新风光	16,306	439,446.70	0.06
396	688244	永信至诚	16,678	438,964.96	0.06
397	688015	交控科技	21,055	438,786.20	0.06
398	688720	艾森股份	10,210	436,885.90	0.06
399	688061	灿瑞科技	13,310	436,568.00	0.06
400	688162	巨一科技	16,017	436,303.08	0.06
401	688633	星球石墨	15,988	435,353.24	0.06
402	688080	映翰通	8,553	435,262.17	0.06
403	688628	XD优利德	12,945	434,304.75	0.06
404	688683	莱尔科技	17,174	433,128.28	0.06
405	688456	有研粉材	12,015	431,939.25	0.05

406	688680	海优新材	9,739	430,463.80	0.05
407	688623	双元科技	6,851	430,037.27	0.05
408	688221	前沿生物	42,702	428,728.08	0.05
409	688255	凯尔达	12,719	428,503.11	0.05
410	688039	当虹科技	13,009	426,955.38	0.05
411	688733	壹石通	22,406	424,369.64	0.05
412	688077	大地熊	13,265	423,816.75	0.05
413	688199	久日新材	17,893	422,274.80	0.05
414	688133	泰坦科技	18,256	420,253.12	0.05
415	688711	宏微科技	23,852	419,556.68	0.05
416	688257	新锐股份	28,448	416,763.20	0.05
417	688330	宏力达	16,208	416,221.44	0.05
418	688699	明微电子	12,741	412,553.58	0.05
419	688227	品高股份	13,104	411,989.76	0.05
420	688033	天宜新材	64,129	411,066.89	0.05
421	688210	统联精密	17,785	405,498.00	0.05
422	688115	思林杰	7,729	397,270.60	0.05
423	688501	青达环保	14,263	397,224.55	0.05
424	688391	钜泉科技	13,337	395,975.53	0.05
425	688573	信宇人	11,331	392,052.60	0.05
426	688283	坤恒顺维	14,126	387,758.70	0.05
427	688416	恒烁股份	9,616	387,140.16	0.05
428	688317	之江生物	21,448	386,492.96	0.05
429	688312	燕麦科技	16,066	386,065.98	0.05
430	688558	国盛智科	15,295	386,045.80	0.05
431	688398	赛特新材	18,623	385,682.33	0.05
432	688358	祥生医疗	12,991	385,183.15	0.05
433	688057	金达莱	31,188	380,493.60	0.05
434	688129	东来技术	13,960	379,712.00	0.05
435	688500	慧辰股份	8,613	376,388.10	0.05
436	688509	正元地信	87,689	376,185.81	0.05

437	688662	富信科技	10,221	372,555.45	0.05
438	688571	杭华股份	48,062	370,558.02	0.05
439	688786	悦安新材	15,875	369,887.50	0.05
440	688682	霍莱沃	11,789	368,995.70	0.05
441	688600	皖仪科技	15,604	366,694.00	0.05
442	688028	沃尔德	16,827	365,145.90	0.05
443	688379	华光新材	10,432	361,573.12	0.05
444	688291	金橙子	11,894	360,507.14	0.05
445	688585	上纬新材	46,201	359,443.78	0.05
446	688053	思科瑞	11,584	358,293.12	0.05
447	688071	华依科技	9,820	357,939.00	0.05
448	688480	赛恩斯	11,051	355,289.65	0.05
449	688557	兰剑智能	11,852	354,730.36	0.05
450	688419	耐科装备	9,506	354,383.68	0.05
451	688020	方邦股份	9,354	354,235.98	0.05
452	688369	致远互联	13,349	352,280.11	0.04
453	688285	高铁电气	42,862	351,468.40	0.04
454	688316	青云科技	5,535	350,752.95	0.04
455	688273	麦澜德	11,598	350,375.58	0.04
456	688125	安达智能	9,494	348,429.80	0.04
457	688689	银河微电	14,931	344,458.17	0.04
458	688589	力合微	16,035	342,988.65	0.04
459	688132	邦彦技术	16,851	342,075.30	0.04
460	688560	明冠新材	22,533	341,825.61	0.04
461	688468	科美诊断	46,029	338,773.44	0.04
462	688288	鸿泉物联	11,654	338,082.54	0.04
463	688292	浩瀚深度	17,566	337,969.84	0.04
464	688576	西山科技	5,276	335,553.60	0.04
465	688529	豪森智能	18,699	335,460.06	0.04
466	688357	建龙微纳	11,600	333,964.00	0.04
467	688592	司南导航	7,195	333,056.55	0.04

468	688793	倍轻松	9,969	331,868.01	0.04
469	688655	迅捷兴	15,452	327,427.88	0.04
470	688435	英方软件	9,872	325,183.68	0.04
471	688308	欧科亿	17,594	324,609.30	0.04
472	688345	博力威	11,706	322,500.30	0.04
473	688657	浩辰软件	7,589	322,304.83	0.04
474	688030	山石网科	20,079	321,063.21	0.04
475	688667	菱电电控	5,999	319,206.79	0.04
476	688121	卓然股份	26,282	317,486.56	0.04
477	688148	芳源股份	58,127	314,467.07	0.04
478	688610	埃科光电	7,874	312,282.84	0.04
479	688618	三旺通信	12,795	312,198.00	0.04
480	688393	安必平	10,828	311,196.72	0.04
481	688137	近岸蛋白	8,123	311,110.90	0.04
482	688338	赛科希德	12,309	309,940.62	0.04
483	688130	晶华微	14,006	309,532.60	0.04
484	688175	高凌信息	14,998	304,909.34	0.04
485	688613	奥精医疗	15,889	303,797.68	0.04
486	688237	超卓航科	10,385	303,553.55	0.04
487	688370	丛麟科技	15,873	303,333.03	0.04
488	688011	新光光电	11,583	302,895.45	0.04
489	688170	德龙激光	11,979	301,870.80	0.04
490	688479	友车科技	15,901	300,528.90	0.04
491	688218	江苏北人	13,752	298,418.40	0.04
492	688171	纬德信息	9,700	298,372.00	0.04
493	688651	盛邦安全	8,725	297,784.25	0.04
494	688737	中自科技	13,845	297,667.50	0.04
495	688597	煜邦电力	37,939	297,062.37	0.04
496	688695	中创股份	9,848	292,485.60	0.04
497	688530	欧莱新材	17,720	291,848.40	0.04
498	688265	南模生物	9,025	290,695.25	0.04

499	688314	康拓医疗	9,412	290,642.56	0.04
500	688307	中润光学	10,202	290,144.88	0.04
501	688323	瑞华泰	19,947	289,430.97	0.04
502	688022	瀚川智能	19,518	289,256.76	0.04
503	688426	康为世纪	13,036	289,008.12	0.04
504	688098	申联生物	47,222	288,526.42	0.04
505	688203	海正生材	22,669	286,989.54	0.04
506	688551	科威尔	9,730	285,964.70	0.04
507	688216	气派科技	12,425	284,905.25	0.04
508	688109	品茗科技	9,135	284,372.55	0.04
509	688455	科捷智能	20,160	283,651.20	0.04
510	688693	锴威特	8,534	281,707.34	0.04
511	688045	必易微	8,099	278,605.60	0.04
512	688096	京源环保	18,223	277,354.06	0.04
513	688619	罗普特	20,697	275,270.10	0.04
514	688013	天臣医疗	9,393	274,557.39	0.03
515	688310	迈得医疗	18,446	271,894.04	0.03
516	688113	联测科技	7,471	270,375.49	0.03
517	688078	龙软科技	8,433	267,326.10	0.03
518	688026	洁特生物	16,269	266,811.60	0.03
519	688669	聚石化学	14,038	264,897.06	0.03
520	688229	博睿数据	5,142	261,984.90	0.03
521	688056	莱伯泰科	7,823	261,131.74	0.03
522	688058	宝兰德	9,018	258,546.06	0.03
523	688060	云涌科技	6,964	254,812.76	0.03
524	688616	西力科技	20,005	254,463.60	0.03
525	688069	德林海	13,078	254,367.10	0.03
526	688355	明志科技	14,361	252,322.77	0.03
527	688466	金科环境	14,254	252,010.72	0.03
528	688638	誉辰智能	6,484	251,968.24	0.03
529	688081	兴图新科	11,955	248,783.55	0.03

530	688328	深科达	10,960	248,244.00	0.03
531	688420	美腾科技	10,254	244,455.36	0.03
532	688163	赛伦生物	12,521	243,533.45	0.03
533	688448	磁谷科技	8,300	243,107.00	0.03
534	688718	唯赛勃	19,315	239,119.70	0.03
535	688272	富吉瑞	8,808	238,256.40	0.03
536	688118	普元信息	10,637	237,736.95	0.03
537	688395	正弦电气	10,163	230,496.84	0.03
538	688215	瑞晟智能	6,030	229,260.60	0.03
539	688260	昀冢科技	13,901	229,088.48	0.03
540	688679	通源环境	15,256	228,382.32	0.03
541	688517	金冠电气	15,848	227,894.24	0.03
542	688189	南新制药	30,619	227,805.36	0.03
543	688178	万德斯	9,857	226,908.14	0.03
544	688350	富淼科技	14,140	225,391.60	0.03
545	688051	佳华科技	8,956	222,914.84	0.03
546	688251	井松智能	10,074	217,195.44	0.03
547	688038	中科通达	13,482	213,959.34	0.03
548	688092	爱科科技	9,581	213,656.30	0.03
549	688450	光格科技	7,641	201,875.22	0.03
550	688335	复洁环保	16,514	201,470.80	0.03
551	688670	金迪克	14,266	199,010.70	0.03
552	688156	路德环境	11,671	197,356.61	0.03
553	688193	仁度生物	4,642	195,103.26	0.02
554	688671	碧兴物联	9,085	193,964.75	0.02
555	688528	秦川物联	18,689	193,618.04	0.02
556	688607	康众医疗	10,219	191,606.25	0.02
557	688004	博汇科技	9,262	184,313.80	0.02
558	688485	九州一轨	16,596	180,730.44	0.02
559	688367	工大高科	10,138	178,935.70	0.02
560	688329	艾隆科技	8,932	171,851.68	0.02

561	688681	科汇股份	12,147	170,058.00	0.02
562	688067	爱威科技	7,866	169,197.66	0.02
563	688309	恒誉环保	9,289	166,365.99	0.02
564	688296	和达科技	12,512	164,282.56	0.02
565	688217	睿昂基因	6,460	163,438.00	0.02
566	688565	力源科技	16,831	155,686.75	0.02
567	688659	元琛科技	17,780	155,219.40	0.02
568	688021	奥福科技	8,859	135,454.11	0.02
569	688701	卓锦股份	15,571	128,305.04	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
2	603049	中策橡胶	367	15,725.95	0.00
3	603202	天有为	123	11,151.18	0.00
4	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
5	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
6	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
7	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
8	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
9	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	87,642,261.77	11.16

2	688256	寒武纪	72,099,103.82	9.18
3	688981	中芯国际	46,295,710.29	5.89
4	688111	金山办公	41,570,556.77	5.29
5	688012	中微公司	32,624,668.38	4.15
6	688271	联影医疗	27,576,038.90	3.51
7	688036	传音控股	26,525,592.09	3.38
8	688008	澜起科技	22,697,822.99	2.89
9	688506	百利天恒	20,999,953.37	2.67
10	688223	晶科能源	16,547,666.44	2.11
11	688396	华润微	15,756,345.91	2.01
12	688169	石头科技	14,225,629.62	1.81
13	688072	拓荆科技	13,772,592.58	1.75
14	688188	柏楚电子	13,476,937.23	1.72
15	688082	盛美上海	12,842,230.95	1.63
16	688047	龙芯中科	12,237,198.96	1.56
17	688120	华海清科	12,224,630.64	1.56
18	688009	中国通号	12,045,868.98	1.53
19	688249	晶合集成	11,315,521.11	1.44
20	688777	中控技术	11,219,610.94	1.43

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688608	恒玄科技	5,447,723.48	0.69
2	688617	惠泰医疗	4,418,100.40	0.56
3	688256	寒武纪	3,631,837.08	0.46
4	688027	国盾量子	3,386,827.07	0.43

5	688041	海光信息	3,337,610.79	0.42
6	688235	百济神州	3,208,542.54	0.41
7	688279	峰岹科技	2,898,712.90	0.37
8	688018	乐鑫科技	2,825,285.83	0.36
9	688019	安集科技	2,609,653.40	0.33
10	688332	中科蓝讯	1,752,837.98	0.22
11	688032	禾迈股份	1,676,012.71	0.21
12	688502	茂莱光学	1,637,268.64	0.21
13	688686	奥普特	1,472,676.29	0.19
14	688016	心脉医疗	1,433,208.41	0.18
15	688326	经纬恒润	1,357,381.41	0.17
16	688766	普冉股份	1,339,228.54	0.17
17	688083	中望软件	1,309,985.61	0.17
18	688498	源杰科技	1,283,021.13	0.16
19	688486	龙迅股份	1,278,348.03	0.16
20	688190	云路股份	1,272,927.02	0.16

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（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	1,769,643,475.64
卖出股票收入（成交）总额	180,561,130.91

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	81,877.50
8	其他	-
9	合计	81,877.50

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688775	影石创新	71,143.68	0.01	科创板打新限售
2	603049	中策橡胶	15,725.95	0.00	新股锁定
3	603202	天有为	11,151.18	0.00	新股锁定
4	688755	汉邦科技	7,983.99	0.00	科创板打新限售
5	603014	威高血净	6,699.40	0.00	新股锁定

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

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		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
9,03 0	89,725.80	134,620.20 0.00	16.6 2%	597,117,10 0.00	73.7 0%	78,486,70 0.00	9.6 9%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	方正证券股份有限公司	35,371,20 0.00	4.37%
2	杨明娥	17,387,00 0.00	2.15%
3	国信证券股份有限公司	16,866,10 0.00	2.08%
4	中国银河证券股份有限公司	11,731,10 0.00	1.45%
5	国泰海通证券股份有限公司	11,723,00 0.00	1.45%
6	浙江爱尔德投资管理有限公司—爱尔德润鑫15号私募 证券投资基金	9,957,800. 00	1.23%
7	招商证券股份有限公司	7,712,700. 00	0.95%
8	申万宏源证券有限公司	6,140,900. 00	0.76%
9	华泰证券股份有限公司	5,500,000. 00	0.68%
10	中信建投证券股份有限公司	4,243,800. 00	0.52%
-	中信证券股份有限公司—天弘上证科创板综合交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	78,486,70 0.00	9.69%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025年02月26日)基金份额总额	1,526,224,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	824,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,540,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	810,224,000.00

注：本基金合同于2025年02月26日生效。

§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

本报告期内，未发生管理人的重大人事变动。

本报告期内，本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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
中信证券华南	4	1,949,491,444.67	100.00%	401,612.31	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构，再和被选用的证券经营机构签订经纪服务协议。

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	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-02-11
2	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-02-11
3	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-02-11
4	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托	中国证监会规定媒介	2025-02-11

序号	公告标题	披露日期	披露媒介
5	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	2025-02-11	中国证监会规定媒介
6	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金设置最高募集规模上限的公告	2025-02-14	中国证监会规定媒介
7	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金发售代理机构的公告	2025-02-15	中国证监会规定媒介
8	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	2025-02-27	中国证监会规定媒介
9	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	2025-02-28	中国证监会规定媒介
10	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2025-02-28	中国证监会规定媒介
11	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	2025-02-28	中国证监会规定媒介
12	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	2025-03-03	中国证监会规定媒介
13	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	2025-03-05	中国证监会规定媒介

14	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-03-05
15	天弘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（2024年下半年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
16	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-15
17	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-18
18	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-10
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-06
20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日