

天弘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:天弘基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月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	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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	77
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	77
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	78
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12 投资组合报告附注	78
§8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80

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.....	80
§9 开放式基金份额变动.....	80
§10 重大事件揭示.....	81
10.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	81
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	82
10.8 其他重大事件	83
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
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.....	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§12 备查文件目录.....	85
12.1 备查文件目录	85
12.2 存放地点.....	85
12.3 查阅方式.....	85

§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指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘上证科创板综合指数增强	
基金主代码	023895	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月22日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	754,516,506.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
下属分级基金的交易代码	023895	023896
报告期末下属分级基金的份额总额	430,665,764.21份	323,850,742.38份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以上证科创板综合指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份

	额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	张姗
	联系电话	022-83310208	400-61-95555
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-986-8888	400-61-95555
传真		022-83865564	0755-83195201
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（新金融大厦）16层02单元3号房间	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		300203	518040
法定代表人		黄辰立	缪建民

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.thfund.com.cn

基金中期报告置备地点	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	天弘基金管理有限公司	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

§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)	
	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
本期已实现收益	121,038,874.56	54,547,914.34
本期利润	362,106,751.98	187,562,748.00
加权平均基金份额本期利润	0.7214	0.7955
本期加权平均净值利润率	44.21%	48.60%
本期基金份额净值增长率	54.64%	54.34%
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	210,408,247.12	155,650,867.20
期末可供分配基金份额利润	0.4886	0.4806
期末基金资产净值	934,631,848.74	699,474,562.84
期末基金份额净值	2.1702	2.1599
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	117.02%	115.99%

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。

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

天弘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	53.61%	2.22%	52.44%	2.24%	1.17%	-0.02%
过去六个月	54.64%	2.10%	50.92%	2.11%	3.72%	-0.01%
过去一年	104.70%	1.86%	98.19%	1.86%	6.51%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	117.02%	1.74%	107.07%	1.75%	9.95%	-0.01%

天弘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	53.46%	2.22%	52.44%	2.24%	1.02%	-0.02%
过去六个月	54.34%	2.10%	50.92%	2.11%	3.42%	-0.01%
过去一年	103.88%	1.86%	98.19%	1.86%	5.69%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	115.99%	1.74%	107.07%	1.75%	8.92%	-0.01%

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22日-2026年06月30日)



天弘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22日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于2025年04月22日生效。

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04月22日至2025年10月21日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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

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2026年06月30日，公司共管理运作267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		
林心龙	本基金基金经理	2025年04月22日	-	11年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理。2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规有关规定及基金合同相关约定进行操作，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的有关规定以及基金合同的相关约定，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，市场整体震荡上行，成长风格显著占优，市场结构分化延续扩大态势。具体来说：本报告期内，万得数据显示，中证全指上涨10.69%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，中证1000上涨15.99%，创业板指上涨35.58%，科创综指上涨53.99%。

受益于增强策略的有效性，本基金在报告期内相较对标指数科创综指取得了一定程度的超额回报和正收益。未来我们将持续优化针对科创综指的增强选股策略，在对基准指数进行有效跟踪的基础上，通过对市场结构及公司基本面的持续跟踪分析，利用量化选股模型及优化策略积极抽样组合，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘上证科创板综合指数增强A基金份额净值为2.1702元，天弘上证科创板综合指数增强C基金份额净值为2.1599元。报告期内份额净值增长率天弘上证科创板综合指数增强A为54.64%，同期业绩比较基准增长率为50.92%；天弘上证科创板综合指数增强C为54.34%，同期业绩比较基准增长率为50.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，中国经济延续恢复态势，经济运行总体平稳。在全球经济增长放缓、国际贸易环境复杂变化的背景下，国内经济展现出较强韧性，产业升级和科技创新持续推进，新质生产力逐步成为经济增长的重要动力。同时，内需修复力度、房地产调整以及外部环境变化等因素仍对经济运行带来一定压力。经济运行方面，上半年我国工业生产保持稳定增长，规模以上工业增加值同比增长5.4%，其中制造业增加值同比增长5.6%，高技术制造业增加值同比增长13.3%，产业结构持续优化。消费方面，上半年社会消费品零售总额同比增长1.3%，网上商品零售额同比增长4.8%，消费需求保持恢复趋势，但居民消费信心和消费能力仍有进一步提升空间。整体来看，当前中国经济呈现生产端韧性较强、产业升级持续推进、需求端逐步修复的特点。资本市场方面，2026年上半年A股市场呈现明显结构分化特征，科技成长板块成为市场主要投资方向。上证指数整体表现平稳，创业板指、科创50指数表现相对突出，人工智能、半导体、通信设备等相关产业链受到市场重点关注，反映投资者对于科技创新、国产替代以及产业升级趋势的积极预期。相比之下，部分传统行业和消费板块表现相对偏弱，市场资金进一步向产业趋势明确、成长空间较大的方向集中。

展望2026年下半年，预计中国经济仍将处于温和复苏和结构转型阶段，政策支持、产业升级和科技创新将继续发挥重要作用。宏观政策方面，积极财政政策和适度宽松货币政策有望延续，通过扩大内需、推动产业升级以及稳定市场预期，为经济平稳运行提供支撑。随着政策效果逐步显现，消费需求有望进一步改善，制造业投资和产业升级相关投资仍有望保持较强韧性。科技创新和产业升级仍将是下半年资本市场的重要投资主线。人工智能领域，随着大模型技术持续迭代，AI应用从基础设施建设逐步向应用端拓展，算力、服务器、通信设备、半导体等产业链仍有较好的发展空间。同时，国产半导体产业链在政策支持和技术进步推动下持续完善，先进制造、关键设备和核心零部件领

域具备长期成长潜力。高端制造领域，智能制造、工业机器人、航空航天、自动化设备等方向有望受益于制造业转型升级和设备更新需求。中国制造业正在由规模优势向技术和效率优势转变，具备全球竞争力的优势制造企业有望持续提升市场份额。新能源产业方面，经过前期快速发展和行业调整，产业链竞争格局逐步优化，技术进步和成本下降仍是长期发展趋势。新能源汽车、储能、智能电网等领域仍具备较好的产业前景，具备技术优势和成本优势的企业有望获得更好的发展机会。资本市场方面，随着国内经济逐步企稳、流动性环境保持合理充裕以及中长期资金持续入市，A股市场中长期投资价值有望进一步体现。从估值水平来看，当前市场整体估值仍处于相对合理区间，权益资产配置价值逐步提升。未来市场或仍将呈现结构分化特征，具备产业趋势、盈利成长能力和竞争优势的优质企业有望获得更多关注。海外方面，全球经济仍面临一定不确定性。美国经济在高利率环境下逐步承压，同时财政赤字和债务压力增加，未来货币政策存在调整空间。全球流动性环境变化、国际贸易摩擦以及地缘政治风险仍可能对市场风险偏好造成扰动。国内方面，消费恢复节奏、房地产市场修复进程以及部分行业供需结构调整仍需持续关注。此外，部分科技成长板块经过阶段上涨后估值有所提升，后续市场表现仍需要产业趋势和企业盈利增长进一步验证。

总体来看，2026年下半年中国经济有望在政策支持和产业升级推动下保持稳健运行，资本市场仍具备结构性投资机会。在积极把握科技创新、高端制造和产业升级带来的长期机遇的同时，也需关注宏观环境变化和市场波动风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人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，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。

本基金托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘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	79,846,692.64	51,405,862.75
结算备付金		20,003,518.36	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,548,368,146.33	1,167,935,595.95

其中：股票投资		1,523,227,905.68	1,148,645,527.66
基金投资		-	-
债券投资		25,140,240.65	19,290,068.29
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	-	-1,760.31
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		13,606,724.29	7,365,671.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,661,825,081.62	1,226,705,370.24
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		26,430,080.08	28,350,292.54
应付管理人报酬		862,671.68	846,285.22
应付托管费		161,750.96	158,678.47
应付销售服务费		154,073.75	126,224.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		148.60	0.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	109,944.97	68,412.07
负债合计		27,718,670.04	29,549,893.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	754,516,506.59	853,781,702.41
未分配利润	6.4.7.8	879,589,904.99	343,373,774.53
净资产合计		1,634,106,411.58	1,197,155,476.94
负债和净资产总计		1,661,825,081.62	1,226,705,370.24

注：1.报告截止日2026年06月30日，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金A类基金份额净值2.1702元，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金C类基金份额净值2.1599元；基金份额总额754,516,506.59份，其中天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金A类基金份额430,665,764.21份，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金C类基金份额323,850,742.38份。

2.本财务报表的比较期间为2025年04月22日(基金合同生效日)至2025年06月30日(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘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22日（基金 合同生效日）至2025年 06月30日
一、营业总收入		556,217,017.95	62,765,286.52
1.利息收入		36,514.78	375,839.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,374.78	47,849.59
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		6,140.00	327,990.17
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		181,767,661.96	31,882,085.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	179,304,270.56	28,590,737.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	242,742.68	4.87
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	2,220,648.72	3,291,342.48
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	374,082,711.08	30,445,725.02
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	330,130.13	61,636.62
减：二、营业总支出		6,547,517.97	2,370,637.92
1.管理人报酬		4,778,975.08	1,744,697.79
2.托管费		896,057.77	327,130.83
3.销售服务费		764,904.37	277,127.80
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		6,736.10	-
其中：卖出回购金融资产 支出		6,736.10	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		33.89	0.01
8.其他费用	6.4.7.19	100,810.76	21,681.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		549,669,499.98	60,394,648.60
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		549,669,499.98	60,394,648.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		549,669,499.98	60,394,648.60

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘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	853,781,702.41	343,373,774.53	1,197,155,476.94
二、本期期初净资产	853,781,702.41	343,373,774.53	1,197,155,476.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-99,265,195.82	536,216,130.46	436,950,934.64
（一）、综合收益总额	-	549,669,499.98	549,669,499.98
（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）	-99,265,195.82	-13,453,369.52	-112,718,565.34
其中：1.基金申购款	1,003,426,593.21	705,000,843.20	1,708,427,436.41
2.基金赎回款	-1,102,691,789.03	-718,454,212.72	-1,821,146,001.75
（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	754,516,506.59	879,589,904.99	1,634,106,411.58
项 目	上年度可比期间 2025年04月22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	1,331,973,374.76	-	1,331,973,374.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-482,137,081.02	50,990,559.65	-431,146,521.37
（一）、综合收益总额	-	60,394,648.60	60,394,648.60
（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）	-482,137,081.02	-9,404,088.95	-491,541,169.97
其中：1.基金申购款	322,925,901.01	5,706,545.25	328,632,446.26
2.基金赎回款	-805,062,982.03	-15,110,634.20	-820,173,616.23
（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	849,836,293.74	50,990,559.65	900,826,853.39

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

迟哲

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指数增强型证券投资基金（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]577号《关于准予天弘上证科创板综合指数增强型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向社会公开发行人募集，基金合同于2025年04月22日正式生效，首次设立募集规模为1,331,973,374.76份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括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、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券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。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如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。

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发布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

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2026年度上半年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年度上半年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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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》、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》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。
- 本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。
- b) 对本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。
- 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。
- d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。
- e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	25,473,091.41
等于：本金	25,471,284.80
加：应计利息	1,806.61

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	54,373,601.23
等于：本金	54,373,114.47
加：应计利息	486.76
减：坏账准备	-
合计	79,846,692.64

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 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,011,422,123.23	-	1,523,227,905.68	511,805,782.45
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,751,109.00	292,676.05	25,140,240.65	96,455.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,751,109.00	292,676.05	25,140,240.65	96,455.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,036,173,232.23	292,676.05	1,548,368,146.33	511,902,238.05

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,418.59
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	90,747.97
其他应付款	7,778.41
合计	109,944.97

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘上证科创板综合指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘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	595,577,525.49	595,577,525.49
本期申购	415,174,908.52	415,174,908.52
本期赎回（以“-”号填列）	-580,086,669.80	-580,086,669.80
本期末	430,665,764.21	430,665,764.21

6.4.7.7.2 天弘上证科创板综合指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘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	258,204,176.92	258,204,176.92
本期申购	588,251,684.69	588,251,684.69
本期赎回（以“-”号填列）	-522,605,119.23	-522,605,119.23
本期末	323,850,742.38	323,850,742.38

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘上证科创板综合指数增强A

单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	147,182,664.55	93,053,497.24	240,236,161.79
本期期初	147,182,664.55	93,053,497.24	240,236,161.79
本期利润	121,038,874.56	241,067,877.42	362,106,751.98
本期基金份额交易产生的变动数	-57,813,291.99	-40,563,537.25	-98,376,829.24
其中：基金申购款	156,526,146.59	123,223,648.43	279,749,795.02
基金赎回款	-214,339,438.58	-163,787,185.68	-378,126,624.26

本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,408,247.12	293,557,837.41	503,966,084.53

6.4.7.8.2 天弘上证科创板综合指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合 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	62,824,116.37	40,313,496.37	103,137,612.74
本期期初	62,824,116.37	40,313,496.37	103,137,612.74
本期利润	54,547,914.34	133,014,833.66	187,562,748.00
本期基金份额交易产 生的变动数	38,278,836.49	46,644,623.23	84,923,459.72
其中：基金申购款	230,967,996.91	194,283,051.27	425,251,048.18
基金赎回款	-192,689,160.42	-147,638,428.04	-340,327,588.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	155,650,867.20	219,972,953.26	375,623,820.46

6.4.7.9 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	8,129.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,996.99
结算备付金利息收入	11,248.09
其他	-
合计	30,374.78

6.4.7.10 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	1,285,249,757.75
减：卖出股票成本总额	1,104,692,823.59
减：交易费用	1,252,663.60
买卖股票差价收入	179,304,270.56

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	118,253.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	124,489.28
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	242,742.68

6.4.7.11.2 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）成交总额	45,681,121.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	44,938,043.00
减：应计利息总额	618,572.05
减：交易费用	17.03
买卖债券差价收入	124,489.28

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,220,648.72
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	2,220,648.72

6.4.7.16 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	374,082,711.08
——股票投资	373,991,024.48
——债券投资	91,686.60
——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	374,082,711.08

6.4.7.17 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	328,668.30
基金转换费收入	1,461.83
合计	330,130.13

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 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,806.74
存托服务费	256.05
合计	100,810.76

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、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日 至2026年06月30 日	2025年04月22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	4,778,975.08	1,744,697.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,367,724.07	759,848.54
应支付基金管理人的净管理费	2,411,251.01	984,849.25

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0.80%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。

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 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年04月22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	896,057.77	327,130.83

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费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		
	天弘上证科创板综合指数增 强A	天弘上证科创板综合指数增 强C	合计
	天弘基金	-	942.53

管理有限公司			
招商银行股份有限公司	-	60,488.12	60,488.12
合计	-	61,430.65	61,430.65
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22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		
	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	39.03	39.03
招商银行股份有限公司	-	18,226.83	18,226.83
合计	-	18,265.86	18,265.86

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘上证科创板综合指数增强C的销售服务费率为0.40%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘上证科创板综合指数增强A不收取销售服务费。

3、根据《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》，自该规定施行之日起，或对于已发售基金，自其完成基金合同修订及相关调整之日起，投资人通过基金管理人认购/申购的或者通过代销机构认购/申购且持续持有期限超过一年的基金份额不收取销售服务费。本基金按照该法规要求对不应收取的销售服务费将在投资者赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间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

天弘上证科创板综合指数增强A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘上证科创板综合指数增强C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月22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
招商银行股份有限公司	25,473,091.41	8,129.70	4,013,968.79	32,563.09

注：本基金由基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间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（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
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	4,577	523,059.56	3,098,354.38	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,162	330,934.92	2,431,230.18	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	35,206	355,932.66	355,932.66	-
688790	昂瑞微	2025-12-0	9个月	新股流通	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-

		9		受限						
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,486	29,244.48	210,254.14	-
001399	C惠科	2026-06-16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	5,754	58,230.48	159,558.42	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	15,088	152,539.68	152,539.68	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	C臻宝	2026-06-16	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-2	6个月	新股流通	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-

		4		受限						
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-2	6个月	新股流通	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

		8		受限						
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	1个月内(含)	新股未上市	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-1	1个月内(含)	新股未上	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-

		8		市						
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
920189	康美特	2026-06-30	1个月内(含)	新股未上市	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

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
118072	鼎通转债	2026-06-24	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	1,350	135,000.00	135,004.14	-
118070	南芯转债	2026-06-18	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	190	19,000.00	19,001.08	-
118069	爱科转债	2026-06-11	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	130	13,000.00	13,001.14	-

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	股	停	停	期	复	复	数量	期末成本总	期末估值总	备
---	---	---	---	---	---	---	----	-------	-------	---

票 代 码	票 名 称	牌 日 期	牌 原 因	末 估 值 单 价	牌 日 期	牌 开 盘 单 价	(股)	额	额	注
688 260	昀 豕 科 技	202 6-0 6-2 6	交 易 异 常 波 动	144. 00	202 6-07 -01	132. 00	33,170	930,261.35	4,776,480.0 0	-
688 121	卓 然 股 份	202 6-0 5-0 6	未 如 期 刊 登 定 期 报 告	6.48	202 6-07 -07	5.18	2,200	26,687.99	14,256.00	-
688 072	拓 荆 科 技	202 6-0 6-2 9	重 大 事 项	879. 53	202 6-07 -13	890. 99	29,903	7,975,428.7 4	26,300,585. 59	-

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2026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质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026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质押的债券。

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

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

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招商银行股份有限公司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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	24,699,529.10	19,196,066.85
合计	24,699,529.10	19,196,066.85

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	440,711.55	94,001.44
未评级	-	-
合计	440,711.55	94,001.44

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他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，因此账面余额约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%。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。

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。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值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	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	------	------	-----	----

2026年06月30日					
资产					
货币资金	79,846,692.64	-	-	-	79,846,692.64
结算备付金	20,003,518.36	-	-	-	20,003,518.36
交易性金融资产	24,699,529.10	-	440,711.55	1,523,227,905.68	1,548,368,146.33
应收申购款	-	-	-	13,606,724.29	13,606,724.29
资产总计	124,549,740.10	-	440,711.55	1,536,834,629.97	1,661,825,081.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,430,080.08	26,430,080.08
应付管理人报酬	-	-	-	862,671.68	862,671.68
应付托管费	-	-	-	161,750.96	161,750.96
应付销售服务费	-	-	-	154,073.75	154,073.75
应交税费	-	-	-	148.60	148.60
其他负债	-	-	-	109,944.97	109,944.97
负债总计	-	-	-	27,718,670.04	27,718,670.04
利率敏感度缺口	124,549,740.10	-	440,711.55	1,509,115,959.93	1,634,106,411.58
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	51,405,862.75	-	-	-	51,405,862.75
交易性金融资产	19,196,066.85	-	94,001.44	1,148,645,527.66	1,167,935,595.95
买入返售金融资产	-1,760.31	-	-	-	-1,760.31
应收申购款	-	-	-	7,365,671.85	7,365,671.85
资产总计	70,600,169.29	-	94,001.44	1,156,011,199.51	1,226,705,370.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,350,292.54	28,350,292.54
应付管理人报酬	-	-	-	846,285.22	846,285.22
应付托管费	-	-	-	158,678.47	158,678.47
应付销售服务费	-	-	-	126,224.93	126,224.93
应交税费	-	-	-	0.07	0.07

其他负债	-	-	-	68,412.07	68,412.07
负债总计	-	-	-	29,549,893.30	29,549,893.30
利率敏感度缺口	70,600,169.29	-	94,001.44	1,126,461,306.21	1,197,155,476.94

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06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为1.54%(2025年12月31日：1.61%)，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。

本基金采用指数增强型投资策略，以上证科创板综合指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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	1,523,227,905.68	93.21	1,148,645,527.66	95.95
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	1,523,227,905.68	93.21	1,148,645,527.66	95.95

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	83,161,016.28	62,634,525.67
	业绩比较基准下降5%	-83,161,016.28	-62,634,525.67

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	1,481,243,727.09	1,118,386,400.41
第二层次	56,476,297.39	43,335,610.79
第三层次	10,648,121.85	6,213,584.75
合计	1,548,368,146.33	1,167,935,595.95

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2026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(2025年12月31日：同)。

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	1,523,227,905.68	91.66
	其中：股票	1,523,227,905.68	91.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,140,240.65	1.51
	其中：债券	25,140,240.65	1.51
	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	99,850,211.00	6.01
8	其他各项资产	13,606,724.29	0.82
9	合计	1,661,825,081.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,117,729,721.39	68.40
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	247,904,752.94	15.17

	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	25,266,028.62	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	6,204,289.66	0.38
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	1,397,104,792.61	85.50

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	36,149.82	0.00
C	制造业	102,715,759.50	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	508,472.34	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,494,176.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,656,439.20	0.84
J	金融业	1,375,872.00	0.08
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	886,820.75	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	18,502.00	0.00
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	429,338.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	126,123,113.07	7.72

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	62,373	99,519,240.15	6.09
2	688041	海光信息	231,601	85,761,850.30	5.25
3	688012	中微公司	96,596	45,255,226.00	2.77
4	688008	澜起科技	106,085	32,875,741.50	2.01
5	688981	中芯国际	202,310	32,130,874.20	1.97
6	688795	摩尔线程	44,129	31,436,966.86	1.92
7	688802	沐曦股份	36,562	30,096,450.18	1.84
8	688072	拓荆科技	29,903	26,300,585.59	1.61
9	688498	源杰科技	13,520	25,498,720.00	1.56
10	688525	佰维存储	47,378	23,439,317.94	1.43
11	688146	中船特气	53,433	18,701,015.67	1.14
12	688082	盛美上海	42,738	18,462,816.00	1.13
13	688521	芯原股份	46,563	17,281,391.82	1.06
14	688396	华润微	142,739	13,924,189.45	0.85

15	688183	生益电子	94,020	12,448,248.00	0.76
16	688506	百利天恒	41,318	12,148,731.54	0.74
17	688361	中科飞测	27,705	11,913,150.00	0.73
18	688347	华虹宏力	35,003	11,771,508.90	0.72
19	688766	普冉股份	15,200	11,652,320.00	0.71
20	688111	金山办公	54,378	11,585,232.90	0.71
21	688702	盛科通信	29,648	11,562,423.52	0.71
22	688120	华海清科	34,270	11,041,108.60	0.68
23	688172	燕东微	128,924	10,785,781.84	0.66
24	688017	绿的谐波	24,897	10,403,460.42	0.64
25	688271	联影医疗	92,042	9,317,411.66	0.57
26	688200	华峰测控	17,608	9,245,960.80	0.57
27	688126	沪硅产业	225,417	8,991,884.13	0.55
28	688110	东芯股份	43,873	8,936,930.10	0.55
29	688249	晶合集成	138,779	8,192,124.37	0.50
30	688629	华丰科技	42,829	8,030,865.79	0.49
31	688036	传音控股	132,503	7,811,051.85	0.48
32	688668	鼎通科技	20,692	7,724,323.60	0.47
33	688220	翱捷科技	61,967	7,703,737.44	0.47
34	688002	睿创微纳	45,927	7,104,447.63	0.43
35	688385	复旦微电	97,285	6,935,447.65	0.42
36	688519	南亚新材	17,475	6,641,199.00	0.41
37	688336	三生国健	124,885	6,631,393.50	0.41
38	688469	芯联集成	624,012	6,620,767.32	0.41
39	688037	芯源微	14,600	6,410,130.00	0.39
40	688777	中控技术	53,851	6,327,492.50	0.39
41	688548	广钢气体	121,406	6,325,252.60	0.39
42	688411	海博思创	21,200	6,173,440.00	0.38
43	688449	联芸科技	71,040	6,131,462.40	0.38
44	688047	龙芯中科	37,915	5,864,313.05	0.36
45	688313	仕佳光子	31,418	5,801,333.70	0.36

46	688375	国博电子	55,475	5,786,042.50	0.35
47	688322	奥比中光	42,914	5,602,422.70	0.34
48	688536	思瑞浦	15,382	5,600,432.38	0.34
49	688301	奕瑞科技	44,520	5,520,480.00	0.34
50	688295	中复神鹰	89,005	5,388,362.70	0.33
51	688372	伟测科技	28,652	5,329,272.00	0.33
52	688585	上纬新材	31,900	5,289,020.00	0.32
53	688048	长光华芯	10,207	5,123,914.00	0.31
54	688167	炬光科技	14,406	5,102,749.26	0.31
55	688390	固德威	45,924	4,983,213.24	0.30
56	688692	达梦数据	20,196	4,933,680.84	0.30
57	688387	信科移动	245,801	4,876,691.84	0.30
58	688700	东威科技	53,883	4,817,140.20	0.29
59	688416	恒烁股份	34,398	4,815,720.00	0.29
60	688778	厦钨新能	88,283	4,802,595.20	0.29
61	688378	奥来德	77,309	4,793,158.00	0.29
62	688260	昀冢科技	33,170	4,776,480.00	0.29
63	688627	精智达	6,669	4,768,335.00	0.29
64	688059	华锐精密	23,611	4,715,352.81	0.29
65	688107	安路科技	103,211	4,706,421.60	0.29
66	688472	阿特斯	422,802	4,574,717.64	0.28
67	688409	富创精密	14,560	4,459,000.00	0.27
68	688257	新锐股份	42,877	4,369,166.30	0.27
69	688027	国盾量子	8,467	4,267,452.67	0.26
70	688368	晶丰明源	18,215	3,943,911.80	0.24
71	688486	龙迅股份	61,926	3,937,255.08	0.24
72	688035	德邦科技	42,767	3,926,010.60	0.24
73	688223	晶科能源	822,393	3,906,366.75	0.24
74	688549	中巨芯	105,560	3,885,663.60	0.24
75	688620	安凯微	239,671	3,882,670.20	0.24
76	688234	天岳先进	22,368	3,881,071.68	0.24

77	688333	铂力特	37,872	3,878,092.80	0.24
78	688331	荣昌生物	29,532	3,846,838.32	0.24
79	688141	杰华特	25,000	3,837,500.00	0.23
80	688216	气派科技	91,058	3,825,346.58	0.23
81	688001	华兴源创	44,408	3,805,765.60	0.23
82	688530	欧莱新材	39,200	3,798,480.00	0.23
83	688262	国芯科技	86,147	3,724,134.81	0.23
84	688719	爱科赛博	47,879	3,686,683.00	0.23
85	688297	中无人机	87,395	3,631,262.25	0.22
86	688362	甬矽电子	37,386	3,604,010.40	0.22
87	688103	国力电子	47,691	3,548,687.31	0.22
88	688630	芯碁微装	6,400	3,516,096.00	0.22
89	688221	前沿生物	152,625	3,418,800.00	0.21
90	688266	泽璟制药	29,019	3,385,356.54	0.21
91	688690	纳微科技	76,665	3,380,926.50	0.21
92	688617	惠泰医疗	18,400	3,340,704.00	0.20
93	688380	中微半导	50,471	3,326,543.61	0.20
94	688279	峰昭科技	14,800	3,321,712.00	0.20
95	688019	安集科技	9,690	3,289,367.40	0.20
96	688728	格科微	154,887	3,258,822.48	0.20
97	688049	炬芯科技	68,865	3,230,457.15	0.20
98	688545	兴福电子	24,200	3,220,052.00	0.20
99	688475	萤石网络	114,630	3,135,130.50	0.19
100	688025	杰普特	6,600	3,102,000.00	0.19
101	688303	大全能源	177,634	3,096,160.62	0.19
102	688433	华曙高科	36,133	3,092,984.80	0.19
103	688052	纳芯微	10,697	3,084,052.07	0.19
104	688097	博众精工	48,747	3,073,498.35	0.19
105	688018	乐鑫科技	23,637	3,023,645.04	0.19
106	688584	上海合晶	84,018	3,020,447.10	0.18
107	688400	凌云光	45,040	2,981,648.00	0.18

108	688600	皖仪科技	88,558	2,947,210.24	0.18
109	688663	新风光	33,271	2,943,152.66	0.18
110	688099	晶晨股份	28,549	2,937,692.10	0.18
111	688147	XD微导纳	17,800	2,881,464.00	0.18
112	688775	影石创新	20,538	2,847,593.70	0.17
113	688187	时代电气	41,099	2,821,857.34	0.17
114	688178	万德斯	83,331	2,817,421.11	0.17
115	688148	芳源股份	327,848	2,812,935.84	0.17
116	688138	清溢光电	59,797	2,810,459.00	0.17
117	688065	凯赛生物	58,613	2,804,632.05	0.17
118	688045	必易微	33,410	2,698,859.80	0.17
119	688127	蓝特光学	27,342	2,668,579.20	0.16
120	688077	大地熊	98,994	2,622,351.06	0.16
121	688401	路维光电	26,824	2,574,567.52	0.16
122	688578	艾力斯	23,216	2,535,187.20	0.16
123	688560	明冠新材	212,930	2,523,220.50	0.15
124	688615	合合信息	22,280	2,519,868.00	0.15
125	689009	九号公司	66,012	2,518,357.80	0.15
126	688153	唯捷创芯	78,256	2,513,582.72	0.15
127	688359	三孚新科	12,400	2,460,656.00	0.15
128	688535	华海诚科	13,134	2,456,058.00	0.15
129	688455	科捷智能	129,662	2,419,492.92	0.15
130	688195	腾景科技	12,480	2,403,398.40	0.15
131	688222	成都先导	74,768	2,400,800.48	0.15
132	688300	联瑞新材	9,800	2,395,120.00	0.15
133	688114	华大智造	46,705	2,385,691.40	0.15
134	688779	五矿新能	292,840	2,374,932.40	0.15
135	688388	嘉元科技	53,695	2,362,580.00	0.14
136	688102	斯瑞新材	49,400	2,330,692.00	0.14
137	688691	灿芯股份	19,691	2,282,777.63	0.14
138	688531	日联科技	12,800	2,276,352.00	0.14

139	688686	奥普特	13,356	2,249,016.84	0.14
140	688198	佰仁医疗	25,006	2,231,535.44	0.14
141	688392	骄成超声	9,785	2,222,956.30	0.14
142	688009	中国通号	465,968	2,218,007.68	0.14
143	688046	药康生物	91,057	2,203,579.40	0.13
144	688166	博瑞医药	62,825	2,199,503.25	0.13
145	688582	芯动联科	33,607	2,184,455.00	0.13
146	688158	优刻得	58,649	2,155,937.24	0.13
147	688239	航宇科技	36,000	2,153,880.00	0.13
148	688332	中科蓝讯	13,596	2,141,370.00	0.13
149	688599	天合光能	151,079	2,133,235.48	0.13
150	688090	瑞松科技	19,940	2,122,613.00	0.13
151	688063	派能科技	39,337	2,095,481.99	0.13
152	688231	隆达股份	56,883	2,089,312.59	0.13
153	688137	近岸蛋白	57,740	2,078,640.00	0.13
154	688410	山外山	144,575	2,076,097.00	0.13
155	688612	威迈斯	70,003	2,071,388.77	0.13
156	688213	思特威	19,175	2,053,067.25	0.13
157	688135	利扬芯片	48,761	2,051,862.88	0.13
158	688678	福立旺	84,239	2,036,056.63	0.12
159	688252	天德钰	84,800	2,035,200.00	0.12
160	688619	罗普特	125,382	2,034,949.86	0.12
161	688353	华盛锂电	17,400	2,019,618.00	0.12
162	688518	联赢激光	65,083	2,011,064.70	0.12
163	688699	明微电子	24,400	1,999,580.00	0.12
164	688515	裕太微	8,000	1,990,080.00	0.12
165	688350	富淼科技	57,300	1,978,569.00	0.12
166	688061	灿瑞科技	38,800	1,927,196.00	0.12
167	688676	金盘科技	22,470	1,901,860.80	0.12
168	688088	虹软科技	53,088	1,887,278.40	0.12
169	688557	兰剑智能	60,606	1,880,604.18	0.12

170	688552	航天南湖	66,671	1,875,455.23	0.11
171	688181	八亿时空	29,800	1,865,480.00	0.11
172	688205	德科立	8,935	1,860,177.65	0.11
173	688653	康希通信	106,131	1,844,556.78	0.11
174	688006	杭可科技	50,455	1,844,130.25	0.11
175	688689	银河微电	28,400	1,838,048.00	0.11
176	688383	新益昌	9,600	1,805,184.00	0.11
177	688370	丛麟科技	85,582	1,790,375.44	0.11
178	688662	富信科技	10,580	1,777,440.00	0.11
179	688517	金冠电气	100,620	1,758,837.60	0.11
180	688291	金橙子	29,883	1,747,557.84	0.11
181	688098	申联生物	199,535	1,714,005.65	0.10
182	688188	柏楚电子	16,022	1,709,547.40	0.10
183	688248	南网科技	24,645	1,704,941.10	0.10
184	688367	工大高科	50,905	1,695,136.50	0.10
185	688123	聚辰股份	7,916	1,682,941.60	0.10
186	688609	九联科技	152,356	1,677,439.56	0.10
187	688083	中望软件	25,811	1,671,262.25	0.10
188	688309	恒誉环保	27,413	1,668,903.44	0.10
189	688285	高铁电气	231,815	1,662,113.55	0.10
190	688658	悦康药业	128,321	1,650,208.06	0.10
191	688365	光云科技	104,098	1,641,625.46	0.10
192	688589	力合微	71,212	1,636,451.76	0.10
193	688131	皓元医药	17,000	1,608,200.00	0.10
194	688683	莱尔科技	42,400	1,607,808.00	0.10
195	688207	格灵深瞳	79,790	1,603,779.00	0.10
196	688677	海泰新光	15,817	1,599,573.21	0.10
197	688212	澳华内镜	54,200	1,593,480.00	0.10
198	688055	龙腾光电	274,333	1,580,158.08	0.10
199	688100	威胜信息	51,597	1,578,352.23	0.10
200	688343	云天励飞	19,282	1,574,568.12	0.10

201	688180	君实生物	46,429	1,570,228.78	0.10
202	688129	东来技术	59,600	1,560,924.00	0.10
203	688112	鼎阳科技	21,200	1,557,352.00	0.10
204	688717	艾罗能源	18,829	1,554,710.53	0.10
205	688788	科思科技	34,478	1,550,820.44	0.09
206	688349	三一重能	101,827	1,545,733.86	0.09
207	688758	赛分科技	69,879	1,538,036.79	0.09
208	688577	浙海德曼	33,328	1,527,422.24	0.09
209	688062	迈威生物	53,981	1,524,963.25	0.09
210	688652	京仪装备	7,600	1,521,292.00	0.09
211	688523	航天环宇	29,000	1,519,600.00	0.09
212	688458	美芯晟	35,866	1,497,764.16	0.09
213	688122	西部超导	23,786	1,493,998.66	0.09
214	688489	三未信安	65,615	1,489,460.50	0.09
215	688510	航亚科技	61,855	1,477,097.40	0.09
216	688377	迪威尔	62,394	1,471,250.52	0.09
217	688315	诺禾致源	117,136	1,465,371.36	0.09
218	688539	高华科技	45,600	1,453,728.00	0.09
219	688373	盟科药业	320,463	1,451,697.39	0.09
220	688352	颀中科技	59,852	1,447,221.36	0.09
221	688345	博力威	24,875	1,444,740.00	0.09
222	688030	山石网科	90,029	1,421,557.91	0.09
223	688360	德马科技	78,885	1,412,041.50	0.09
224	688105	诺唯赞	80,992	1,405,211.20	0.09
225	688255	凯尔达	50,365	1,400,147.00	0.09
226	688516	奥特维	24,333	1,396,470.87	0.09
227	688711	宏微科技	30,560	1,388,952.00	0.08
228	688502	茂莱光学	2,000	1,387,200.00	0.08
229	688308	欧科亿	7,597	1,381,210.57	0.08
230	688330	宏力达	40,737	1,378,132.71	0.08
231	688005	容百科技	44,720	1,368,432.00	0.08

232	688119	中钢洛耐	282,062	1,339,794.50	0.08
233	688133	泰坦科技	63,338	1,338,331.94	0.08
234	688290	景业智能	20,120	1,335,163.20	0.08
235	688258	卓易信息	11,106	1,316,505.24	0.08
236	688596	正帆科技	16,423	1,298,402.38	0.08
237	688680	海优新材	30,659	1,287,678.00	0.08
238	688633	星球石墨	43,000	1,278,390.00	0.08
239	688432	有研硅	31,478	1,258,175.66	0.08
240	688265	南模生物	36,115	1,249,217.85	0.08
241	688720	艾森股份	12,271	1,239,371.00	0.08
242	688246	嘉和美康	60,185	1,236,801.75	0.08
243	688593	新相微	31,644	1,231,584.48	0.08
244	688015	交控科技	78,919	1,213,774.22	0.07
245	688280	精进电动	220,177	1,208,771.73	0.07
246	688317	之江生物	79,305	1,205,436.00	0.07
247	688192	迪哲医药	29,977	1,196,981.61	0.07
248	688443	智翔金泰	51,385	1,194,701.25	0.07
249	688709	成都华微	31,200	1,188,408.00	0.07
250	688108	赛诺医疗	63,558	1,177,729.74	0.07
251	688182	灿勤科技	27,334	1,177,275.38	0.07
252	688169	石头科技	12,287	1,166,896.39	0.07
253	688420	美腾科技	53,756	1,132,638.92	0.07
254	688726	拉普拉斯	21,428	1,132,469.80	0.07
255	688568	XD中科星	27,200	1,127,984.00	0.07
256	688448	磁谷科技	17,730	1,126,918.80	0.07
257	688528	秦川物联	121,961	1,114,723.54	0.07
258	688081	兴图新科	27,000	1,103,760.00	0.07
259	688096	京源环保	80,723	1,078,459.28	0.07
260	688403	汇成股份	27,142	1,077,537.40	0.07
261	688215	瑞晟智能	26,827	1,077,372.32	0.07
262	688206	概伦电子	23,915	1,061,108.55	0.06

263	688708	佳驰科技	20,800	1,056,640.00	0.06
264	688302	海创药业	29,729	1,045,568.93	0.06
265	688631	莱斯信息	21,600	1,013,256.00	0.06
266	688003	天准科技	7,950	1,012,035.00	0.06
267	688236	春立医疗	69,301	1,002,092.46	0.06
268	688682	XD霍莱沃	25,593	995,567.70	0.06
269	688334	西高院	54,568	989,863.52	0.06
270	688556	高测股份	73,911	981,538.08	0.06
271	688328	深科达	10,242	980,159.40	0.06
272	688456	有研粉材	7,000	977,200.00	0.06
273	688337	普源精电	13,019	975,513.67	0.06
274	688293	奥浦迈	23,252	969,375.88	0.06
275	688559	海目星	11,400	956,688.00	0.06
276	688021	奥福科技	49,000	948,640.00	0.06
277	688292	浩瀚深度	50,781	944,526.60	0.06
278	688199	久日新材	27,096	935,624.88	0.06
279	688570	天玛智控	65,341	929,802.43	0.06
280	688032	禾迈股份	11,000	929,720.00	0.06
281	688356	键凯科技	12,000	924,960.00	0.06
282	688500	慧辰股份	20,200	915,666.00	0.06
283	688479	友车科技	23,727	900,914.19	0.06
284	688233	神工股份	4,200	900,564.00	0.06
285	688772	珠海冠宇	43,704	857,909.52	0.05
286	688156	路德科技	28,356	857,769.00	0.05
287	688175	高凌信息	33,821	850,598.15	0.05
288	688395	正弦电气	38,400	848,640.00	0.05
289	688338	赛科希德	28,551	842,540.01	0.05
290	688369	致远互联	40,028	840,988.28	0.05
291	688179	阿拉丁	30,243	838,033.53	0.05
292	688605	先锋精科	8,000	832,160.00	0.05
293	688538	和辉光电	319,705	831,233.00	0.05

294	688160	步科股份	7,574	823,823.98	0.05
295	688327	云从科技	65,987	822,198.02	0.05
296	688358	祥生医疗	26,814	819,703.98	0.05
297	688660	电气风电	94,053	810,736.86	0.05
298	688737	中自科技	41,761	799,305.54	0.05
299	688272	富吉瑞	17,668	784,459.20	0.05
300	688381	帝奥微	14,542	777,997.00	0.05
301	688800	瑞可达	8,092	776,589.24	0.05
302	688209	英集芯	25,800	750,264.00	0.05
303	688152	麒麟信安	26,920	739,761.60	0.05
304	688314	康拓医疗	21,609	732,112.92	0.04
305	688031	星环科技	6,339	730,126.02	0.04
306	688382	益方生物	40,205	723,690.00	0.04
307	688428	诺诚健华	25,004	711,863.88	0.04
308	688571	杭华股份	79,749	697,803.75	0.04
309	688128	中国电研	28,800	683,712.00	0.04
310	688478	晶升股份	7,600	672,980.00	0.04
311	688363	华熙生物	18,736	670,186.72	0.04
312	688355	明志科技	34,397	662,142.25	0.04
313	688636	智明达	18,222	660,183.06	0.04
314	688227	品高股份	6,409	658,140.21	0.04
315	688529	豪森智能	41,802	657,545.46	0.04
316	688268	华特气体	2,400	642,000.00	0.04
317	688503	聚和材料	4,800	636,960.00	0.04
318	688718	唯赛勃	38,828	620,083.16	0.04
319	688073	毕得医药	11,514	619,683.48	0.04
320	688235	百济神州	2,400	611,064.00	0.04
321	688393	安必平	33,794	600,857.32	0.04
322	688450	光格科技	8,965	600,565.35	0.04
323	688163	赛伦生物	11,935	582,547.35	0.04
324	688603	XD天承科	2,800	582,260.00	0.04

325	688610	埃科光电	2,140	563,676.00	0.03
326	688087	英科再生	16,600	554,772.00	0.03
327	688671	碧兴物联	15,479	550,588.03	0.03
328	688165	埃夫特	26,600	542,640.00	0.03
329	688191	智洋创新	15,000	535,500.00	0.03
330	688608	恒玄科技	3,200	535,008.00	0.03
331	688316	青云科技	9,800	529,200.00	0.03
332	688203	海正生材	52,210	521,055.80	0.03
333	688757	胜科纳米	7,786	519,326.20	0.03
334	688707	振华新材	40,219	516,814.15	0.03
335	688106	金宏气体	12,314	510,784.72	0.03
336	688051	佳华科技	22,200	510,156.00	0.03
337	688667	菱电电控	3,797	507,469.05	0.03
338	688648	中邮科技	13,846	506,071.30	0.03
339	688698	伟创电气	9,600	503,520.00	0.03
340	688150	莱特光电	7,311	501,680.82	0.03
341	688507	索辰科技	1,833	494,323.44	0.03
342	688230	芯导科技	6,200	488,622.00	0.03
343	688693	锆威特	4,699	488,461.05	0.03
344	688348	昱能科技	13,860	482,050.80	0.03
345	688162	巨一科技	19,604	463,438.56	0.03
346	688563	航材股份	9,000	461,070.00	0.03
347	688020	方邦股份	1,800	449,280.00	0.03
348	688312	燕麦科技	5,200	436,748.00	0.03
349	688767	博拓生物	13,400	435,634.00	0.03
350	688551	科威尔	6,161	432,933.47	0.03
351	688278	特宝生物	7,807	424,700.80	0.03
352	688598	金博股份	8,551	422,846.95	0.03
353	688425	铁建重工	104,581	420,415.62	0.03
354	688318	财富趋势	5,766	411,173.46	0.03
355	688611	杭州柯林	5,641	403,049.45	0.02

356	688208	道通科技	15,875	399,891.25	0.02
357	688543	国科军工	10,040	396,078.00	0.02
358	688091	上海谊众	9,842	395,648.40	0.02
359	688520	神州细胞	11,389	389,617.69	0.02
360	688371	菲沃泰	9,794	381,868.06	0.02
361	688661	和林微纳	2,400	381,552.00	0.02
362	688273	麦澜德	9,800	379,652.00	0.02
363	688028	沃尔德	2,400	374,088.00	0.02
364	688484	南芯科技	6,600	372,834.00	0.02
365	688625	呈和科技	4,080	344,392.80	0.02
366	688786	悦安新材	7,391	340,577.28	0.02
367	688116	XD天奈科	8,878	339,139.60	0.02
368	688079	美迪凯	11,000	338,250.00	0.02
369	688819	天能股份	15,082	334,820.40	0.02
370	688125	安达智能	2,000	327,000.00	0.02
371	688173	希荻微	17,042	326,183.88	0.02
372	688655	迅捷兴	5,694	304,970.64	0.02
373	688522	纳睿雷达	14,966	299,619.32	0.02
374	688281	华秦科技	5,880	295,352.40	0.02
375	688228	开普云	3,800	293,892.00	0.02
376	688550	瑞联新材	5,000	289,250.00	0.02
377	688553	汇宇制药	26,888	285,819.44	0.02
378	688326	经纬恒润	4,000	283,520.00	0.02
379	688669	聚石化学	2,644	282,908.00	0.02
380	688269	凯立新材	8,632	273,720.72	0.02
381	688319	欧林生物	6,200	272,676.00	0.02
382	688247	宣泰医药	36,117	271,599.84	0.02
383	688798	艾为电子	3,600	263,952.00	0.02
384	688376	美埃科技	2,200	255,860.00	0.02
385	688275	万润新能	2,000	255,100.00	0.02
386	688010	福光股份	5,200	252,876.00	0.02

387	688561	奇安信	10,495	251,670.10	0.02
388	688071	华依科技	6,800	247,792.00	0.02
389	688591	泰凌微	6,989	240,281.82	0.01
390	688011	新光光电	3,418	238,815.66	0.01
391	688029	南微医学	3,200	229,760.00	0.01
392	688512	慧智微	14,043	224,266.71	0.01
393	688298	东方生物	12,311	219,874.46	0.01
394	688115	思林杰	2,600	213,850.00	0.01
395	688016	心脉医疗	2,400	212,736.00	0.01
396	688143	长盈通	1,200	211,056.00	0.01
397	688155	先惠技术	2,600	210,314.00	0.01
398	688261	东微半导	2,000	209,860.00	0.01
399	688197	首药控股	6,200	207,142.00	0.01
400	688508	芯朋微	2,200	204,512.00	0.01
401	688419	耐科装备	2,600	204,490.00	0.01
402	688567	孚能科技	18,600	195,300.00	0.01
403	688679	通源环境	4,600	193,614.00	0.01
404	688306	均普智能	18,905	190,940.50	0.01
405	688335	复洁科技	7,874	189,290.96	0.01
406	688170	德龙激光	1,970	189,139.70	0.01
407	688218	江苏北人	3,400	186,864.00	0.01
408	688321	微芯生物	6,937	182,651.21	0.01
409	688325	赛微微电	1,400	182,574.00	0.01
410	688190	云路股份	2,000	181,420.00	0.01
411	688583	思看科技	2,080	178,401.60	0.01
412	688628	优利德	1,800	178,092.00	0.01
413	688499	利元亨	3,388	178,039.40	0.01
414	688202	美迪西	2,200	177,562.00	0.01
415	688573	信宇人	9,796	173,585.12	0.01
416	688068	热景生物	2,000	173,200.00	0.01
417	688193	仁度生物	3,000	165,900.00	0.01

418	688320	禾川科技	4,000	165,800.00	0.01
419	688311	盟升电子	6,300	164,997.00	0.01
420	688351	微电生理	7,273	164,806.18	0.01
421	688597	煜邦电力	25,124	163,306.00	0.01
422	688007	光峰科技	12,033	160,038.90	0.01
423	688211	中科微至	4,600	158,332.00	0.01
424	688323	瑞华泰	2,800	158,200.00	0.01
425	688685	迈信林	2,849	156,410.10	0.01
426	688093	世华科技	4,200	154,980.00	0.01
427	688485	九州一轨	2,400	153,744.00	0.01
428	688710	益诺思	2,278	153,081.60	0.01
429	688307	中润光学	1,913	152,944.35	0.01
430	688289	圣湘生物	10,400	149,760.00	0.01
431	688789	宏华数科	2,800	148,876.00	0.01
432	688733	壹石通	3,600	148,860.00	0.01
433	688739	成大生物	7,489	145,960.61	0.01
434	688639	华恒生物	8,975	144,856.50	0.01
435	688418	震有科技	3,000	144,240.00	0.01
436	688386	泛亚微透	1,600	143,744.00	0.01
437	688305	科德数控	2,200	143,594.00	0.01
438	688232	新点软件	7,984	141,955.52	0.01
439	688586	江航装备	12,000	140,280.00	0.01
440	688177	百奥泰	8,333	140,161.06	0.01
441	688480	赛恩斯	1,600	140,144.00	0.01
442	688562	航天软件	9,298	140,027.88	0.01
443	688439	XD振华风	3,000	138,600.00	0.01
444	688069	德林海	3,673	137,223.28	0.01
445	688659	元琛科技	12,959	135,291.96	0.01
446	688787	海天瑞声	1,000	134,450.00	0.01
447	688379	华光新材	1,600	134,448.00	0.01
448	688601	力芯微	2,200	133,210.00	0.01

449	688253	英诺特	2,200	132,616.00	0.01
450	688513	苑东生物	3,000	131,880.00	0.01
451	688697	纽威数控	9,680	131,551.20	0.01
452	688161	威高骨科	6,200	130,076.00	0.01
453	688408	中信博	4,000	128,600.00	0.01
454	688226	威腾电气	3,000	128,490.00	0.01
455	688721	龙图光罩	2,200	128,436.00	0.01
456	688139	海尔生物	4,800	126,816.00	0.01
457	688050	爱博医疗	3,400	123,930.00	0.01
458	688501	青达环保	6,382	122,534.40	0.01
459	688277	天智航	7,084	121,136.40	0.01
460	688109	品茗科技	1,594	120,665.80	0.01
461	688168	安博通	1,720	118,250.00	0.01
462	688580	伟思医疗	2,200	117,194.00	0.01
463	688750	金天钛业	7,000	116,410.00	0.01
464	688656	浩欧博	1,200	116,124.00	0.01
465	688151	华强科技	7,714	114,707.18	0.01
466	688695	中创股份	6,000	112,200.00	0.01
467	688776	国光电气	1,800	110,412.00	0.01
468	688621	阳光诺和	2,000	109,820.00	0.01
469	688276	百克生物	7,800	108,732.00	0.01
470	688219	会通股份	8,400	108,696.00	0.01
471	688626	翔宇医疗	2,400	106,224.00	0.01
472	688665	四方光电	1,600	105,120.00	0.01
473	688101	三达膜	6,236	103,081.08	0.01
474	688623	双元科技	1,000	100,460.00	0.01
475	688799	华纳药厂	2,200	98,714.00	0.01
476	688210	统联精密	2,400	97,224.00	0.01
477	688595	芯海科技	2,200	96,492.00	0.01
478	688117	圣诺生物	3,547	95,875.41	0.01
479	688185	康希诺	1,874	95,555.26	0.01

480	688095	福昕软件	1,600	95,088.00	0.01
481	688286	敏芯股份	800	92,056.00	0.01
482	688696	极米科技	1,400	90,356.00	0.01
483	688176	亚虹医药	8,800	87,296.00	0.01
484	688526	科前生物	7,200	87,120.00	0.01
485	688366	昊海生科	3,000	86,610.00	0.01
486	688237	超卓航科	1,600	85,472.00	0.01
487	688196	卓越新能	2,346	84,221.40	0.01
488	688113	联测科技	2,355	82,660.50	0.01
489	688488	艾迪药业	6,400	82,240.00	0.01
490	688566	吉贝尔	3,200	81,888.00	0.01
491	688282	理工导航	1,400	81,480.00	0.00
492	688505	复旦张江	10,800	79,704.00	0.00
493	688251	井松智能	3,068	78,632.84	0.00
494	688575	亚辉龙	8,800	77,088.00	0.00
495	688225	亚信安全	6,200	77,004.00	0.00
496	688299	长阳科技	4,400	73,524.00	0.00
497	688581	安杰思	1,400	72,394.00	0.00
498	688558	国盛智科	2,200	72,292.00	0.00
499	688768	容知日新	1,400	72,156.00	0.00
500	688607	康众医疗	1,400	71,400.00	0.00
501	688398	赛特新材	2,749	71,226.59	0.00
502	688159	有方科技	1,600	71,024.00	0.00
503	688267	中触媒	3,600	70,920.00	0.00
504	688259	创耀科技	1,800	70,416.00	0.00
505	688084	晶品特装	1,400	70,392.00	0.00
506	688057	金达莱	4,370	67,341.70	0.00
507	688039	当虹科技	1,800	67,176.00	0.00
508	688085	三友医疗	5,578	66,768.66	0.00
509	688468	科美诊断	11,722	66,698.18	0.00
510	688511	天微电子	2,200	66,462.00	0.00

511	688429	时创能源	6,453	65,756.07	0.00
512	688075	安旭生物	2,200	65,472.00	0.00
513	688186	广大特材	4,271	64,705.65	0.00
514	688389	普门科技	6,600	64,614.00	0.00
515	688391	钜泉科技	1,795	64,386.65	0.00
516	688157	松井股份	2,400	63,336.00	0.00
517	688602	康鹏科技	8,000	63,040.00	0.00
518	688716	中研股份	2,000	62,860.00	0.00
519	688357	建龙微纳	2,114	62,299.58	0.00
520	688136	科兴制药	3,000	62,130.00	0.00
521	688459	哈铁科技	7,400	61,642.00	0.00
522	688616	西力科技	6,000	60,600.00	0.00
523	688283	坤恒顺维	1,818	60,193.98	0.00
524	688657	浩辰软件	1,676	59,950.52	0.00
525	688590	新致软件	4,800	59,664.00	0.00
526	688023	安恒信息	1,600	58,752.00	0.00
527	688296	和达科技	5,120	58,572.80	0.00
528	688080	映翰通	1,353	58,517.25	0.00
529	688606	奥泰生物	1,400	57,512.00	0.00
530	688588	凌志软件	6,200	56,358.00	0.00
531	688339	亿华通	3,000	56,100.00	0.00
532	688618	三旺通信	1,800	55,386.00	0.00
533	688238	和元生物	10,104	54,763.68	0.00
534	688399	硕世生物	1,200	54,468.00	0.00
535	688130	晶华微	1,920	53,990.40	0.00
536	688592	司南导航	1,300	53,872.00	0.00
537	688171	纬德信息	1,200	52,752.00	0.00
538	688533	上声电子	2,528	52,734.08	0.00
539	688755	汉邦科技	1,900	52,364.00	0.00
540	688070	纵横股份	1,400	52,262.00	0.00
541	688569	铁科轨道	3,200	51,680.00	0.00

542	688056	莱伯泰科	800	51,640.00	0.00
543	688722	同益中	3,400	51,578.00	0.00
544	688509	正元地信	11,905	50,953.40	0.00
545	688613	奥精医疗	3,474	49,018.14	0.00
546	688329	艾隆科技	2,387	48,241.27	0.00
547	688579	地纬智能	6,200	47,058.00	0.00
548	688092	爱科科技	2,200	46,728.00	0.00
549	688229	博睿数据	600	46,020.00	0.00
550	688576	西山科技	1,094	43,595.90	0.00
551	688687	凯因科技	2,600	42,406.00	0.00
552	688310	迈得医疗	2,670	41,037.90	0.00
553	688651	盛邦安全	1,200	38,664.00	0.00
554	688435	英方软件	1,200	38,400.00	0.00
555	688638	誉辰智能	1,200	37,404.00	0.00
556	688670	金迪克	2,200	37,268.00	0.00
557	688244	永信至诚	2,502	35,678.52	0.00
558	688026	洁特生物	2,200	34,562.00	0.00
559	688426	康为世纪	1,800	33,012.00	0.00
560	688060	云涌科技	1,000	32,890.00	0.00
561	688132	邦彦技术	2,400	31,560.00	0.00
562	688013	天臣医疗	1,257	31,010.19	0.00
563	688466	金科环境	2,380	30,535.40	0.00
564	688038	中科通达	1,800	30,276.00	0.00
565	688058	宝兰德	1,400	29,288.00	0.00
566	688288	鸿泉技术	1,600	28,432.00	0.00
567	688089	嘉必优	2,664	28,265.04	0.00
568	688118	普元信息	1,400	28,168.00	0.00
569	688078	龙软科技	1,200	25,260.00	0.00
570	688681	科汇股份	1,701	23,779.98	0.00
571	688565	力源科技	2,420	22,869.00	0.00
572	688793	倍轻松	1,400	22,554.00	0.00

573	688004	博汇科技	1,200	21,840.00	0.00
574	688067	爱威科技	1,000	20,150.00	0.00
575	688217	睿昂基因	800	16,528.00	0.00
576	688701	卓锦股份	2,141	16,121.73	0.00
577	688121	卓然股份	2,200	14,256.00	0.00

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	300475	香农芯创	15,900	4,770,000.00	0.29
2	300223	北京君正	14,600	3,633,940.00	0.22
3	300613	富瀚微	44,400	3,555,552.00	0.22
4	300671	富满微	41,200	3,549,792.00	0.22
5	300373	扬杰科技	20,800	3,270,384.00	0.20
6	300458	全志科技	75,074	2,962,420.04	0.18
7	300855	图南股份	94,200	2,944,692.00	0.18
8	301165	锐捷网络	32,920	2,648,414.00	0.16
9	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.16
10	300398	飞凯材料	41,100	2,537,925.00	0.16
11	301536	星宸科技	19,500	2,509,845.00	0.15
12	301200	大族数控	6,300	2,272,095.00	0.14
13	300327	中颖电子	67,800	2,172,990.00	0.13
14	301308	江波龙	2,900	2,041,020.00	0.12
15	300323	华灿光电	92,900	1,895,160.00	0.12
16	300054	鼎龙股份	17,800	1,886,266.00	0.12
17	300604	长川科技	5,500	1,877,810.00	0.11
18	301035	润丰股份	38,859	1,803,057.60	0.11
19	300772	运达股份	144,500	1,777,350.00	0.11
20	300757	罗博特科	2,800	1,733,200.00	0.11

21	300236	上海新阳	12,700	1,670,050.00	0.10
22	300735	光弘科技	69,100	1,571,334.00	0.10
23	300726	宏达电子	18,000	1,522,260.00	0.09
24	300408	三环集团	8,900	1,485,410.00	0.09
25	300620	光库科技	3,900	1,474,980.00	0.09
26	301511	德福科技	9,700	1,395,345.00	0.09
27	301358	湖南裕能	18,000	1,365,660.00	0.08
28	300821	东岳硅材	63,800	1,311,728.00	0.08
29	300687	赛意信息	41,900	1,298,900.00	0.08
30	300666	江丰电子	3,400	1,253,240.00	0.08
31	300001	特锐德	33,100	1,252,173.00	0.08
32	300723	一品红	33,500	1,248,880.00	0.08
33	301376	致欧科技	69,900	1,238,628.00	0.08
34	300548	长芯博创	4,400	1,223,200.00	0.07
35	300395	菲利华	9,100	1,216,943.00	0.07
36	300298	三诺生物	87,000	1,213,650.00	0.07
37	300655	晶瑞电材	54,795	1,173,708.90	0.07
38	300308	中际旭创	900	1,143,000.00	0.07
39	301260	格力博	84,400	1,140,244.00	0.07
40	300053	航宇微	67,900	1,116,955.00	0.07
41	300476	胜宏科技	3,200	1,108,576.00	0.07
42	300661	圣邦股份	7,700	1,104,796.00	0.07
43	300750	宁德时代	2,800	1,100,428.00	0.07
44	301510	固高科技	34,100	1,088,813.00	0.07
45	300255	常山药业	46,300	1,084,346.00	0.07
46	300073	当升科技	22,400	1,076,096.00	0.07
47	300456	赛微电子	24,800	1,053,256.00	0.06
48	300357	我武生物	45,100	1,051,732.00	0.06
49	300765	石药创新	37,800	1,029,294.00	0.06
50	300773	拉卡拉	65,060	995,418.00	0.06
51	300602	飞荣达	19,200	983,040.00	0.06

52	300257	开山股份	33,700	966,516.00	0.06
53	300763	锦浪科技	10,200	921,570.00	0.06
54	300919	中伟新材	20,700	905,625.00	0.06
55	301029	怡合达	33,400	902,134.00	0.06
56	300014	亿纬锂能	13,700	890,911.00	0.05
57	301039	中集车辆	125,300	883,365.00	0.05
58	300085	银之杰	23,700	828,789.00	0.05
59	300442	润泽科技	9,600	797,472.00	0.05
60	301363	美好医疗	41,740	765,094.20	0.05
61	300596	利安隆	14,400	755,712.00	0.05
62	300296	利亚德	133,300	746,480.00	0.05
63	300454	深信服	7,600	731,120.00	0.04
64	300059	东方财富	34,400	701,072.00	0.04
65	300008	天海防务	114,300	692,658.00	0.04
66	300224	正海磁材	51,900	691,827.00	0.04
67	300869	康泰医学	65,700	679,338.00	0.04
68	300033	同花顺	2,800	674,800.00	0.04
69	300725	药石科技	18,200	666,120.00	0.04
70	300003	乐普医疗	55,500	657,675.00	0.04
71	300699	光威复材	22,600	647,490.00	0.04
72	300433	蓝思科技	11,500	617,090.00	0.04
73	300130	新国都	28,900	608,056.00	0.04
74	300207	欣旺达	31,800	603,882.00	0.04
75	300913	兆龙互连	11,800	565,338.00	0.03
76	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
77	300775	三角防务	25,400	559,816.00	0.03
78	300171	东富龙	50,000	553,000.00	0.03
79	300850	新强联	20,300	544,040.00	0.03
80	300568	星源材质	28,100	526,032.00	0.03
81	300782	卓胜微	4,800	525,984.00	0.03
82	300316	晶盛机电	8,700	525,480.00	0.03

83	001248	华润新能源	50,294	508,472.34	0.03
84	300348	长亮科技	57,100	502,480.00	0.03
85	300777	中简科技	18,900	496,692.00	0.03
86	301069	凯盛新材	24,600	492,984.00	0.03
87	300077	国民技术	15,700	492,195.00	0.03
88	300972	万辰集团	2,800	485,548.00	0.03
89	301236	软通动力	11,000	466,950.00	0.03
90	300346	南大光电	5,000	463,250.00	0.03
91	300751	迈为股份	1,600	451,936.00	0.03
92	300364	中文在线	18,200	429,338.00	0.03
93	300390	天华新能	4,200	392,742.00	0.02
94	301090	华润材料	55,900	350,493.00	0.02
95	300080	易成新能	91,000	342,160.00	0.02
96	300009	安科生物	41,500	325,775.00	0.02
97	301031	中熔电气	2,695	321,917.75	0.02
98	300450	先导智能	7,600	309,472.00	0.02
99	300682	朗新科技	30,300	299,970.00	0.02
100	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
101	300779	惠城环保	5,780	290,156.00	0.02
102	300738	奥飞数据	14,100	285,102.00	0.02
103	301559	中集环科	23,200	282,808.00	0.02
104	300866	安克创新	2,700	282,150.00	0.02
105	300274	阳光电源	1,700	270,334.00	0.02
106	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
107	301207	华兰疫苗	15,900	259,011.00	0.02
108	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
109	300438	鹏辉能源	3,100	256,835.00	0.02
110	300474	景嘉微	4,100	247,968.00	0.02
111	302132	中航成飞	4,100	239,112.00	0.01
112	688820	盛合晶微	1,486	210,254.14	0.01
113	300857	协创数据	600	203,940.00	0.01

114	300185	通裕重工	69,700	190,281.00	0.01
115	300502	新易盛	280	169,960.00	0.01
116	301316	慧博云通	4,300	169,334.00	0.01
117	301205	联特科技	500	167,050.00	0.01
118	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
119	001399	C惠科	5,754	159,558.42	0.01
120	300747	锐科激光	2,500	132,725.00	0.01
121	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
122	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
123	300124	汇川技术	1,600	106,128.00	0.01
124	300693	盛弘股份	2,100	102,375.00	0.01
125	300347	泰格医药	2,100	100,800.00	0.01
126	688797	C臻宝	207	97,014.69	0.01
127	301219	腾远钴业	1,700	93,160.00	0.01
128	300759	康龙化成	3,175	91,852.75	0.01
129	300677	英科医疗	2,300	90,091.00	0.01
130	300760	迈瑞医疗	600	81,498.00	0.00
131	300861	美畅股份	3,000	75,570.00	0.00
132	300037	新宙邦	800	74,280.00	0.00
133	301153	中科江南	4,400	71,676.00	0.00
134	300628	亿联网络	2,000	67,640.00	0.00
135	300049	福瑞医科	1,700	66,096.00	0.00
136	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
137	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
138	300496	中科创达	700	43,253.00	0.00
139	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
140	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
141	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
142	300676	华大基因	800	28,048.00	0.00
143	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
144	300002	神州泰岳	2,900	22,649.00	0.00

145	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
146	300910	瑞丰新材	800	22,432.00	0.00
147	300529	健帆生物	1,400	21,560.00	0.00
148	300463	迈克生物	2,500	20,650.00	0.00
149	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
150	300036	超图软件	1,700	19,159.00	0.00
151	300079	数码视讯	4,500	18,900.00	0.00
152	301339	通行宝	1,840	18,823.20	0.00
153	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
154	300070	碧水源	5,800	18,502.00	0.00
155	300601	康泰生物	1,600	18,144.00	0.00
156	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
157	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
158	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
159	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
160	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
161	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
162	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
163	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
164	300748	金力永磁	400	12,340.00	0.00
165	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
166	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
167	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
168	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
169	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
170	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
171	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
172	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
173	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
174	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
175	920189	康美特	200	1,628.00	0.00

176	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
177	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	688795	摩尔线程	22,611,292.55	1.89
2	688802	沐曦股份	20,057,873.14	1.68
3	688411	海博思创	6,679,765.60	0.56
4	688256	寒武纪	6,647,523.37	0.56
5	688110	东芯股份	5,529,046.10	0.46
6	688167	炬光科技	5,443,353.38	0.45
7	688560	明冠新材	5,314,065.85	0.44
8	688766	普冉股份	5,292,502.98	0.44
9	688332	中科蓝讯	5,020,131.62	0.42
10	688585	上纬新材	5,006,169.27	0.42
11	688266	泽璟制药	4,970,276.73	0.42
12	688777	中控技术	4,830,677.66	0.40
13	688166	博瑞医药	4,700,487.19	0.39
14	688433	华曙高科	4,655,789.28	0.39
15	688279	峰岬科技	4,617,668.94	0.39
16	688686	奥普特	4,555,524.94	0.38
17	688221	前沿生物	4,542,027.08	0.38
18	688052	纳芯微	4,528,799.53	0.38
19	688737	中自科技	4,458,274.55	0.37
20	688001	华兴源创	4,451,468.61	0.37

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	688041	海光信息	25,194,204.34	2.10
2	688256	寒武纪	24,013,025.25	2.01
3	688008	澜起科技	11,025,894.78	0.92
4	688981	中芯国际	8,940,464.78	0.75
5	688183	生益电子	8,097,501.03	0.68
6	688012	中微公司	8,061,016.30	0.67
7	688308	欧科亿	8,054,526.30	0.67
8	688270	ST臻镭	7,963,165.20	0.67
9	688258	卓易信息	7,798,153.48	0.65
10	688072	拓荆科技	7,760,550.74	0.65
11	688167	炬光科技	7,309,588.89	0.61
12	688146	中船特气	7,032,000.50	0.59
13	688668	鼎通科技	6,721,549.55	0.56
14	688123	聚辰股份	6,535,846.29	0.55
15	688111	金山办公	6,443,708.57	0.54
16	688127	蓝特光学	6,404,533.77	0.53
17	688295	中复神鹰	6,357,382.54	0.53
18	688775	影石创新	6,319,156.74	0.53
19	688700	东威科技	6,227,168.79	0.52
20	688506	百利天恒	6,162,233.24	0.51

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	1,105,284,177.13
卖出股票收入（成交）总额	1,285,249,757.75

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

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	24,699,529.10	1.51
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)	440,711.55	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,140,240.65	1.54

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	019785	25国债13	203,000	20,556,297.23	1.26
2	019792	25国债19	40,000	4,041,969.32	0.25
3	118068	N迪威转	1,740	273,705.19	0.02
4	118072	鼎通转债	1,350	135,004.14	0.01
5	102310	国债2513	1,000	101,262.55	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

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，均为基金合同约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	13,606,724.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,606,724.29

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

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	688072	拓荆科技	26,300,585.59	1.61	停牌
2	688795	摩尔线程	3,098,354.38	0.19	新股流通受限
3	688802	沐曦股份	2,431,230.18	0.15	新股流通受限

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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
天弘 上证 科创 板综 合指 数增 强A	10 3,2 17	4,172.43	-	-	430,665,764.21	100.00%
天弘 上证 科创 板综	87, 814	3,687.92	106,968,765.31	33.0 3%	216,881,977.07	66.97%

合指数增强C						
合计	188,694	3,998.62	106,968,765.31	14.18%	647,547,741.28	85.82%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	天弘上证科创板综合指数增强A	159,844.39	0.04%
	天弘上证科创板综合指数增强C	48,749.05	0.02%
	合计	208,593.44	0.03%

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	天弘上证科创板综合指数增强A	0
	天弘上证科创板综合指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘上证科创板综合指数增强A	0
	天弘上证科创板综合指数增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
基金合同生效日(2025年04月22日)基金份额总额	830,519,894.01	501,453,480.75
本报告期期初基金份额总额	595,577,525.49	258,204,176.92
本报告期基金总申购份额	415,174,908.52	588,251,684.69
减：本报告期基金总赎回份额	580,086,669.80	522,605,119.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	430,665,764.21	323,850,742.38

§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，宋永明先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无涉及基金托管业务的诉讼。

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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	天弘基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日
采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局天津市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（报告报送的部分内容缺失）
受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通	3	880,699,584.85	36.89%	163,770.32	35.83%	-

证券						
国信 证券	3	104,801,309.00	4.39%	20,506.06	4.49%	-
华泰 证券	3	614,109,037.30	25.73%	126,460.44	27.67%	-
中信 证券	3	787,594,065.71	32.99%	146,278.17	32.01%	-

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。

10.7.2 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
国泰海通证券	82,729.13	0.16%	-	-	-	-	-	-
国信证券	50,265,077.98	99.59%	212,600,000.00	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	16,280.00	0.03%	-	-	-	-	-	-
中信证券	108,895.25	0.22%	-	-	-	-	-	-

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指数增强型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31

3	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（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-04-09
5	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-04-09
6	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
7	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
8	2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-30
9	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-29
10	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026-06-13

§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、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、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制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日