

路博迈上证科创板综合价格指数增强型证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：路博迈基金管理（中国）有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	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	12
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合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43
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	43
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	43

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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
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	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金	
基金简称	路博迈上证科创板综合价格指数增强	
基金主代码	025364	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 30 日	
基金管理人	路博迈基金管理（中国）有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	212, 076, 040. 54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	025364	025365
报告期末下属分级 基金的份额总额	122, 042, 284. 82 份	90, 033, 755. 72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，力争在对标的指数进行有效跟踪的基础上，实现超越业绩比较基准的投资收益，力求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合价格指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0. 50%，年化跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度、年化跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，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。 本基金的投资策略主要包括股票投资策略（包括指数化投资策略、指数增强策略、港股通标的股票投资策略和存托凭证投资策略）、债券投资策略、流动性管理策略、衍生产品投资策略以及参与融资和转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		路博迈基金管理（中国）有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘铮	方圆
	联系电话	4008755888	95559
	电子邮箱	cs@nbchina.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4008755888	95559
传真		021-32063700	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 30 层 11 单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200041	200336
法定代表人		阎小庆	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.nbchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	路博迈基金管理（中国）有限公司	中国上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C
本期已实现收益	63,662,131.35	35,033,546.54
本期利润	101,371,266.59	59,106,252.77
加权平均基金份额本期利润	0.4053	0.4680
本期加权平均净值利润率	36.37%	41.55%

本期基金份额净值增长率	51.53%	51.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	38,742,132.71	28,225,842.80
期末可供分配基金份额利润	0.3174	0.3135
期末基金资产净值	184,358,235.88	135,600,500.11
期末基金份额净值	1.5106	1.5061
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	51.06%	50.61%

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

2、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，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

路博迈上证科创板综合价格指数增强 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	52.11%	2.10%	52.19%	2.24%	-0.08%	-0.14%
过去六个月	51.53%	1.98%	50.66%	2.11%	0.87%	-0.13%
自基金合同生效起至今	51.06%	1.76%	46.10%	1.94%	4.96%	-0.18%

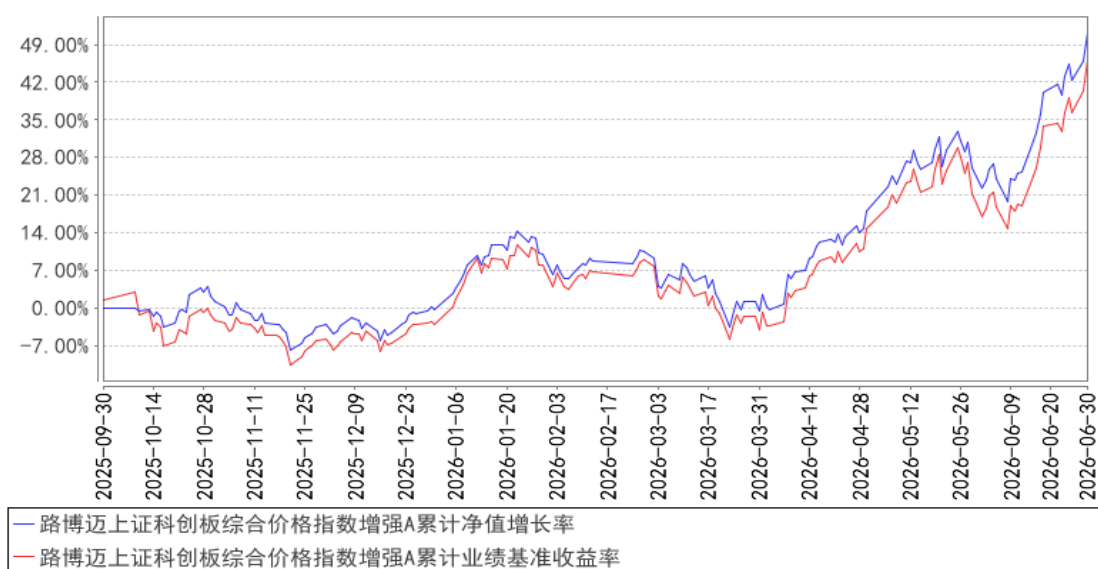
路博迈上证科创板综合价格指数增强 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

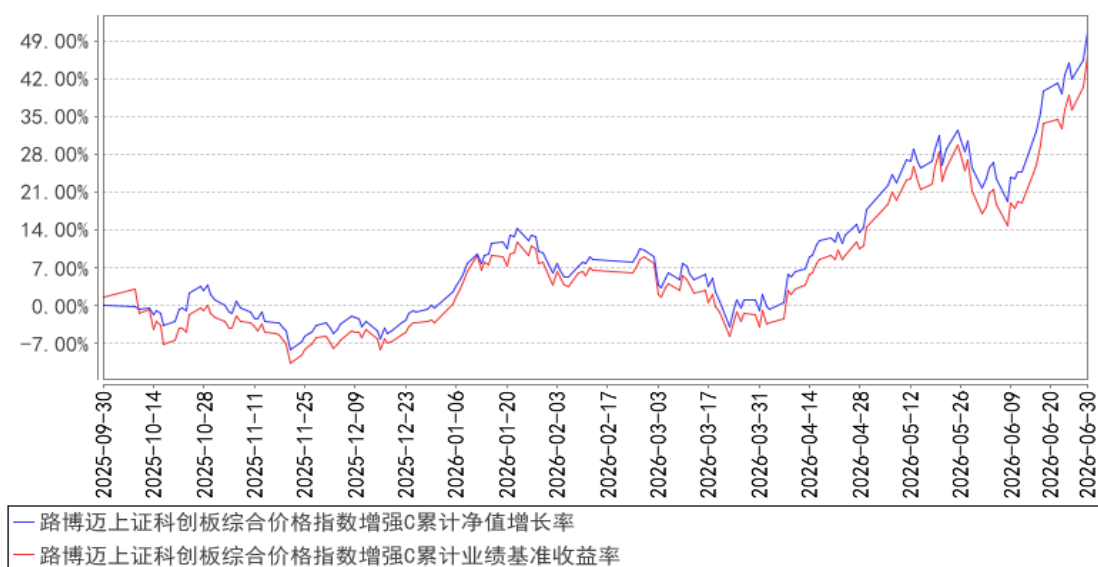
	率①	准差②	率③	④		
过去三个月	51.98%	2.10%	52.19%	2.24%	-0.21%	-0.14%
过去六个月	51.25%	1.98%	50.66%	2.11%	0.59%	-0.13%
自基金合同生效 起至今	50.61%	1.76%	46.10%	1.94%	4.51%	-0.18%

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

路博迈上证科创板综合价格指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



路博迈上证科创板综合价格指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的基金合同于 2025 年 09 月 30 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2、本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

路博迈基金管理（中国）有限公司于 2021 年 9 月 22 日经中国证券监督管理委员会《关于核准设立路博迈基金管理（中国）有限公司的批复》（证监许可[2021]3094 号）批准设立，由路博迈投资顾问有限公司（Neuberger Berman Investment Advisers LLC）全资持有。截至报告期末，公司共管理 20 只公开募集证券投资基金：路博迈护航一年持有期债券型证券投资基金、路博迈中国机遇混合型证券投资基金、路博迈中国绿色债券债券型证券投资基金、路博迈中国医疗健康股票型发起式证券投资基金、路博迈中国精选利率债债券型证券投资基金、路博迈安航 90 天持有期债券型证券投资基金、路博迈中高等级信用债债券型证券投资基金、路博迈资源精选股票型发起式证券投资基金、路博迈悦航 30 天持有期债券型证券投资基金、路博迈 CFETS0-5 年期气候变化高等级债券综合指数证券投资基金、路博迈中证 A500 指数增强型证券投资基金、路博迈兴航 60 天滚动持有债券型证券投资基金、路博迈旭航债券型证券投资基金、路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金、路博迈中债优选投资级信用债指数证券投资基金、路博迈港股通科技股票型证券投资基金、路博迈中证 A 股指数增强型证券投资基金、路博迈添航债券型证券投资基金、路博迈卓越优选混合型证券投资基金、路博迈中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩羽辰	本基金现任基金经理	2025 年 9 月 30 日	-	9 年	韩羽辰，中国国籍，纽约大学金融工程专业硕士。于 2025 年 1 月加入路博迈基金管理（中国）有限公司，现任公募多资产投资部基金经理。曾任职于光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员、投资经理、基金经理职务，负责量化产品的投资研究等工作。

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

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和
第 9 页 共 50 页

解聘日期。

3、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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在中央交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现投资组合之间存在利益输送等不公平交易行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，宏观经济在结构优化中彰显韧性。高技术制造业与科技相关产业保持强劲增长，成为支撑经济的重要引擎，传统消费与制造业则在政策呵护下逐步积蓄修复动能。GDP 运行于年度目标区间，二季度价格指标迎来标志性改善，名义增速边际回暖，内生增长活力持续释放。

A 股市场在牛市格局中演绎出鲜明的结构分化特征，以科创板和创业板为代表的科技板块大幅领

涨，传统蓝筹指数则有所调整。风格层面，成长显著跑赢价值，科技成长赛道走出独立行情，大小盘、成长与价值之间的分化达到历史极值。市场成交极为活跃，但赚钱效应高度集中，全市场近七成个股下跌，多数个股并未跟上指数涨幅，行业间首尾差距悬殊，电子、通信等 AI 相关行业表现耀眼，而商贸零售、农林牧渔、食品饮料等传统板块持续承压。资金面同样折射出极端偏好，杠杆资金持续加码，但新增融资高度集中于科技行业，对其他板块形成明显的流动性“虹吸”效应。总体而言，上半年是科技主线引领的结构性牛市，更是中国经济转型升级在资本市场的生动映射，分化中蕴藏着丰富的结构性机遇。

本基金以上证科创板综合价格指数为基准，选股模型采用机器学习框架，依托高性能算力对海量历史数据进行深度挖掘，构建符合长期市场逻辑的综合选股指标，并在控制风格行业偏离和跟踪误差的基础上优选个股构建指数增强组合，力争实现长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.5106 元，本报告期内净值增长率 51.53%，同期业绩比较基准收益率 50.66%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.5061 元，本报告期内净值增长率 51.25%，同期业绩比较基准收益率 50.66%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，积极因素正在积聚，宏观经济有望在政策加力下保持平稳向好态势。“十五五”开局之年的产业政策持续发力，新质生产力加速培育，出口依托完备产业链保持韧性，内需修复将成为政策重点发力方向，财政与货币协同发力可期，经济增速有望在筑底后温和回升，物价水平也将在需求端支撑下趋于改善，三季度将是观察名义增速修复成色的重要窗口，前景值得期待。证券市场方面，科技仍是贯穿全年的核心主线，但行情驱动力或将从估值扩张稳步切换至业绩兑现，中报季将成为验证企业盈利成色的试金石，真正具备产业趋势支撑的优质龙头将在优胜劣汰中脱颖而出，市场风格也有望从极致分化向均衡收敛，成长与价值各展所长。尽管地缘政治和通胀扰动等外部不确定性犹存，但国内政策工具箱充足，产业升级趋势不可逆转，科技板块的高景气具备基本面支撑，交易拥挤将在市场自我调节中逐步消化。行业配置上，关注 AI 产业链上业绩确定性强的硬件环节，侧重海外供应链受益方向，同时关注 AI 资本开支外溢带来的电力设备、机器人、商业航天等衍生机会；锂电池、化工、券商、创新药等处于盈利复苏通道的板块也值得密切跟踪；消费与红利板块经过持续调整后估值渐具吸引力，可逐步左侧布局。整体而言，下半年 A 股结构性机会丰富，市场有望在分化中逐步走向均衡，产业变迁与资产重估的主线清晰，值得积极把握。总的来说，2026 年或将是连接短期复苏与中长期高质量发展的重要一年。资本市场有望在盈利驱动下，呈现出机会更为多元、风格更趋均衡的特征。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，路博迈基金管理（中国）有限公司在路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由路博迈基金管理（中国）有限公司编制并经托管人复核审查的有关路博迈上证科创板综合价格指数增强型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：路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,942,577.73	39,923,747.04
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	300,094,727.19	576,555,918.59
其中：股票投资		300,094,727.19	576,555,918.59
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		371,892.56	468,767.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		322,409,197.48	616,948,432.99
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,089,970.99	1,309,794.29
应付管理人报酬		195,649.29	411,693.02
应付托管费		36,684.22	77,192.41
应付销售服务费		42,336.03	76,440.84
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	85,820.96	85,000.00
负债合计		2,450,461.49	1,960,120.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	212,076,040.54	617,155,231.80

未分配利润	6.4.7.8	107,882,695.45	-2,166,919.37
净资产合计		319,958,735.99	614,988,312.43
负债和净资产总计		322,409,197.48	616,948,432.99

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 212,076,040.54 份，其中 A 类基金份额净值 1.5106 元，基金份额 122,042,284.82 份；C 类基金份额净值 1.5061 元，基金份额 90,033,755.72 份。

6.2 利润表

会计主体：路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		162,861,012.12
1. 利息收入		33,081.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	33,081.82
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）		100,951,018.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	100,211,848.67
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	106,434.88
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	632,734.50
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	61,781,841.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	95,070.78
减：二、营业总支出		2,383,492.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,689,770.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	316,831.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	285,087.60
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. 17	-
7. 税金及附加		0. 08
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	91, 802. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		160, 477, 519. 36
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		160, 477, 519. 36
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		160, 477, 519. 36

注：本基金基金合同于 2025 年 09 月 30 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	617, 155, 231. 80	-2, 166, 919. 37	614, 988, 312. 43
二、本期期初净资产	617, 155, 231. 80	-2, 166, 919. 37	614, 988, 312. 43
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-405, 079, 191. 26	110, 049, 614. 82	-295, 029, 576. 44
（一）、综合收益总额	-	160, 477, 519. 36	160, 477, 519. 36
（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）	-405, 079, 191. 26	-50, 427, 904. 54	-455, 507, 095. 80
其中：1. 基金申购款	215, 292, 865. 47	32, 526, 430. 34	247, 819, 295. 81
2. 基金赎回款	-620, 372, 056. 73	-82, 954, 334. 88	-703, 326, 391. 61
（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	212, 076, 040. 54	107, 882, 695. 45	319, 958, 735. 99

注：本基金基金合同于 2025 年 09 月 30 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>阎小庆</u>	<u>阎小庆</u>	<u>黄恩典</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2025 年 8 月 15 日证监许可【2025】1767 号《关于准予路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规以及《路博迈上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》的规定公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。基金管理人和注册登记机构均为路博迈基金管理（中国）有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。有关基金募集文件已按规定向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 9 月 30 日正式生效，生效日的基金份额总额为 765,217,759.88 份，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验字第 2500592 号验资报告予以验证。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金还可投资于部分非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、信用衍生品、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种（包括但不限于股指期权等金融衍生品），基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准：上证科创板综合价格指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×

5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开

营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,978,135.18
等于：本金	6,976,921.56
加：应计利息	1,213.62
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	14,964,442.55
等于：本金	14,964,241.33

加：应计利息	201.22
减：坏账准备	-
合计	21,942,577.73

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		241,541,880.38	-	300,094,727.19	58,552,846.81
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		241,541,880.38	-	300,094,727.19	58,552,846.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	1,518.40
合计	85,820.96

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

路博迈上证科创板综合价格指数增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	390,689,174.20	390,689,174.20
本期申购	149,063,419.38	149,063,419.38
本期赎回（以“-”号填列）	-417,710,308.76	-417,710,308.76
本期末	122,042,284.82	122,042,284.82

路博迈上证科创板综合价格指数增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	226,466,057.60	226,466,057.60
本期申购	66,229,446.09	66,229,446.09
本期赎回（以“-”号填列）	-202,661,747.97	-202,661,747.97
本期末	90,033,755.72	90,033,755.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

路博迈上证科创板综合价格指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,586,072.80	-3,811,431.31	-1,225,358.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,586,072.80	-3,811,431.31	-1,225,358.51
本期利润	63,662,131.35	37,709,135.24	101,371,266.59
本期基金份额交易产生的变动数	-27,506,071.44	-10,323,885.58	-37,829,957.02
其中：基金申购款	13,747,130.09	6,851,919.54	20,599,049.63
基金赎回款	-41,253,201.53	-17,175,805.12	-58,429,006.65

本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,742,132.71	23,573,818.35	62,315,951.06

路博迈上证科创板综合价格指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,270,617.27	-2,212,178.13	-941,560.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,270,617.27	-2,212,178.13	-941,560.86
本期利润	35,033,546.54	24,072,706.23	59,106,252.77
本期基金份额交易产生的变动数	-8,078,321.01	-4,519,626.51	-12,597,947.52
其中：基金申购款	9,875,744.33	2,051,636.38	11,927,380.71
基金赎回款	-17,954,065.34	-6,571,262.89	-24,525,328.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,225,842.80	17,340,901.59	45,566,744.39

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	28,108.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,934.28
结算备付金利息收入	-
其他	39.39
合计	33,081.82

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,409,070,887.93
减：卖出股票成本总额	1,307,500,870.81
减：交易费用	1,358,168.45
买卖股票差价收入	100,211,848.67

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

债券投资收益——利息收入	24.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	106,410.62
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	106,434.88

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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	353,970.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	247,500.00
减：应计利息总额	24.95
减：交易费用	35.40
买卖债券差价收入	106,410.62

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	632,734.50

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	632,734.50

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	61,781,841.47
股票投资	61,781,841.47
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	61,781,841.47

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	95,069.93
转换费收入	0.85
合计	95,070.78

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费_中债登	7,500.00
合计	91,802.56

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
路博迈基金管理（中国）有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金直销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,689,770.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	834,827.29
应支付基金管理人的净管理费	854,943.30

注：支付基金管理人的基金管理费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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	316,831.93

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C	合计
交通银行股份有限公司	—	76,944.55	76,944.55
合计	—	76,944.55	76,944.55

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 9 月 30 日）持有的基金份额	267,925.68	—
报告期初持有的基金份额	267,925.68	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	267,925.68	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2195%	—

注：1、申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

2、基金管理人投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

3、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额总额。

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

本基金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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	6,978,135.18	28,108.15

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688808	联讯仪器	2026 年 04 月 16 日	6 个月	科创板打新限售	81.88	2,086.66	109	8,924.92	227,445.94	-
688820	盛合晶微	2026 年 04 月 13 日	6 个月	科创板打新限售	19.68	170.81	639	12,575.52	109,147.59	-
688818	电科蓝天	2026 年 02 月 03 日	6 个月	科创板打新限售	9.47	70.09	1,512	14,318.64	105,976.08	-
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	科创板打新限售	44.56	642.06	111	4,946.16	71,268.66	-
688785	恒运昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	科创板打新限售	92.18	462.56	116	10,692.88	53,656.96	-
688635	长进光子	2026 年 05 月 20 日	6 个月	科创板打新限售	40.98	405.52	128	5,245.44	51,906.56	-
688813	泰金新能	2026 年 03 月 24 日	6 个月	科创板打新限售	26.28	182.77	234	6,149.52	42,768.18	-
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	96.45	137	1,898.82	13,213.65	-
688816	易	2026	6 个	科创	55.95	57.08	177	9,903.15	10,103.16	-

	思维	年 02 月 04 日	月	板打新限售						
688712	北芯生命	2026 年 01 月 28 日	6 个月	科创板打新限售	17.52	35.90	234	4,099.68	8,400.60	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.57	470	5,254.60	8,257.90	-
688781	视涯科技	2026 年 03 月 18 日	6 个月	科创板打新限售	22.68	47.60	144	3,265.92	6,854.40	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	60.62	104	1,639.04	6,304.48	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.50	112	2,450.56	2,856.00	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	新股锁定	33.49	38.45	72	2,411.28	2,768.40	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.86	46	1,742.48	1,603.56	-

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年06月29日	筹划发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金事项	832.00	2026年07月13日	890.99	5,458	2,247,213.16	4,541,056.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数增强基金，以上证科创板综合价格指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。其预期风险与收益理论上高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人制定了内部管理制度和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险管理机构由董事会及风险控制委员会、总经理及风险管理委员会、督察长、风控负责人、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。公司各部门或岗位之间的监督制约，构成风险控制的第一道监控防线；

由公司总经理负责，风险管理委员会、投资决策委员会、督察长、风控负责人、法律合规部和风险管理部构成风险控制的第二道监控防线；在董事会领导下，风险控制委员会负责内部控制和风险管理的决策，构成了风险控制的第三道监控防线。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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。

流动性风险发生时，本基金的基金管理人按流动性风险处置预案处理。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金和债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,942,577.73	-	-	-	21,942,577.73
交易性金融资产	-	-	-	300,094,727.19	300,094,727.19
应收申购款	-	-	-	371,892.56	371,892.56
资产总计	21,942,577.73	-	-	300,466,619.75	322,409,197.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,089,970.99	2,089,970.99
应付管理人报酬	-	-	-	195,649.29	195,649.29
应付托管费	-	-	-	36,684.22	36,684.22

应付销售服务费	-	-	-	42,336.03	42,336.03
其他负债	-	-	-	85,820.96	85,820.96
负债总计	-	-	-	2,450,461.49	2,450,461.49
利率敏感度缺口	21,942,577.73	-	-	-298,016,158.26	319,958,735.99
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	39,923,747.04	-	-	-	39,923,747.04
交易性金融资产	-	-	-	-576,555,918.59	576,555,918.59
应收申购款	-	-	-	468,767.36	468,767.36
资产总计	39,923,747.04	-	-	-577,024,685.95	616,948,432.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,309,794.29	1,309,794.29
应付管理人报酬	-	-	-	411,693.02	411,693.02
应付托管费	-	-	-	77,192.41	77,192.41
应付销售服务费	-	-	-	76,440.84	76,440.84
其他负债	-	-	-	85,000.00	85,000.00
负债总计	-	-	-	1,960,120.56	1,960,120.56
利率敏感度缺口	39,923,747.04	-	-	-575,064,565.39	614,988,312.43

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行利率的敏感性分析。

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、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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	300,094,727.19	93.79	576,555,918.59	93.75
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	300,094,727.19	93.79	576,555,918.59	93.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准之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 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	14,660,262.67	22,260,831.43
	业绩比较基准下降 5%	-14,660,262.67	-22,260,831.43

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	294,831,139.07	560,697,444.40
第二层次	4,541,056.00	15,799,541.60
第三层次	722,532.12	58,932.59
合计	300,094,727.19	576,555,918.59

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	300,094,727.19	93.08

	其中：股票	300,094,727.19	93.08
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	21,942,577.73	6.81
8	其他各项资产	371,892.56	0.12
9	合计	322,409,197.48	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	208,129,856.00	65.05
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	45,729,216.09	14.29
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	1,329,160.58	0.42
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	255,188,232.67	79.76

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	37,132,829.52	11.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,594,943.00	0.81
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	2,879,922.00	0.90
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	1,257,410.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,041,390.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,906,494.52	14.04

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	11,476	18,310,531.80	5.72
2	688041	海光信息	49,036	18,158,030.80	5.68
3	688012	中微公司	21,532	10,087,742.00	3.15
4	688008	澜起科技	26,887	8,332,281.30	2.60
5	688981	中芯国际	49,400	7,845,708.00	2.45
6	688525	佰维存储	12,340	6,104,968.20	1.91
7	688795	摩尔线程	7,115	5,097,826.35	1.59
8	688146	中船特气	14,346	5,020,956.54	1.57
9	688802	沐曦股份	5,836	4,833,958.80	1.51
10	688072	拓荆科技	5,458	4,541,056.00	1.42
11	688347	华虹宏力	12,032	4,046,361.60	1.26
12	688396	华润微	40,530	3,953,701.50	1.24
13	688766	普冉股份	4,700	3,603,020.00	1.13
14	688409	富创精密	11,479	3,515,443.75	1.10
15	688110	东芯股份	16,441	3,349,031.70	1.05
16	688111	金山办公	15,486	3,299,292.30	1.03
17	688519	南亚新材	8,306	3,156,612.24	0.99
18	688002	睿创微纳	19,408	3,002,223.52	0.94
19	688498	源杰科技	1,590	2,998,740.00	0.94
20	688220	翱捷科技	22,215	2,761,768.80	0.86
21	688082	盛美上海	6,114	2,641,248.00	0.83
22	688578	艾力斯	23,205	2,533,986.00	0.79
23	688503	聚和材料	18,438	2,446,722.60	0.76
24	688536	思瑞浦	6,642	2,418,285.78	0.76
25	688630	芯碁微装	4,322	2,374,463.58	0.74
26	688025	杰普特	4,914	2,309,580.00	0.72
27	688521	芯原股份	6,083	2,257,644.62	0.71
28	688127	蓝特光学	22,847	2,229,867.20	0.70
29	688257	新锐股份	21,351	2,175,666.90	0.68
30	688279	峰昭科技	9,196	2,063,950.24	0.65
31	688603	天承科技	9,898	2,058,289.10	0.64
32	688778	厦钨新能	37,813	2,057,027.20	0.64
33	688535	华海诚科	10,975	2,052,325.00	0.64
34	688380	中微半导	31,131	2,051,844.21	0.64
35	688800	瑞可达	21,117	2,026,598.49	0.63
36	688400	凌云光	30,510	2,019,762.00	0.63
37	688692	达梦数据	8,264	2,018,812.56	0.63
38	688005	容百科技	65,655	2,009,043.00	0.63

39	688235	百济神州	7,685	1,956,677.85	0.61
40	688385	复旦微电	27,162	1,936,378.98	0.61
41	688615	合合信息	17,082	1,931,974.20	0.60
42	688275	万润新能	14,400	1,836,720.00	0.57
43	688779	五矿新能	225,846	1,831,611.06	0.57
44	688180	君实生物	53,344	1,804,094.08	0.56
45	688758	赛分科技	81,898	1,802,574.98	0.56
46	688388	嘉元科技	40,949	1,801,756.00	0.56
47	688258	卓易信息	15,184	1,799,911.36	0.56
48	688155	先惠技术	22,216	1,797,052.24	0.56
49	688401	路维光电	18,693	1,794,154.14	0.56
50	688416	恒烁股份	12,809	1,793,260.00	0.56
51	688678	福立旺	74,104	1,791,093.68	0.56
52	688378	奥来德	28,771	1,783,802.00	0.56
53	688088	虹软科技	50,123	1,781,872.65	0.56
54	688351	微电生理	77,988	1,767,208.08	0.55
55	688337	普源精电	23,141	1,733,955.13	0.54
56	688475	萤石网络	63,252	1,729,942.20	0.54
57	688586	江航装备	145,551	1,701,491.19	0.53
58	688049	炬芯科技	36,271	1,701,472.61	0.53
59	688090	瑞松科技	15,747	1,676,268.15	0.52
60	688231	隆达股份	45,360	1,666,072.80	0.52
61	688577	浙海德曼	36,305	1,663,858.15	0.52
62	688683	莱尔科技	42,365	1,606,480.80	0.50
63	688410	山外山	111,561	1,602,015.96	0.50
64	688095	福昕软件	26,876	1,597,240.68	0.50
65	688255	凯尔达	56,845	1,580,291.00	0.49
66	688633	星球石墨	52,859	1,571,498.07	0.49
67	688291	金橙子	26,861	1,570,831.28	0.49
68	688210	统联精密	38,171	1,546,307.21	0.48
69	688215	瑞晟智能	38,446	1,543,991.36	0.48
70	688045	必易微	19,018	1,536,274.04	0.48
71	688081	兴图新科	37,349	1,526,827.12	0.48
72	688021	奥福科技	75,856	1,468,572.16	0.46
73	688173	希荻微	76,670	1,467,463.80	0.46
74	688702	盛科通信	3,740	1,458,562.60	0.46
75	688311	盟升电子	55,264	1,447,364.16	0.45
76	688176	亚虹医药	145,048	1,438,876.16	0.45
77	688120	华海清科	4,300	1,385,374.00	0.43
78	688320	禾川科技	33,384	1,383,766.80	0.43
79	688247	宣泰医药	182,890	1,375,332.80	0.43
80	688755	汉邦科技	49,787	1,372,129.72	0.43
81	688293	奥浦迈	31,882	1,329,160.58	0.42

82	688197	首药控股	38,548	1,287,888.68	0.40
83	688373	盟科药业	282,024	1,277,568.72	0.40
84	688361	中科飞测	2,955	1,270,650.00	0.40
85	688518	联赢激光	41,096	1,269,866.40	0.40
86	688626	翔宇医疗	26,086	1,154,566.36	0.36
87	688203	海正生材	115,080	1,148,498.40	0.36
88	688188	柏楚电子	9,625	1,026,987.50	0.32
89	688399	硕世生物	22,476	1,020,185.64	0.32
90	688126	沪硅产业	23,936	954,807.04	0.30
91	688221	前沿生物	41,837	937,148.80	0.29
92	688249	晶合集成	15,816	933,618.48	0.29
93	688172	燕东微	10,739	898,424.74	0.28
94	688548	广钢气体	16,600	864,860.00	0.27
95	688737	中自科技	43,478	832,168.92	0.26
96	688506	百利天恒	2,817	828,282.51	0.26
97	688183	生益电子	5,980	791,752.00	0.25
98	688223	晶科能源	156,083	741,394.25	0.23
99	688130	晶华微	25,364	713,235.68	0.22
100	688609	九联科技	63,412	698,166.12	0.22
101	688271	联影医疗	6,386	646,454.78	0.20
102	688035	德邦科技	5,919	543,364.20	0.17
103	688200	华峰测控	959	503,570.90	0.16
104	688777	中控技术	4,054	476,345.00	0.15
105	688531	日联科技	2,673	475,366.32	0.15
106	688530	欧莱新材	3,104	300,777.60	0.09
107	688345	博力威	4,879	283,372.32	0.09
108	688469	芯联集成	25,555	271,138.55	0.08
109	688313	仕佳光子	1,106	204,222.90	0.06
110	688036	传音控股	3,013	177,616.35	0.06

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	603061	金海通	3,200	1,607,104.00	0.50
2	300497	富祥股份	68,500	1,517,960.00	0.47
3	688729	屹唐股份	35,235	1,515,105.00	0.47
4	301219	腾远钴业	27,370	1,499,876.00	0.47
5	301358	湖南裕能	19,700	1,494,639.00	0.47
6	300054	鼎龙股份	14,100	1,494,177.00	0.47
7	301246	宏源药业	55,400	1,490,260.00	0.47
8	001298	好上好	71,700	1,487,775.00	0.46
9	300438	鹏辉能源	17,900	1,483,015.00	0.46
10	002636	金安国纪	12,300	1,475,631.00	0.46

11	688727	恒坤新材	19,667	1,471,091.60	0.46
12	603986	兆易创新	1,800	1,467,000.00	0.46
13	603031	安孚科技	27,400	1,459,050.00	0.46
14	301536	星辰科技	11,300	1,454,423.00	0.45
15	601988	中国银行	253,200	1,448,304.00	0.45
16	301631	壹连科技	20,080	1,442,948.80	0.45
17	600320	振华重工	349,300	1,442,609.00	0.45
18	603507	振江股份	43,600	1,434,004.00	0.45
19	300750	宁德时代	3,500	1,375,535.00	0.43
20	002338	奥普光电	23,600	1,349,920.00	0.42
21	600183	生益科技	7,600	1,317,840.00	0.41
22	002266	浙富控股	248,500	1,257,410.00	0.39
23	601398	工商银行	171,300	1,211,091.00	0.38
24	002154	报喜鸟	335,200	1,193,312.00	0.37
25	601579	会稽山	79,900	1,173,731.00	0.37
26	002780	三夫户外	91,200	1,107,168.00	0.35
27	300919	中伟新材	24,700	1,080,625.00	0.34
28	002340	格林美	162,200	1,072,142.00	0.34
29	301239	普瑞眼科	34,200	1,041,390.00	0.33
30	600549	厦门钨业	11,900	1,013,880.00	0.32
31	000807	云铝股份	44,400	983,016.00	0.31
32	603518	锦泓集团	83,800	599,170.00	0.19
33	601138	工业富联	7,900	569,985.00	0.18
34	002545	东方铁塔	23,500	381,170.00	0.12
35	001389	广合科技	1,200	284,700.00	0.09
36	301608	博实结	5,300	266,378.00	0.08
37	688808	联讯仪器	109	227,445.94	0.07
38	601939	建设银行	22,900	220,527.00	0.07
39	688820	盛合晶微	639	109,147.59	0.03
40	688818	电科蓝天	1,512	105,976.08	0.03
41	688797	臻宝科技	111	71,268.66	0.02
42	688785	恒运昌	116	53,656.96	0.02
43	688635	长进光子	128	51,906.56	0.02
44	688813	泰金新能	234	42,768.18	0.01
45	603407	长裕集团	137	13,213.65	0.00
46	688816	易思维	177	10,103.16	0.00
47	688712	北芯生命	234	8,400.60	0.00
48	601112	振石股份	470	8,257.90	0.00
49	688781	视涯科技	144	6,854.40	0.00
50	603435	嘉德利	104	6,304.48	0.00
51	603352	至信股份	112	2,856.00	0.00
52	603293	埃泰克	72	2,768.40	0.00
53	603284	林平发展	46	1,603.56	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	688012	中微公司	10,134,143.25	1.65
2	688795	摩尔线程	9,496,734.34	1.54
3	688146	中船特气	9,019,494.15	1.47
4	688702	盛科通信	8,691,604.05	1.41
5	688258	卓易信息	8,509,478.64	1.38
6	688469	芯联集成	8,494,420.38	1.38
7	688256	寒武纪	8,057,850.43	1.31
8	688802	沐曦股份	7,622,414.81	1.24
9	688766	普冉股份	7,321,865.61	1.19
10	688041	海光信息	7,278,909.53	1.18
11	688297	中无人机	7,244,188.22	1.18
12	688049	炬芯科技	7,146,278.51	1.16
13	688035	德邦科技	6,728,559.07	1.09
14	688072	拓荆科技	6,598,043.93	1.07
15	688279	峰昭科技	6,580,392.29	1.07
16	688548	广钢气体	6,555,087.32	1.07
17	688183	生益电子	6,476,997.65	1.05
18	688361	中科飞测	6,302,913.83	1.02
19	688543	国科军工	6,181,525.77	1.01
20	688615	合合信息	6,116,278.08	0.99

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	34,710,427.44	5.64
2	688256	寒武纪	31,285,460.76	5.09
3	688012	中微公司	20,640,046.84	3.36
4	688981	中芯国际	15,987,801.17	2.60
5	688008	澜起科技	12,397,367.25	2.02
6	688548	广钢气体	11,859,189.97	1.93
7	688183	生益电子	11,039,014.91	1.79
8	688331	荣昌生物	10,715,560.60	1.74
9	688146	中船特气	10,662,310.55	1.73
10	688200	华峰测控	10,218,606.61	1.66
11	688258	卓易信息	9,558,410.17	1.55
12	688213	思特威	9,239,259.25	1.50

13	688072	拓荆科技	9,196,579.77	1.50
14	688702	盛科通信	8,897,546.31	1.45
15	688216	气派科技	8,891,296.21	1.45
16	688049	炬芯科技	8,771,776.00	1.43
17	688525	佰维存储	8,680,609.15	1.41
18	688400	凌云光	8,641,373.07	1.41
19	688469	芯联集成	8,399,165.25	1.37
20	688766	普冉股份	8,093,953.66	1.32

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	969,257,837.94
卖出股票收入（成交）总额	1,409,070,887.93

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，并考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，降低投资组合的整体风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金将结合对宏观经济形势和证券趋势的判断，通过对债券市场进行定性和定量的分析，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期

货来提高投资组合的运作效率。在国债期货投资过程中，本基金将对国债期货和现货基差、国债期货的流动性水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	371,892.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	371,892.56

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	4,541,056.00	1.42	停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中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，投资组合报告中市值占净值比例的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（%）
路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	1,181	103,338.09	3,515,547.75	2.8806	118,526,737.07	97.1194
路博迈上证科创板综合价格指数增强 C	9,334	9,645.78	—	—	90,033,755.72	100.0000
合计	10,467	20,261.40	3,515,547.75	1.6577	208,560,492.79	98.3423

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

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	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	1,608,506.17	1.3180
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C	453,602.23	0.5038
	合计	2,062,108.40	0.9723

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	50~100
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	0
	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	路博迈上证科创板综合价格指数增强 A	路博迈上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 09 月 30 日）基金份额总额	456,656,102.63	308,561,657.25
本报告期期初基金份额总额	390,689,174.20	226,466,057.60
本报告期基金总申购份额	149,063,419.38	66,229,446.09
减：本报告期基金总赎回份额	417,710,308.76	202,661,747.97
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	122,042,284.82	90,033,755.72

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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，基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内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

本报告期内本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况**10.6.1 管理人受调查或处罚等情况**

报告期内管理人无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，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的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中金财富证券	2	2,377,392,220.89	100.00	501,246.26	100.00	-

注：1、交易单元的选择标准：

(1) 公司实力雄厚，信誉良好；

(2) 公司研究实力较强，研究机构和专门的研究人员能为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(3) 公司财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(4) 公司经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运

作高度保密的要求；

(5) 公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，可以为公司开展交易提供必要的交易终端，若交易终端无法满足基金产品正常交易需求的，可在确保合规与风险可控的前提下接入公司的信息系统，并能为基金提供全面的信息服务。

2、交易单元的选择流程：

各相关部门按照研究能力、运营能力、交易服务和合规情况对拟进行合作的证券公司进行打分后建立白名单，在白名单中选定合作的证券公司。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中金财富证券	353,970.97	100.00	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-14
2	路博迈上证科创板综合价格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
3	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分权益类公募基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-23
4	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-13
5	路博迈上证科创板综合价格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	2026-03-30
6	路博迈基金管理（中国）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	2026-03-30
7	路博迈上证科创板综合价格指数增	中国证监会规定媒介	2026-04-22

	强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告		
8	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-23
9	2025 年度路博迈基金管理（中国）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	2026-04-24
10	路博迈基金管理（中国）有限公司关于旗下部分基金新增汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告截止日至报告送出日之间，基金管理人发生如下高级管理人员变动：基金管理人于 2026 年 8 月 1 日发布《路博迈基金管理（中国）有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2026 年 7 月 30 日起，刘铮女士担任公司督察长，林海中先生因个人原因不再担任公司督察长。
--

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市静安区石门一路 288 号香港兴业中心二座 7 楼 705-710 室

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人路博迈基金管理（中国）有限公司。

咨询电话：400-875-5888

公司网址：www.nbchina.com

路博迈基金管理（中国）有限公司

2026 年 8 月 28 日