

**新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起
式联接基金**

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月二十八日

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 2 月 10 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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	7
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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末投资目标基金明细	42
7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.4 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	43
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.6 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.7 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	44
7.8 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	44
7.9 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	44
7.10 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	45
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.13 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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的情况	47
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	47
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	48
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.8 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	49
10.9 其他重大事件	50
11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	新华中证云计算 50ETF 发起式联接	
基金主代码	025790	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 2 月 10 日	
基金管理人	新华基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,267,252.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	025790	025791
报告期末下属分级基金的份额总额	11,981,159.11 份	8,286,092.89 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 5 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 8 月 25 日
基金管理人名称	新华基金管理股份有限公司
基金托管人名称	招商证券股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便投资人通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。 本基金的投资策略包括：资产配置策略、目标 ETF 策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货、国债期货交易策略、参与融资及转融

	通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证云计算 50 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证云计算 50 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

注：新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金场内简称为“云 50ETF”，扩位简称“云计算 50ETF 新华”。

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		新华基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	韩鑫普
	联系电话	010-68779688	0755-82943666
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008198866	95565
传真		010-68779528	0755-82960794

注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层,北京市西 城区平安里西大街26号新时代 大厦9层、11层	深圳市福田区福田街道福华一 路111号
邮政编码	400010	518000
法定代表人	银国宏	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 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 2 月 10 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)	
	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	新华中证云计算 50ETF 发 起式联接 C
本期已实现收益	67,694.25	38,197.01
本期利润	782,963.97	194,600.02
加权平均基金份额本期利润	0.0676	0.0351
本期加权平均净值利润率	6.57%	3.38%
本期基金份额净值增长率	7.18%	7.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	新华中证云计算 50ETF 发 起式联接 A	新华中证云计算 50ETF 发起 式联接 C
期末可供分配利润	66,581.76	39,377.79
期末可供分配基金份额利润	0.0056	0.0048
期末基金资产净值	12,841,161.89	8,873,920.29

期末基金份额净值	1.0718	1.0709
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C
基金份额累计净值增长率	7.18%	7.09%

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、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，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）。

4、本基金合同于 2026 年 2 月 10 日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

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

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.71%	2.52%	16.25%	2.58%	-0.54%	-0.06%
自基金合同生效起至今	7.18%	2.36%	8.57%	2.44%	-1.39%	-0.08%

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	15.64%	2.52%	16.25%	2.58%	-0.61%	-0.06%
自基金合同生效起至今	7.09%	2.35%	8.57%	2.44%	-1.48%	-0.09%

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

新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2026 年 2 月 10 日至 2026 年 6 月 30 日）

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A



新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C



注：1、本基金合同于 2026 年 2 月 10 日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、新华科技优选混合型发起式证券投资基金、新华低碳经济混合型发起式证券投资基金、新华医疗创新混合型发起式证券投资基金、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、新华锦利债券型证券投资基金、新华科技甄选混合型发起式证券投资基金、新华数字经

济混合型发起式证券投资基金、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
邓岳	本基金基金经理，指数与量化投资部总监，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金基金经理。	2026-02-10	-	17	信息与信号处理专业硕士,曾任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员,国信证券股份有限公司量化研究员,光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理,盈融达投资（北京）有限公司投资经理。
陈熵	本基金基金经理助理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理助理、新华沪	2026-03-02	-	8	计算机专业博士，曾任华润元大基金管理有限公司量化研究员、专户投资经理助理、投资经理。

	深 300 指数增强型证券投资基金基金经理助理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理助理。				
--	--	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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% 情形。

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，市场整体震荡，波动较大。上证指数再创新高，最高 4258.86 点，随后震荡回调。全市场日均交易额超过 2.5 万亿，整体交易热度继续升高。宽基指数中，偏中小盘的中证 500 和中证 1000 涨幅超过 15%，偏大盘的沪深 300 和更小盘的中证 2000 涨幅不超过 10%，呈现出中间高两头弱的分化格局。其他风格上，中证红利指数为代表的红利风格与市场整体走势反向，中证红利、红利低波指数跌幅在 10% 附近，表现远落后于宽基指数。行业层面更是冰火两重天，30 个中信行业中，仅 9 个行业收益为正，排在前列的电子、通信，涨幅都超过 70%，其他行业收益都远远落后于这两个行业，表现较差的消费者服务、综合金融涨幅都在 -30% 附近。从中可以看出，上半年市场主线就是科技。科技的大行情除了受益于本轮 AI 技术大发展，也中国的政策导向从传统制造业，转向科技创新有非常重大的关系，科技创新有望成为中国经济新的发展动力。

上半年美伊冲突对全球带来了较大的冲击，油价的上下波动幅度很大，给全球实体经济和金融市场都带来了巨大的影响。后期美伊虽然签订了谅解备忘录出现了阶段性缓和，但很快又恢复军事摩擦，油价也随着冲突的激烈程度而上下波动。但美国自身有通胀和债务的压力，对降油价和降息的诉求很强烈，且美国对伊朗短期内难以实现既定战略目标，因此，双方短期内大幅升级战争烈度的概率相对不大，对市场的影响相比战争初期在逐渐减小。

上半年 PPI 和 CPI 同比全面转正，通缩局面逐渐扭转，前 6 月出口依然维持同比高增长，经济数据利好逐渐增多，市场对中国经济复苏的信心有所提振。

美元兑人民币汇率依旧持续下跌，2 季度再创新低，实际上人民币相对主要国际货币都是升值的，A 股对国际资金吸引力在持续加大，海外资金有可能是 A 股新的资金增量来源。

云计算 50 指数成分股大部分与计算机、互联网、云计算相关，主要为 AI 提供算力基础设施，直接和 AI 赛道强相关。指数在上半年再创新高，整个上半年涨幅尚可，但因为指数计算机权重占绝对多数，只有少量通信，并没有上半年涨幅最高的电子行业，所以，涨幅并不突出。云计算行业的长逻辑一直没有变过，会持续受益于信息安全、自主可控等信创政策，同时也持续受益于大模型为代表的 AI 突破带来的行业发展的红利，不论在 AI 发展前期模型开发阶段，还是后期应用的广泛铺开，代表算力基础设施的云计算相关行业都会持续获利，所以，对未来云计算相关行业的发展仍然维持看好。相信随着 AI 行业的逐步发展落地，云计算 50 指数的成分股也会持续受益。

本基金为新华中证云计算 50ETF 的联接基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

本基金成立于 2026 年 2 月，当前已经完成了建仓。本基金的持仓主要为新华中证云计算 50ETF，建仓完成后，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。

未来本基金将延续同样的投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.0718 元，本报告期份额净值增长率为 7.18%，同期业绩比较基准收益率为 8.57%；C 类基金份额净值为 1.0709 元，本报告期份额净值增长率为 7.09%，同期业绩比较基准收益率为 8.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月以来，市场调整幅度很大，主要原因是市场涨了很久，幅度也很大，本身就处于情绪不稳的高位区间，再叠加韩国股市去杠杆式下跌、美伊冲突再起、担忧美国云厂商巨头资本开支不及预期、大型 IPO 恐慌等内外部因素，市场无视多数上市公司财报与业绩预告的亮眼表现，走出一波情绪性下跌。大幅下跌消化了前期高位的焦虑情绪，让市场估值水平显著下降，也给后续的走势创造了更大的空间。

短期的影响因素终将过去，对未来市场的判断仍然应该基于对中长期经济和科技发展的判断。本轮行情，最核心的赛道就是以 AI 代表的科技相关的行业，所以，本轮行情能否回到慢牛的路径上，关键就是对以 AI 为代表的科技行业的未来有没有信心。如果看得是远期的行业发展，AI 的大逻辑依然是没有问题的。就像上一轮手机互联网大发展，当时也有各种质疑和不信任，但我们现在的日常生活的很多应用都是那时候开始成型的。几大巨头平台企业，也都是那一轮开始发展壮大的。本轮 AI 也是一样，人类对“偷懒”和“省力”的追求是科技不断进步发展的核心驱动力，所以，AI 是符合人类本能的发展方向，未来必将能像手机互联网一样融入我们的日常生活，发展空间巨大。再加上中国已经开始大力推动科技创新，希望用科技创新来作为经济发展的新动力，中长期对科技赛道应

该保持乐观。科技的不断创新也会不断促进经济的发展，也为股市重回慢牛的轨道，打好了基础。

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。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。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。本基金管理人设有估值委员会，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	2,011,927.72
结算备付金		41,548.89
存出保证金		20,876.74
交易性金融资产	6.4.7.2	20,731,387.91
其中：股票投资		-
基金投资		20,630,739.72
债券投资		100,648.19
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		164,717.42
应收股利		-
应收申购款		218,872.99
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		23,189,331.67
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,415,027.34
应付管理人报酬		473.82
应付托管费		94.75

应付销售服务费		1,418.27
应付投资顾问费		-
应交税费		1,512.61
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	55,722.70
负债合计		1,474,249.49
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	20,267,252.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	1,447,830.18
净资产合计		21,715,082.18
负债和净资产总计		23,189,331.67

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 20,267,252.00 份。其中：A 类基金份额净值 1.0718 元，基金份额 11,981,159.11 份；C 类基金份额净值 1.0709 元，基金份额 8,286,092.89 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,041,924.83
1.利息收入		13,137.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,137.97
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）		133,441.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,300.55
基金投资收益	6.4.7.11	152,407.78
债券投资收益	6.4.7.12	333.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	871,672.73

填列)		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	23,672.93
减：二、营业总支出		64,360.84
1. 管理人报酬		3,393.08
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费		678.59
3. 销售服务费		4,302.84
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-
7. 税金及附加		552.62
8. 其他费用	6.4.7.20	55,433.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		977,563.99
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		977,563.99
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		977,563.99

注：本基金合同生效日为 2026 年 2 月 10 日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

本报告期：2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	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	13,125,558.07	-	-	13,125,558.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,141,693.93	-	1,447,830.18	8,589,524.11
（一）、综合收益总额	-	-	977,563.99	977,563.99
（二）、本期基金	7,141,693.93	-	470,266.19	7,611,960.12

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	33,661,513.46	-	1,814,226.54	35,475,740.00
2.基金赎回款	-26,519,819.53	-	-1,343,960.35	-27,863,779.88
（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	20,267,252.00	-	1,447,830.18	21,715,082.18

注：本基金合同生效日为 2026 年 2 月 10 日，无上年度同期对比数据。

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：

基金管理人负责人：银国宏，主管会计工作负责人：王宇成，会计机构负责人：涂运华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（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】2172 号文的核准，由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2026 年 2 月 10 日正式生效。首次设立募集规模为 13,125,558.07 份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操

作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

（1）金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债权投资的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项、债权投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同，同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《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《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《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[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,011,927.72
等于：本金	2,011,135.38
加：应计利息	792.34
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,011,927.72

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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	99,994.00	558.19	100,648.19	96.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	99,994.00	558.19	100,648.19	96.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		19,759,162.99	-	20,630,739.72	871,576.73
其他		-	-	-	-
合计		19,859,156.99	558.19	20,731,387.91	871,672.73

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	688.99
其中：交易所市场	688.99
银行间市场	-
应付利息	-
应付上海证券报	46,356.57
应付审计费	8,677.14
合计	55,722.70

6.4.7.7 实收基金

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	11,055,975.98	11,055,975.98
本期申购	4,012,555.39	4,012,555.39
本期赎回（以“-”号填列）	-3,087,372.26	-3,087,372.26
本期末	11,981,159.11	11,981,159.11

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	2,069,582.09	2,069,582.09
本期申购	29,648,958.07	29,648,958.07
本期赎回（以“-”号填列）	-23,432,447.27	-23,432,447.27
本期末	8,286,092.89	8,286,092.89

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

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

本期期初	-	-	-
本期利润	67,694.25	715,269.72	782,963.97
本期基金份额交易产生的变动数	-1,112.49	78,151.30	77,038.81
其中：基金申购款	3,867.61	212,712.61	216,580.22
基金赎回款	-4,980.10	-134,561.31	-139,541.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,581.76	793,421.02	860,002.78

新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	38,197.01	156,403.01	194,600.02
本期基金份额交易产生的变动数	1,180.78	392,046.60	393,227.38
其中：基金申购款	15,647.03	1,581,999.29	1,597,646.32
基金赎回款	-14,466.25	-1,189,952.69	-1,204,418.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,377.79	548,449.61	587,827.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,057.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	80.47
其他	-
合计	13,137.97

注：本项结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-914.40
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-18,386.15
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-19,300.55

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	-
减：卖出股票成本总额	-
减：交易费用	914.40
买卖股票差价收入	-914.40

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	10,938,400.00
减：现金支付申购款总额	7,439,294.41
减：申购股票成本总额	3,517,491.74
减：交易费用	-
申购差价收入	-18,386.15

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	4,846,136.80
减：卖出/赎回基金成本总额	4,688,380.39
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	4,594.84
减：交易费用	753.79
基金投资收益	152,407.78

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	333.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及	-

债券到期兑付) 差价收入	
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	333.97

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	871,672.73
——股票投资	-
——债券投资	96.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	871,576.73
——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	871,672.73

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	23,672.93
合计	23,672.93

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	8,677.14
信息披露费	46,356.57
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	55,433.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要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

本报告期内本基金不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。

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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
招商证券股份有限公司	基金托管人

新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
---------------------------	--------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份有限公司	3,517,491.74	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券股份有限公司	99,994.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例
招商证券股份有限公司	18,278,424.50	100.00%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券股份有限公司	688.99	100.00%	688.99	100.00%

注：1、上述佣金按合同约定的佣金率计算。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,393.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,535.43
应支付基金管理人的净管理费	-3,142.35

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50%年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为： $H=E\times0.50\%\div\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）；

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。

3、对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于基金管理人不得对基金财产中持有的自身管理的基金部分收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	678.59

注：基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.10%年费率计提，每日计提，按月支付。

其计算公式为： $H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期未发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未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

份额单位：份

项目	本期
	2026年2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日

	新华中证云计算50ETF发起式联接A	新华中证云计算50ETF发起式联接C
基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）持有的基金份额	10,000,388.89	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,388.89	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	83.47%	-

注：对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

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

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

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2月10日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	2,011,927.72	13,057.50

注：本基金的托管人是招商证券股份有限公司，上述银行存款由开户行交通银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金持有 17,534,200.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 13.09%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券产生的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会下设的审计委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

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6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	100,648.19
合计	100,648.19

- 注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。
- 3.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。
- 2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。
- 2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

- 1.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券。
- 2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

- 1.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。
- 2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

- 1.本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。
- 2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大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。

除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，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。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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	2,011,927.72	-	-	-	2,011,927.72
结算备付金	41,548.89	-	-	-	41,548.89
存出保证金	20,876.74	-	-	-	20,876.74
交易性金融资产	100,648.19	-	-	20,630,739.72	20,731,387.91
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	164,717.42	164,717.42

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	218,872.99	218,872.99
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,175,001.54	-	-	21,014,330.13	23,189,331.67
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,415,027.34	1,415,027.34
应付管理人报酬	-	-	-	473.82	473.82
应付托管费	-	-	-	94.75	94.75
应付销售服务费	-	-	-	1,418.27	1,418.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,512.61	1,512.61
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	55,722.70	55,722.70
负债总计	-	-	-	1,474,249.49	1,474,249.49
利率敏感度缺口	2,175,001.54	-	-	19,540,080.64	21,715,082.18

注：1.表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2.本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点。	
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
	市场利率上升 25.00 bp	-136.23
	市场利率下降 25.00 bp	136.59

注：本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

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

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	20,630,739.72	95.01
交易性金融资产—债券投资	100,648.19	0.46
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	20,731,387.91	95.47

注：本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	1,106,019.54
	业绩比较基准下降 5%	-1,106,019.54

注：本基金于 2026 年 2 月 10 日成立，无上年度末可比数据。

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 6 月 30 日
第一层次	20,630,739.72
第二层次	100,648.19
第三层次	-
合计	20,731,387.91

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	20,630,739.72	88.97
3	固定收益投资	100,648.19	0.43
	其中：债券	100,648.19	0.43
	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	2,053,476.61	8.86
8	其他各项资产	404,467.15	1.74
9	合计	23,189,331.67	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	新华基金管理股份有限公司	20,630,739.72	95.01

7.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.4 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603019	中科曙光	915,728.00	4.22
2	688111	金山办公	417,992.89	1.92
3	600570	恒生电子	396,431.00	1.83
4	600588	用友网络	260,365.00	1.20
5	688568	中科星图	231,087.50	1.06
6	600845	宝信软件	179,452.00	0.83
7	600410	华胜天成	178,040.00	0.82
8	603881	数据港	146,626.00	0.68
9	688258	卓易信息	133,276.00	0.61
10	600602	云赛智联	118,894.00	0.55
11	688158	优刻得	98,339.74	0.45
12	600131	国网信通	97,155.00	0.45
13	603887	城地香江	81,852.00	0.38
14	603859	能科科技	70,206.00	0.32
15	688023	安恒信息	61,127.61	0.28
16	603039	泛微网络	50,116.00	0.23
17	688365	光云科技	49,074.00	0.23
18	688225	亚信安全	31,729.00	0.15

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.5.3 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

买入股票的成本（成交）总额	3,517,491.74
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关费用。

7.6 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	100,648.19	0.46
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,648.19	0.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26 国债 01	1,000	100,648.19	0.46

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.12.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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

本报告期末，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,876.74
2	应收清算款	164,717.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	218,872.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	404,467.15

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	345	34,728.00	10,299,491.58	85.96%	1,681,667.53	14.04%
新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C	1,846	4,488.67	0.00	0.00%	8,286,092.89	100.00%
合计	2,191	9,250.23	10,299,491.58	50.82%	9,967,760.42	49.18%

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	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	10,164.65	0.08%
	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C	0.00	0.00%
	合计	10,164.65	0.05%

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的情况

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	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	0
	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	0
	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,388.89	49.34%	10,000,388.89	49.34%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,388.89	49.34%	10,000,388.89	49.34%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 A	新华中证云计算 50ETF 发起式联接 C
基金合同生效日（2026 年 2 月 10 日）基金份额总额	11,055,975.98	2,069,582.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,012,555.39	29,648,958.07
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,087,372.26	23,432,447.27
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	11,981,159.11	8,286,092.89
-------------	---------------	--------------

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人于 2026 年 2 月 25 日发布公告，自 2026 年 2 月 24 日起张鹏先生担任公司副总经理兼财务负责人，徐端骞先生离任公司副总经理兼首席信息官。基金管理人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，自 2026 年 4 月 20 日起王宇成先生担任公司副总经理兼首席信息官。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按照现行法律法规履行备案程序。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期末未有涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金报告期投资策略未改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.7.2 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到调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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	
招商证券	4	3,517,491.74	100.00%	688.99	100.00%	-
金融街证券	3	-	-	-	-	-

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（四）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

（二）公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

10.8.2 基金租用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		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

招商 证券	99,994.00	100.00 %	-	-	-	-	18,278,42 4.50	100.00 %
----------	-----------	-------------	---	---	---	---	-------------------	-------------

10.9 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	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
2	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
3	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
4	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
5	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额发售公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
6	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金产品资料概要	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-23
7	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同生效公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-11
8	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同生效公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-13
9	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
10	新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-04
11	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
12	新华基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260210-20260630	10,000,388.89	-	-	10,000,388.89	49.34%
产品特有风险							
1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未有投资本基金的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金注册的文件
- （二）《关于申请募集新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金之法律意见书》
- （三）《新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》
- （四）《新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》
- （五）《新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》
- （六）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七）基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年八月二十八日