

泓德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:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28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1月1日起至2026年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
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	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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	65
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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67

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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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	69
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	泓德上证科创板综合指数增强	
基金主代码	024509	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年08月04日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,652,557.86份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德上证科创板综合 指数增强A	泓德上证科创板综合 指数增强C
下属分级基金的交易代码	024509	024510
报告期末下属分级基金的份额总额	10,581,977.36份	27,070,580.50份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现长期超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，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%，并力争在控制跟踪误差的基础上获得超越标的指数的超额收益。指数增强量化投资策略主要运用不断迭代的量化模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险。在债券投资中，本基金运用久期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、可交换债券配置策略、资产支持证券投资策略构建和调整固定收益证券投资组合。此外，本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，

	适度参与股指期货与国债期货投资，以调整投资组合的风险暴露程度，降低系统性风险。本基金将在条件允许的情况下，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与融资、转融通证券出借业务。
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	本基金是一只股票指数增强型基金，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。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

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		泓德基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	杨军智
	联系电话	010-59850151	010-60834299
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	yjz@citics.com
客户服务电话		4009-100-888	010-60836588
传真		010-59850195	010-60834004
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期） 北座
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	北京市朝阳区亮马桥路48号 中信证券大厦5层
邮政编码		100088	100125
法定代表人		王德晓	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	泓德上证科创板综合指数增强A	泓德上证科创板综合指数增强C
本期已实现收益	5,278,765.22	15,913,691.64
本期利润	7,214,191.14	22,039,841.66
加权平均基金份额本期利润	0.4781	0.4721
本期加权平均净值利润率	39.78%	39.70%
本期基金份额净值增长率	50.12%	49.82%
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	5,022,850.16	12,705,945.47
期末可供分配基金份额利润	0.4747	0.4694
期末基金资产净值	16,934,170.47	43,161,783.99
期末基金份额净值	1.6003	1.5944
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	60.03%	59.44%

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，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，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

泓德上证科创板综合指数增强A

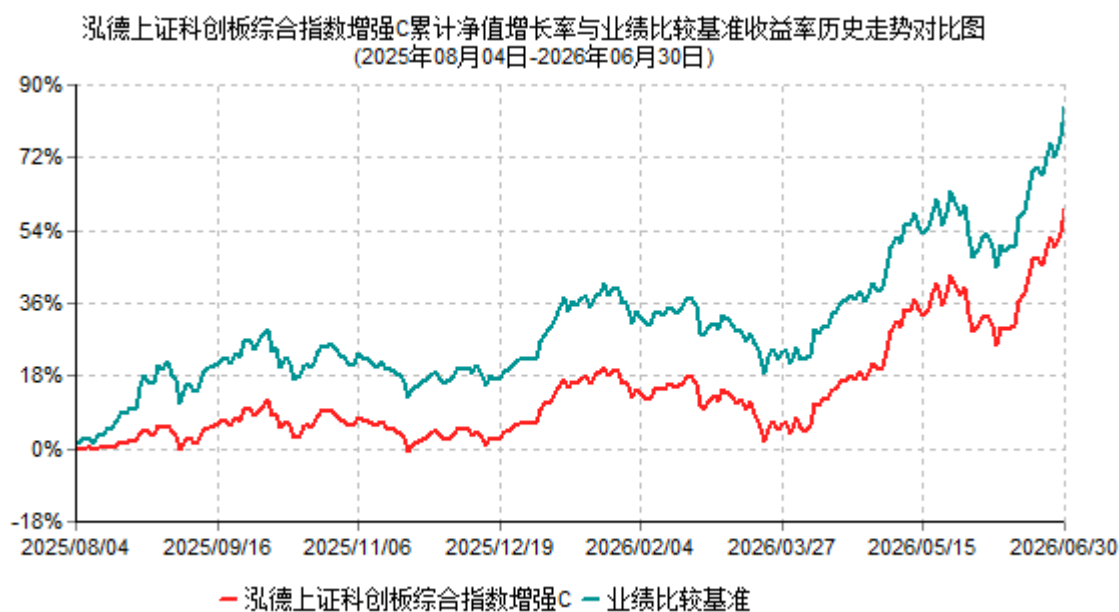
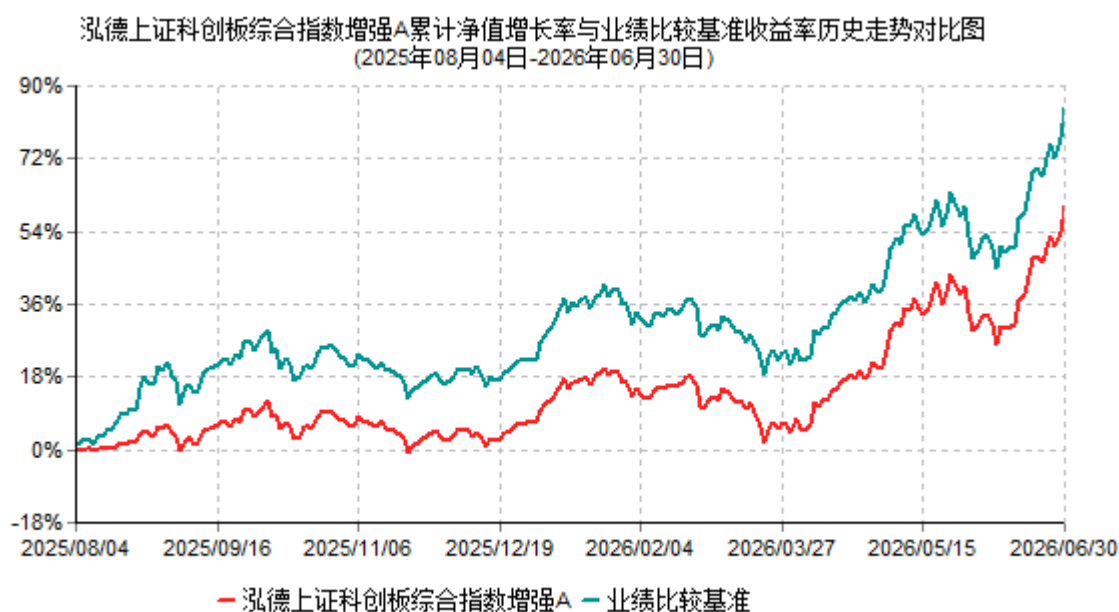
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	53.42%	2.19%	52.44%	2.24%	0.98%	-0.05%
过去六个月	50.12%	2.01%	50.92%	2.11%	-0.80%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	60.03%	1.73%	84.45%	1.94%	-24.42%	-0.21%

泓德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	53.26%	2.19%	52.44%	2.24%	0.82%	-0.05%
过去六个月	49.82%	2.01%	50.92%	2.11%	-1.10%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	59.44%	1.73%	84.45%	1.94%	-25.01%	-0.21%

注：本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

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



注：1、本基金的基金合同于2025年8月4日生效，截至2026年6月30日止，本基金成立未
满1年。

2、根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比
例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金始终以“为客户创造价值”为己任，坚持长期价值投资理念，发挥主动投资管理优势，致力于为广大投资者提供专业、优质、高效的资产管理服务，力争成为受人尊重的资产管理机构。

公司已建立科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳定专业的投资研究团队，专业高效的市场服务体系，稳健的运营保障体系。公司已覆盖从公募到专户，从主动权益投资、量化投资到固定收益投资，从低风险到中、高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等主流基金品种，产品谱系不断完善，满足居民日益多元的财富管理需求。

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

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		
李子昂	本基金的基金经理、 智能投资部副总监	2025- 08-04	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
刘令宇	本基金的基金经理	2026- 03-05	-	7年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任泰达宏利基金管理有限公司策略投资部研

					究员。
--	--	--	--	--	-----

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，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《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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，A股主要指数呈现出上涨趋势，但个股出现较大分化，第二季度的科技行情带动了成长股的大幅上涨，同时红利、价值、现金流等风格被持续压制，成长价值的剪刀差被进一步放大。上半年，量化产品的整体超额波动较大，快速的风格切换和极致

的一九行情给量化策略带来了较多困难，科创板领涨A股，在相对极致的行情里，我们尽量降低偏离，特别是在成长行情里，对成长保持配置，产品上半年总体表现中规中矩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德上证科创板综合指数增强A基金份额净值为1.6003元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为50.12%，同期业绩比较基准收益率为50.92%；截至报告期末泓德上证科创板综合指数增强C基金份额净值为1.5944元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为49.82%，同期业绩比较基准收益率为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

7月以来，市场再次出现大幅反转，受Meta出售算力消息刺激和韩国市场大跌影响，电子、通信等热门板块出现显著回调，红利类资产触底反弹，同时也引发了市场对于AI泡沫和科技股牛市终结的讨论。从已实现的AI编程到未来的具身智能，AI技术依然在快速发展，当然技术的进步也不是一蹴而就的，二级市场受资金面和流动性影响总会产生或大或小的波动并呈现出一定的周期性，我们应该理性去看待这种波动。宏观方面，上半年GDP同比增长4.7%，符合全年GDP增长目标区间，但内需压力较大，二季度，投资大幅下滑，地产投资依旧拖累较大，消费明显回落，只有出口依旧保持韧性。与宏观经济总体平稳形成对比的是微观体感的差异，大家感受到的是居民就业的压力、收入的压力，企业订单的压力，但背后反映的是我国经济新旧动能的转换，以高端制造、数字经济、现代服务为代表的新动能对经济增长的贡献率超过了4成。聚焦在产品上，我们希望持续开发多元化的Alpha策略，努力适应较为多变的市场环境，力争为投资者创造更好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《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，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值委员会,估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关

估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2026年06月30日，期末可供分配利润为17,728,795.63元，其中：泓德上证科创板综合指数增强A期末可供分配利润为5,022,850.16元（泓德上证科创板综合指数增强A的未分配利润已实现部分为5,022,850.16元，未分配利润未实现部分为1,329,342.95元），泓德上证科创板综合指数增强C期末可供分配利润为12,705,945.47元（泓德上证科创板综合指数增强C的未分配利润已实现部分为12,705,945.47元，未分配利润未实现部分为3,385,258.02元）。

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的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，由泓德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泓德上证科创板综合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：泓德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	5,030,491.34	9,877,948.05
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	55,753,404.55	105,788,192.09
其中：股票投资		55,729,246.94	105,677,870.35
基金投资		-	-
债券投资		24,157.61	110,321.74
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		6,510.36	9,857.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		60,790,406.25	115,675,997.77

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		556,358.14	1,613,762.98
应付管理人报酬		37,997.21	80,492.44
应付托管费		7,124.47	15,092.34
应付销售服务费		13,589.17	31,192.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	79,382.80	38,000.00
负债合计		694,451.79	1,778,540.50
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.7	37,652,557.86	106,985,406.50
未分配利润	6.4.7.8	22,443,396.60	6,912,050.77
净资产合计		60,095,954.46	113,897,457.27
负债和净资产总计		60,790,406.25	115,675,997.77

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额37,652,557.86份，其中A类基金份额总额为10,581,977.36份，基金份额净值为1.6003元；C类基金份额总额为27,070,580.50份，基金份额净值为1.5944元。

6.2 利润表

会计主体：泓德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0 6月30日
一、营业总收入		29,793,454.12
1.利息收入		5,799.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,799.39
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）		21,680,419.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	21,508,418.54
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	50,717.37
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	121,283.85
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	8,061,575.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	45,659.03
减：二、营业总支出		539,421.32
1.管理人报酬		294,593.94
2.托管费		55,236.31
3.销售服务费		111,239.79
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		-

7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.16	78,351.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,254,032.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,254,032.80
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		29,254,032.80

注：本基金合同于2025年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德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	106,985,406.50	6,912,050.77	113,897,457.27
二、本期期初净资产	106,985,406.50	6,912,050.77	113,897,457.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-69,332,848.64	15,531,345.83	-53,801,502.81
（一）、综合收益总额	-	29,254,032.80	29,254,032.80
（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）	-69,332,848.64	-13,722,686.97	-83,055,535.61
其中：1.基金申购款	24,083,075.91	5,951,335.22	30,034,411.13

2.基金赎回款	-93,415,924.55	-19,674,022.19	-113,089,946.74
（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	37,652,557.86	22,443,396.60	60,095,954.46

注：本基金合同于2025年8月4日生效，无上年度可比期间。

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：

王德晓

王德晓

王玲

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

泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2025]1012号《关于准予泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集495,477,901.00元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明（2025）验字第80014975_A08号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年8月4日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为495,594,700.18份，其中认购资金利息折合116,799.18份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式

为：计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票（含主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有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。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称"企业会计准则")编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金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》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《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》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年1月1日至2026年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及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等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令826号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自2026年1月1日至2027年12月31日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自2026年1月1日至2027年12月31日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告2026年第10号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自2026年1月1日至2027年12月31日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	3,792,871.68
等于：本金	3,792,568.68
加：应计利息	303.00
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	1,237,619.66
等于：本金	1,237,607.40
加：应计利息	12.26
减：坏账准备	-
合计	5,030,491.34

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中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		41,505,206.56	-	55,729,246.94	14,224,040.38
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	19,000.00	1.51	24,157.61	5,156.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	19,000.00	1.51	24,157.61	5,156.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		41,524,206.56	1.51	55,753,404.55	14,229,196.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

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	-
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	78,351.28
其他应付款	1,031.52
合计	79,382.80

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德上证科创板综合指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (泓德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	23,087,812.04	23,087,812.04
本期申购	7,927,445.55	7,927,445.55
本期赎回（以“-”号填列）	-20,433,280.23	-20,433,280.23
本期末	10,581,977.36	10,581,977.36

6.4.7.7.2 泓德上证科创板综合指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (泓德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	83,897,594.46	83,897,594.46
本期申购	16,155,630.36	16,155,630.36
本期赎回（以“-”号填列）	-72,982,644.32	-72,982,644.32

本期末	27,070,580.50	27,070,580.50
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德上证科创板综合指数增强A

单位：人民币元

项目 (泓德上证科创板综合 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	2,470,619.69	-947,246.94	1,523,372.75
本期期初	2,470,619.69	-947,246.94	1,523,372.75
本期利润	5,278,765.22	1,935,425.92	7,214,191.14
本期基金份额交易产 生的变动数	-2,726,534.75	341,163.97	-2,385,370.78
其中：基金申购款	2,586,300.30	-53,984.76	2,532,315.54
基金赎回款	-5,312,835.05	395,148.73	-4,917,686.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,022,850.16	1,329,342.95	6,352,193.11

6.4.7.8.2 泓德上证科创板综合指数增强C

单位：人民币元

项目 (泓德上证科创板综合 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	8,826,420.24	-3,437,742.22	5,388,678.02
本期期初	8,826,420.24	-3,437,742.22	5,388,678.02
本期利润	15,913,691.64	6,126,150.02	22,039,841.66
本期基金份额交易产 生的变动数	-12,034,166.41	696,850.22	-11,337,316.19
其中：基金申购款	4,120,265.47	-701,245.79	3,419,019.68
基金赎回款	-16,154,431.88	1,398,096.01	-14,756,335.87
本期已分配利润	-	-	-

本期末	12,705,945.47	3,385,258.02	16,091,203.49
-----	---------------	--------------	---------------

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	5,163.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	636.21
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,799.39

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	250,123,634.59
减：卖出股票成本总额	228,385,060.59
减：交易费用	230,155.46
买卖股票差价收入	21,508,418.54

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	34.72
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	50,682.65

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	50,717.37

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	136,235.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	85,500.00
减：应计利息总额	46.65
减：交易费用	6.32
买卖债券差价收入	50,682.65

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	121,283.85
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	121,283.85

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	8,061,575.94
——股票投资	8,083,728.14
——债券投资	-22,152.20
——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	8,061,575.94

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	45,602.71
基金转换费收入	56.32
合计	45,659.03

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	78,351.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

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
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	316,184,888.85	75.22%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中信证券	88,470.30	64.94%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	58,780.18	75.22%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	294,593.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	117,874.09
应支付基金管理人的净管理费	176,719.85

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率每日计提，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×0.80%/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01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	55,236.31

注：支付基金托管人中信证券的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，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×0.15%/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		
	泓德上证科创板综合指数增 强A	泓德上证科创板综合指数增 强C	合计
中信证券	0.00	41,827.26	41,827.26
泓德基金	0.00	36.40	36.40
合计	0.00	41,863.66	41,863.66

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券-托管户	3,792,871.68	5,163.18
中信证券-证券户	400,029.64	306.52

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人中信证券存放在兴业银行北京分行营业部，按银行同业利率计息；本基金证券户的存款为本基金存放于中信证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	本期				
	2026年01月01日至2026年06月30日				
	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券股份有限公司	123267	珂玛转债	原股东优先配售	15	1,500.00
中信证券股份有限公司	688785	恒运昌	公开发行	282	25,994.76

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月以上	限售股	9.47	70.14	279	2,642.13	19,569.06	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月以上	限售股	17.52	35.92	392	6,867.84	14,080.64	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月以上	限售股	92.18	463.15	29	2,673.22	13,431.35	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月以上	限售股	26.28	172.09	56	1,471.68	9,637.04	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	限售股	22.68	47.61	144	3,265.92	6,855.84	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月以上	限售股	55.95	57.10	38	2,126.10	2,169.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月以	限售股	11.18	17.59	103	1,151.54	1,811.77	-

			上							
603352	至信股份	2026-01-08	6个月以上	限售股	21.88	25.52	41	897.08	1,046.32	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月以上	限售股	37.88	34.87	19	719.72	662.53	-

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	2026-06-25	16个交易日	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.15	-
118070	南芯转债	2026-06-22	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	30	3,000.00	3,000.17	-
113703	翔26转债	2026-06-09	19个交易日	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.10	-
118071	华峰转债	2026-06-24	17个交易日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
688 260	昀 豕 科 技	202 6-0 6-2 6	重 大 事 项	144. 00	202 6-07 -01	132. 00	200	6,762.25	28,800.00	-
688 072	拓 荆 科 技	202 6-0 6-2 9	重 大 事 项	832. 00	202 6-07 -13	890. 99	1,623	720,549.63	1,350,336.0 0	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0.04%(上年度末：0.10%)。

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。

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

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对于基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,030,491.34	-	-	-	5,030,491.34
交易性金融资产	-	-	24,157.61	55,729,246.94	55,753,404.55
应收申购款	-	-	-	6,510.36	6,510.36
资产总计	5,030,491.34	-	24,157.61	55,735,757.30	60,790,406.25
负债					

应付赎回款	-	-	-	556,358.14	556,358.14
应付管理人报酬	-	-	-	37,997.21	37,997.21
应付托管费	-	-	-	7,124.47	7,124.47
应付销售服务费	-	-	-	13,589.17	13,589.17
其他负债	-	-	-	79,382.80	79,382.80
负债总计	-	-	-	694,451.79	694,451.79
利率敏感度缺口	5,030,491.34	-	24,157.61	55,041,305.51	60,095,954.46
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	9,877,948.05	-	-	-	9,877,948.05
交易性金融资产	-	-	110,321.74	105,677,870.35	105,788,192.09
应收申购款	-	-	-	9,857.63	9,857.63
资产总计	9,877,948.05	-	110,321.74	105,687,727.98	115,675,997.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,613,762.98	1,613,762.98
应付管	-	-	-	80,492.44	80,492.44

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	15,092.34	15,092.34
应付销售服务费	-	-	-	31,192.72	31,192.72
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	38,000.00	38,000.00
负债总计	-	-	-	1,778,540.50	1,778,540.50
利率敏感度缺口	9,877,948.05	-	110,321.74	103,909,187.48	113,897,457.27

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

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（不包括可转债和可交换债）公允价值占基金资产净值的比例为0%(上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：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证券，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	55,729,246.94	92.73	105,677,870.35	92.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	24,157.61	0.04	110,321.74	0.10
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	55,753,404.55	92.77	105,788,192.09	92.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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	54,295,003.76	102,722,781.73
第二层次	1,389,136.44	2,909,381.23
第三层次	69,264.35	156,029.13
合计	55,753,404.55	105,788,192.09

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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比
----	----	----	----------

			例(%)
1	权益投资	55,729,246.94	91.67
	其中：股票	55,729,246.94	91.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,157.61	0.04
	其中：债券	24,157.61	0.04
	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	5,030,491.34	8.28
8	其他各项资产	6,510.36	0.01
9	合计	60,790,406.25	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	38,852,889.36	64.65
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	10,829,292.12	18.02
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	1,146,401.72	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	34,548.00	0.06
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	50,863,131.20	84.64

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	16,800.00	0.03
C	制造业	4,191,518.74	6.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,414.00	0.01
E	建筑业	43,819.00	0.07
F	批发和零售业	74,636.00	0.12
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	289,906.00	0.48
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	99,608.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管	103,779.00	0.17

	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	3,045.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	37,590.00	0.06
	合计	4,866,115.74	8.10

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	2,732	4,359,042.60	7.25
2	688041	海光信息	7,626	2,823,907.80	4.70
3	688012	中微公司	5,869	2,749,626.50	4.58
4	688525	佰维存储	3,600	1,781,028.00	2.96
5	688981	中芯国际	9,632	1,529,754.24	2.55
6	688008	澜起科技	4,658	1,443,514.20	2.40
7	688072	拓荆科技	1,623	1,350,336.00	2.25
8	688498	源杰科技	490	924,140.00	1.54
9	688521	芯原股份	2,387	885,911.18	1.47
10	688082	盛美上海	1,400	604,800.00	1.01
11	688120	华海清科	1,760	567,036.80	0.94
12	688630	芯碁微装	1,000	549,390.00	0.91
13	688396	华润微	5,300	517,015.00	0.86
14	688361	中科飞测	1,200	516,000.00	0.86

15	688409	富创精密	1,600	490,000.00	0.82
16	688702	盛科通信	1,200	467,988.00	0.78
17	688469	芯联集成	41,600	441,376.00	0.73
18	688002	睿创微纳	2,800	433,132.00	0.72
19	688627	精智达	600	429,000.00	0.71
20	688313	仕佳光子	2,243	414,169.95	0.69
21	688249	晶合集成	6,600	389,598.00	0.65
22	688111	金山办公	1,734	369,428.70	0.61
23	688110	东芯股份	1,800	366,660.00	0.61
24	688536	思瑞浦	1,000	364,090.00	0.61
25	688795	摩尔线程	506	362,543.94	0.60
26	688183	生益电子	2,600	344,240.00	0.57
27	688141	杰华特	2,200	337,700.00	0.56
28	688629	华丰科技	1,800	337,518.00	0.56
29	688802	沐曦股份	400	331,320.00	0.55
30	688777	中控技术	2,800	329,000.00	0.55
31	688126	沪硅产业	7,200	287,208.00	0.48
32	688025	杰普特	600	282,000.00	0.47
33	688266	泽璟制药	2,203	257,001.98	0.43
34	688593	新相微	6,600	256,872.00	0.43
35	688388	嘉元科技	5,670	249,480.00	0.42
36	688519	南亚新材	600	228,024.00	0.38
37	688392	骄成超声	1,000	227,180.00	0.38
38	688191	智洋创新	6,281	224,231.70	0.37
39	688668	鼎通科技	600	223,980.00	0.37
40	688372	伟测科技	1,200	223,200.00	0.37
41	688690	纳微科技	4,969	219,132.90	0.36
42	688172	燕东微	2,600	217,516.00	0.36
43	688233	神工股份	1,000	214,420.00	0.36
44	688503	聚和材料	1,600	212,320.00	0.35
45	688418	震有科技	4,400	211,552.00	0.35

46	688200	华峰测控	400	210,040.00	0.35
47	688301	奕瑞科技	1,680	208,320.00	0.35
48	688150	莱特光电	3,033	208,124.46	0.35
49	688368	晶丰明源	960	207,859.20	0.35
50	688506	百利天恒	694	204,056.82	0.34
51	688347	华虹宏力	600	201,780.00	0.34
52	688168	安博通	2,920	200,750.00	0.33
53	688386	泛亚微透	2,194	197,108.96	0.33
54	688550	瑞联新材	3,400	196,690.00	0.33
55	688663	新风光	2,200	194,612.00	0.32
56	688147	微导纳米	1,200	194,256.00	0.32
57	688202	美迪西	2,400	193,704.00	0.32
58	688400	凌云光	2,800	185,360.00	0.31
59	688582	芯动联科	2,800	182,000.00	0.30
60	688717	艾罗能源	2,200	181,654.00	0.30
61	688182	灿勤科技	4,200	180,894.00	0.30
62	688209	英集芯	6,200	180,296.00	0.30
63	688531	日联科技	1,000	177,840.00	0.30
64	688700	东威科技	1,981	177,101.40	0.29
65	688685	迈信林	3,200	175,680.00	0.29
66	688037	芯源微	400	175,620.00	0.29
67	688378	奥来德	2,800	173,600.00	0.29
68	688052	纳芯微	600	172,986.00	0.29
69	688262	国芯科技	3,910	169,029.30	0.28
70	688375	国博电子	1,600	166,880.00	0.28
71	688548	广钢气体	3,200	166,720.00	0.28
72	688678	福立旺	6,854	165,661.18	0.28
73	688099	晶晨股份	1,600	164,640.00	0.27
74	688652	京仪装备	800	160,136.00	0.27
75	688371	菲沃泰	4,102	159,936.98	0.27
76	688319	欧林生物	3,600	158,328.00	0.26

77	688173	希荻微	8,200	156,948.00	0.26
78	688322	奥比中光	1,200	156,660.00	0.26
79	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.26
80	688683	莱尔科技	4,039	153,158.88	0.25
81	688390	固德威	1,400	151,914.00	0.25
82	688515	裕太微	600	149,256.00	0.25
83	688239	航宇科技	2,400	143,592.00	0.24
84	688046	药康生物	5,908	142,973.60	0.24
85	688620	安凯微	8,800	142,560.00	0.24
86	688486	龙迅股份	2,240	142,419.20	0.24
87	688258	卓易信息	1,200	142,248.00	0.24
88	688518	联赢激光	4,600	142,140.00	0.24
89	688167	炬光科技	400	141,684.00	0.24
90	688332	中科蓝讯	888	139,860.00	0.23
91	688381	帝奥微	2,600	139,100.00	0.23
92	688231	隆达股份	3,780	138,839.40	0.23
93	688502	茂莱光学	200	138,720.00	0.23
94	688226	威腾电气	3,200	137,056.00	0.23
95	688127	蓝特光学	1,400	136,640.00	0.23
96	688135	利扬芯片	3,200	134,656.00	0.22
97	688401	路维光电	1,400	134,372.00	0.22
98	688609	九联科技	12,200	134,322.00	0.22
99	688538	和辉光电	51,400	133,640.00	0.22
100	688210	统联精密	3,200	129,632.00	0.22
101	688653	康希通信	7,324	127,291.12	0.21
102	688235	百济神州	499	127,050.39	0.21
103	688558	国盛智科	3,725	122,403.50	0.20
104	688271	联影医疗	1,209	122,387.07	0.20
105	688257	新锐股份	1,200	122,280.00	0.20
106	688443	智翔金泰	5,200	120,900.00	0.20
107	688253	英诺特	2,000	120,560.00	0.20

108	688248	南网科技	1,732	119,819.76	0.20
109	688403	汇成股份	3,000	119,100.00	0.20
110	688510	航亚科技	4,853	115,889.64	0.19
111	688061	灿瑞科技	2,276	113,048.92	0.19
112	688508	芯朋微	1,200	111,552.00	0.19
113	688308	欧科亿	600	109,086.00	0.18
114	688545	兴福电子	800	106,448.00	0.18
115	688665	四方光电	1,600	105,120.00	0.17
116	688721	龙图光罩	1,800	105,084.00	0.17
117	688234	天岳先进	600	104,106.00	0.17
118	688192	迪哲医药	2,600	103,818.00	0.17
119	688484	南芯科技	1,800	101,682.00	0.17
120	688677	海泰新光	1,000	101,130.00	0.17
121	688686	奥普特	600	101,034.00	0.17
122	688199	久日新材	2,800	96,684.00	0.16
123	688252	天德钰	3,972	95,328.00	0.16
124	688006	杭可科技	2,600	95,030.00	0.16
125	688188	柏楚电子	879	93,789.30	0.16
126	688087	英科再生	2,800	93,576.00	0.16
127	688277	天智航	5,400	92,340.00	0.15
128	688710	益诺思	1,370	92,064.00	0.15
129	688711	宏微科技	2,000	90,900.00	0.15
130	688279	峰昭科技	400	89,776.00	0.15
131	688387	信科移动	4,400	87,296.00	0.15
132	688449	联芸科技	1,000	86,310.00	0.14
133	688029	南微医学	1,200	86,160.00	0.14
134	688789	宏华数科	1,600	85,072.00	0.14
135	688123	聚辰股份	400	85,040.00	0.14
136	688102	斯瑞新材	1,800	84,924.00	0.14
137	688261	东微半导	800	83,944.00	0.14
138	688179	阿拉丁	3,000	83,130.00	0.14

139	688768	容知日新	1,600	82,464.00	0.14
140	688556	高测股份	6,200	82,336.00	0.14
141	688475	萤石网络	3,000	82,050.00	0.14
142	688267	中触媒	4,120	81,164.00	0.14
143	688625	呈和科技	960	81,033.60	0.13
144	688787	海天瑞声	600	80,670.00	0.13
145	688757	胜科纳米	1,200	80,040.00	0.13
146	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.13
147	688628	优利德	800	79,152.00	0.13
148	688579	地纬智能	10,400	78,936.00	0.13
149	688305	科德数控	1,200	78,324.00	0.13
150	688325	赛微微电	600	78,246.00	0.13
151	688003	天准科技	600	76,380.00	0.13
152	688719	爱科赛博	976	75,152.00	0.13
153	688299	长阳科技	4,400	73,524.00	0.12
154	688036	传音控股	1,200	70,740.00	0.12
155	688733	壹石通	1,700	70,295.00	0.12
156	688611	杭州柯林	979	69,949.55	0.12
157	688068	热景生物	800	69,280.00	0.12
158	688598	金博股份	1,400	69,230.00	0.12
159	688001	华兴源创	800	68,560.00	0.11
160	688433	华曙高科	800	68,480.00	0.11
161	688101	三达膜	4,142	68,467.26	0.11
162	688223	晶科能源	14,400	68,400.00	0.11
163	688019	安集科技	200	67,892.00	0.11
164	688615	合合信息	600	67,860.00	0.11
165	688352	颀中科技	2,800	67,704.00	0.11
166	688290	景业智能	1,000	66,360.00	0.11
167	688125	安达智能	400	65,400.00	0.11
168	688007	光峰科技	4,880	64,904.00	0.11
169	688351	微电生理	2,800	63,448.00	0.11

170	688097	博众精工	1,000	63,050.00	0.10
171	688028	沃尔德	400	62,348.00	0.10
172	688660	电气风电	7,200	62,064.00	0.10
173	688588	凌志软件	6,800	61,812.00	0.10
174	688800	瑞可达	640	61,420.80	0.10
175	688512	慧智微	3,800	60,686.00	0.10
176	688109	品茗科技	800	60,560.00	0.10
177	688095	福昕软件	1,000	59,430.00	0.10
178	688488	艾迪药业	4,600	59,110.00	0.10
179	688411	海博思创	200	58,240.00	0.10
180	688131	皓元医药	600	56,760.00	0.09
181	688639	华恒生物	3,490	56,328.60	0.09
182	688208	道通科技	2,200	55,418.00	0.09
183	688035	德邦科技	600	55,080.00	0.09
184	688399	硕世生物	1,200	54,468.00	0.09
185	688507	索辰科技	200	53,936.00	0.09
186	688157	松井股份	2,000	52,780.00	0.09
187	688018	乐鑫科技	400	51,168.00	0.09
188	688220	翱捷科技	400	49,728.00	0.08
189	688155	先惠技术	600	48,534.00	0.08
190	688295	中复神鹰	800	48,432.00	0.08
191	688230	芯导科技	600	47,286.00	0.08
192	688489	三未信安	2,051	46,557.70	0.08
193	688228	开普云	600	46,404.00	0.08
194	688343	云天励飞	567	46,301.22	0.08
195	688566	吉贝尔	1,800	46,062.00	0.08
196	688286	敏芯股份	400	46,028.00	0.08
197	688119	中钢洛耐	9,600	45,600.00	0.08
198	688085	三友医疗	3,800	45,486.00	0.08
199	688280	精进电动	8,200	45,018.00	0.07
200	688050	爱博医疗	1,200	43,740.00	0.07

201	688578	艾力斯	400	43,680.00	0.07
202	688213	思特威	400	42,828.00	0.07
203	688318	财富趋势	600	42,786.00	0.07
204	688385	复旦微电	600	42,774.00	0.07
205	688315	诺禾致源	3,381	42,296.31	0.07
206	688205	德科立	200	41,638.00	0.07
207	688563	航材股份	800	40,984.00	0.07
208	688772	珠海冠宇	2,068	40,594.84	0.07
209	688091	上海谊众	1,000	40,200.00	0.07
210	688211	中科微至	1,164	40,064.88	0.07
211	688195	腾景科技	200	38,516.00	0.06
212	688328	深科达	400	38,280.00	0.06
213	688162	巨一科技	1,600	37,824.00	0.06
214	688015	交控科技	2,456	37,773.28	0.06
215	688535	华海诚科	200	37,400.00	0.06
216	688283	坤恒顺维	1,127	37,314.97	0.06
217	688321	微芯生物	1,400	36,862.00	0.06
218	688309	恒誉环保	600	36,528.00	0.06
219	688196	卓越新能	1,000	35,900.00	0.06
220	688391	钜泉科技	1,000	35,870.00	0.06
221	688619	罗普特	2,200	35,706.00	0.06
222	688779	五矿新能	4,400	35,684.00	0.06
223	688633	星球石墨	1,200	35,676.00	0.06
224	688513	苑东生物	800	35,168.00	0.06
225	688517	金冠电气	2,000	34,960.00	0.06
226	688472	阿特斯	3,200	34,624.00	0.06
227	688516	奥特维	600	34,434.00	0.06
228	688296	和达科技	3,000	34,320.00	0.06
229	688428	诺诚健华	1,200	34,164.00	0.06
230	688203	海正生材	3,400	33,932.00	0.06
231	688129	东来技术	1,276	33,418.44	0.06

232	688459	哈铁科技	3,990	33,236.70	0.06
233	688320	禾川科技	800	33,160.00	0.06
234	688528	秦川物联	3,600	32,904.00	0.05
235	688636	智明达	900	32,607.00	0.05
236	688597	煜邦电力	5,000	32,500.00	0.05
237	688565	力源科技	3,400	32,130.00	0.05
238	688215	瑞晟智能	800	32,128.00	0.05
239	688222	成都先导	1,000	32,110.00	0.05
240	688307	中润光学	400	31,980.00	0.05
241	688718	唯赛勃	2,000	31,940.00	0.05
242	688479	友车科技	840	31,894.80	0.05
243	688499	利元亨	600	31,530.00	0.05
244	688567	孚能科技	3,000	31,500.00	0.05
245	688398	赛特新材	1,207	31,273.37	0.05
246	688047	龙芯中科	200	30,934.00	0.05
247	688618	三旺通信	1,000	30,770.00	0.05
248	688251	井松智能	1,200	30,756.00	0.05
249	688377	迪威尔	1,280	30,182.40	0.05
250	688281	华秦科技	600	30,138.00	0.05
251	688562	航天软件	2,000	30,120.00	0.05
252	688337	普源精电	400	29,972.00	0.05
253	688589	力合微	1,300	29,874.00	0.05
254	688455	科捷智能	1,600	29,856.00	0.05
255	688176	亚虹医药	3,000	29,760.00	0.05
256	688687	凯因科技	1,800	29,358.00	0.05
257	688236	春立医疗	2,000	28,920.00	0.05
258	688260	昀冢科技	200	28,800.00	0.05
259	688616	西力科技	2,800	28,280.00	0.05
260	688599	天合光能	2,000	28,240.00	0.05
261	688049	炬芯科技	600	28,146.00	0.05
262	688552	航天南湖	1,000	28,130.00	0.05

263	688130	晶华微	1,000	28,120.00	0.05
264	688416	恒烁股份	200	28,000.00	0.05
265	688456	有研粉材	200	27,920.00	0.05
266	688255	凯尔达	1,000	27,800.00	0.05
267	688090	瑞松科技	260	27,677.00	0.05
268	688187	时代电气	400	27,464.00	0.05
269	688148	芳源股份	3,200	27,456.00	0.05
270	688136	科兴制药	1,301	26,943.71	0.04
271	688737	中自科技	1,400	26,796.00	0.04
272	688667	菱电电控	200	26,730.00	0.04
273	688293	奥浦迈	638	26,598.22	0.04
274	688311	盟升电子	1,000	26,190.00	0.04
275	688767	博拓生物	800	26,008.00	0.04
276	688080	映翰通	600	25,950.00	0.04
277	688122	西部超导	400	25,124.00	0.04
278	688165	埃夫特	1,200	24,480.00	0.04
279	688601	力芯微	400	24,220.00	0.04
280	688557	兰剑智能	740	22,962.20	0.04
281	688116	天奈科技	600	22,920.00	0.04
282	688621	阳光诺和	413	22,677.83	0.04
283	688758	赛分科技	1,000	22,010.00	0.04
284	688247	宣泰医药	2,899	21,800.48	0.04
285	688584	上海合晶	600	21,570.00	0.04
286	688523	航天环宇	400	20,960.00	0.03
287	688591	泰凌微	600	20,628.00	0.03
288	688607	康众医疗	400	20,400.00	0.03
289	688153	唯捷创芯	635	20,396.20	0.03
290	688600	皖仪科技	600	19,968.00	0.03
291	688013	天臣医疗	800	19,736.00	0.03
292	688138	清溢光电	400	18,800.00	0.03
293	688285	高铁电气	2,600	18,642.00	0.03

294	688079	美迪凯	600	18,450.00	0.03
295	688382	益方生物	1,000	18,000.00	0.03
296	688799	华纳药厂	400	17,948.00	0.03
297	688505	复旦张江	2,400	17,712.00	0.03
298	688571	杭华股份	2,000	17,500.00	0.03
299	688349	三一重能	1,136	17,244.48	0.03
300	688410	山外山	1,200	17,232.00	0.03
301	688420	美腾科技	800	16,856.00	0.03
302	688216	气派科技	400	16,804.00	0.03
303	688681	科汇股份	1,200	16,776.00	0.03
304	688373	盟科药业	3,600	16,308.00	0.03
305	688009	中国通号	3,400	16,184.00	0.03
306	688329	艾隆科技	800	16,168.00	0.03
307	688432	有研硅	400	15,988.00	0.03
308	688021	奥福科技	800	15,488.00	0.03
309	688356	键凯科技	200	15,416.00	0.03
310	688069	德林海	400	14,944.00	0.02
311	688590	新致软件	1,200	14,916.00	0.02
312	688093	世华科技	400	14,760.00	0.02
313	688112	鼎阳科技	200	14,692.00	0.02
314	688602	康鹏科技	1,800	14,184.00	0.02
315	688326	经纬恒润	200	14,176.00	0.02
316	688348	昱能科技	400	13,912.00	0.02
317	688701	卓锦股份	1,800	13,554.00	0.02
318	688314	康拓医疗	400	13,552.00	0.02
319	688180	君实生物	400	13,528.00	0.02
320	688367	工大高科	400	13,320.00	0.02
321	688697	纽威数控	960	13,046.40	0.02
322	688238	和元生物	2,400	13,008.00	0.02
323	688658	悦康药业	1,000	12,860.00	0.02
324	688728	格科微	600	12,624.00	0.02

325	688529	豪森智能	800	12,584.00	0.02
326	688612	威迈斯	400	11,836.00	0.02
327	688151	华强科技	747	11,107.89	0.02
328	688073	毕得医药	200	10,764.00	0.02
329	688698	伟创电气	200	10,490.00	0.02
330	688429	时创能源	988	10,067.72	0.02
331	688163	赛伦生物	200	9,762.00	0.02
332	688501	青达环保	500	9,600.00	0.02
333	688395	正弦电气	409	9,038.90	0.02
334	688819	天能股份	400	8,880.00	0.01
335	688595	芯海科技	200	8,772.00	0.01
336	688613	奥精医疗	600	8,466.00	0.01
337	688568	中科星图	200	8,294.00	0.01
338	688707	振华新材	600	7,710.00	0.01
339	688070	纵横股份	200	7,466.00	0.01
340	688108	赛诺医疗	400	7,412.00	0.01
341	688334	西高院	400	7,256.00	0.01
342	688425	铁建重工	1,800	7,236.00	0.01
343	688166	博瑞医药	200	7,002.00	0.01
344	688156	路德科技	200	6,050.00	0.01
345	688062	迈威生物	200	5,650.00	0.01
346	688152	麒麟信安	200	5,496.00	0.01
347	688077	大地熊	200	5,298.00	0.01
348	688327	云从科技	400	4,984.00	0.01
349	688128	中国电研	200	4,748.00	0.01
350	688522	纳睿雷达	200	4,004.00	0.01
351	688553	汇宇制药	376	3,996.88	0.01
352	688292	浩瀚深度	200	3,720.00	0.01
353	688360	德马科技	200	3,580.00	0.01
354	688303	大全能源	200	3,486.00	0.01
355	688365	光云科技	200	3,154.00	0.01

356	688276	百克生物	200	2,788.00	0.00
357	688219	会通股份	200	2,588.00	0.00
358	688586	江航装备	200	2,338.00	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	002134	天津普林	4,600	139,932.00	0.23
2	301328	维峰电子	1,810	128,872.00	0.21
3	301086	鸿富瀚	540	113,011.20	0.19
4	002955	鸿合科技	3,000	107,250.00	0.18
5	002079	苏州固锟	6,900	103,707.00	0.17
6	301280	珠城科技	2,040	103,162.80	0.17
7	000534	万泽股份	3,700	101,232.00	0.17
8	603259	药明康德	800	99,608.00	0.17
9	301631	壹连科技	1,200	86,232.00	0.14
10	300508	维宏股份	1,500	86,145.00	0.14
11	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.14
12	301093	华兰股份	600	81,378.00	0.14
13	601966	玲珑轮胎	7,500	76,425.00	0.13
14	002768	国恩股份	1,380	71,842.80	0.12
15	603823	百合花	1,300	70,941.00	0.12
16	300731	科创新源	1,140	66,530.40	0.11
17	301396	宏景科技	200	66,320.00	0.11
18	603990	麦迪科技	2,900	61,741.00	0.10
19	300774	倍杰特	5,700	61,275.00	0.10
20	002384	东山精密	200	52,470.00	0.09
21	600967	内蒙一机	4,800	52,080.00	0.09
22	301371	敷尔佳	2,000	52,000.00	0.09

23	301536	星宸科技	400	51,484.00	0.09
24	301538	骏鼎达	1,000	50,370.00	0.08
25	603061	金海通	100	50,222.00	0.08
26	300570	太辰光	200	49,342.00	0.08
27	002745	木林森	3,800	47,690.00	0.08
28	300154	瑞凌股份	6,200	46,624.00	0.08
29	300922	天秦装备	3,000	45,450.00	0.08
30	301383	天键股份	1,900	45,410.00	0.08
31	300968	格林精密	4,600	44,344.00	0.07
32	002724	海洋王	9,100	44,135.00	0.07
33	301180	万祥科技	3,500	43,855.00	0.07
34	300982	苏文电能	2,900	43,819.00	0.07
35	300752	隆利科技	3,200	43,104.00	0.07
36	002266	浙富控股	8,400	42,504.00	0.07
37	002876	三利谱	1,200	42,252.00	0.07
38	002045	国光电器	5,300	41,605.00	0.07
39	300285	国瓷材料	400	41,272.00	0.07
40	001339	智微智能	390	39,889.20	0.07
41	300822	贝仕达克	3,400	39,780.00	0.07
42	000020	深华发 A	3,600	39,240.00	0.07
43	300586	美联新材	2,500	39,100.00	0.07
44	300991	创益通	1,100	38,731.00	0.06
45	600566	济川药业	1,700	37,723.00	0.06
46	000532	华金资本	3,500	37,590.00	0.06
47	002971	和远气体	600	37,200.00	0.06
48	300684	中石科技	600	36,600.00	0.06
49	300576	容大感光	700	35,854.00	0.06
50	002993	奥海科技	500	35,805.00	0.06
51	603931	格林达	600	35,640.00	0.06
52	301018	申菱环境	300	34,683.00	0.06
53	300857	协创数据	100	33,990.00	0.06

54	603296	华勤技术	440	32,678.80	0.05
55	603067	振华股份	700	32,403.00	0.05
56	300054	鼎龙股份	300	31,791.00	0.05
57	300942	易瑞生物	5,500	31,790.00	0.05
58	301132	满坤科技	600	31,512.00	0.05
59	301316	慧博云通	800	31,504.00	0.05
60	300740	水羊股份	1,700	31,297.00	0.05
61	600885	宏发股份	900	31,041.00	0.05
62	300951	博硕科技	600	30,300.00	0.05
63	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.05
64	301195	北路智控	1,100	29,810.00	0.05
65	300672	国科微	100	29,500.00	0.05
66	300393	中来股份	4,000	29,160.00	0.05
67	301017	漱玉平民	2,200	28,688.00	0.05
68	300032	金龙机电	7,400	28,120.00	0.05
69	300787	海能实业	3,000	27,360.00	0.05
70	600714	金瑞矿业	1,300	26,689.00	0.04
71	301202	朗威股份	800	26,664.00	0.04
72	301183	东田微	100	26,487.00	0.04
73	300401	花园生物	1,200	26,268.00	0.04
74	300891	惠云钛业	4,100	25,953.00	0.04
75	300913	兆龙互连	500	23,955.00	0.04
76	002895	川恒股份	800	23,360.00	0.04
77	003019	宸展光电	700	22,785.00	0.04
78	603633	徕木股份	3,300	22,473.00	0.04
79	300956	英力股份	1,900	21,356.00	0.04
80	300512	中亚股份	3,100	21,142.00	0.04
81	605196	华通线缆	800	20,880.00	0.03
82	301282	金禄电子	700	20,643.00	0.03
83	300248	新开普	2,600	20,046.00	0.03
84	605218	伟时电子	1,200	19,836.00	0.03

85	603262	技源集团	800	19,696.00	0.03
86	300465	高伟达	1,800	19,674.00	0.03
87	688818	电科蓝天	279	19,569.06	0.03
88	301362	民爆光电	100	18,392.00	0.03
89	300164	通源石油	2,100	16,800.00	0.03
90	300940	南极光	1,100	16,588.00	0.03
91	301016	雷尔伟	1,180	16,484.60	0.03
92	300921	南凌科技	800	16,248.00	0.03
93	000701	厦门信达	3,600	15,948.00	0.03
94	301172	君逸数码	600	15,570.00	0.03
95	301051	信濠光电	800	15,520.00	0.03
96	002981	朝阳科技	800	14,752.00	0.02
97	603703	盛洋科技	1,300	14,430.00	0.02
98	300681	英搏尔	500	14,310.00	0.02
99	300389	艾比森	1,100	14,102.00	0.02
100	688712	北芯生命	392	14,080.64	0.02
101	301277	新天地	1,600	14,000.00	0.02
102	600071	凤凰光学	800	13,704.00	0.02
103	301448	开创电气	300	13,614.00	0.02
104	603380	易德龙	300	13,527.00	0.02
105	603392	万泰生物	500	13,485.00	0.02
106	688785	恒运昌	29	13,431.35	0.02
107	603897	长城科技	400	12,984.00	0.02
108	301150	中一科技	200	12,622.00	0.02
109	001314	亿道信息	200	12,360.00	0.02
110	300909	汇创达	200	11,644.00	0.02
111	600875	东方电气	400	11,508.00	0.02
112	301191	菲菱科思	100	11,355.00	0.02
113	000733	振华科技	200	11,328.00	0.02
114	002534	西子洁能	600	11,130.00	0.02
115	603556	海兴电力	500	11,000.00	0.02

116	001239	永达股份	800	10,576.00	0.02
117	600764	中国海防	600	10,458.00	0.02
118	603020	爱普股份	700	9,870.00	0.02
119	688813	泰金新能	56	9,637.04	0.02
120	300122	智飞生物	800	9,352.00	0.02
121	301387	光大同创	100	9,242.00	0.02
122	002410	广联达	1,100	8,976.00	0.01
123	605399	晨光新材	600	8,814.00	0.01
124	688729	屹唐股份	200	8,600.00	0.01
125	603382	海阳科技	500	8,575.00	0.01
126	301516	中远通	600	8,490.00	0.01
127	300314	戴维医疗	900	8,379.00	0.01
128	600488	津药药业	1,700	8,211.00	0.01
129	300902	国安达	500	8,195.00	0.01
130	301252	同星科技	200	8,106.00	0.01
131	002990	盛视科技	100	7,900.00	0.01
132	605008	长鸿高科	700	7,777.00	0.01
133	603327	福蓉科技	900	7,632.00	0.01
134	002923	润都股份	800	7,568.00	0.01
135	002632	道明光学	800	7,208.00	0.01
136	301187	欧圣电气	500	7,155.00	0.01
137	001360	南矿集团	400	7,076.00	0.01
138	301398	星源卓镁	200	7,022.00	0.01
139	300920	润阳科技	200	6,910.00	0.01
140	688805	健信超导	147	6,904.59	0.01
141	301602	超研股份	500	6,870.00	0.01
142	688781	视涯科技	144	6,855.84	0.01
143	603016	新宏泰	200	6,752.00	0.01
144	603270	金帝股份	200	6,702.00	0.01
145	600482	中国动力	200	6,560.00	0.01
146	601231	环旭电子	200	6,480.00	0.01

147	002913	奥士康	100	6,394.00	0.01
148	603070	万控智造	500	6,290.00	0.01
149	300445	康斯特	300	6,246.00	0.01
150	000410	沈阳机床	1,300	6,032.00	0.01
151	301479	弘景光电	100	6,020.00	0.01
152	301221	光庭信息	200	5,902.00	0.01
153	603659	璞泰来	200	5,786.00	0.01
154	002097	山河智能	800	5,784.00	0.01
155	300435	中泰股份	200	5,414.00	0.01
156	300790	宇瞳光学	200	5,222.00	0.01
157	600771	广誉远	400	5,180.00	0.01
158	300602	飞荣达	100	5,120.00	0.01
159	603181	皇马科技	300	4,866.00	0.01
160	000533	顺钠股份	500	4,755.00	0.01
161	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.01
162	300623	捷捷微电	100	4,499.00	0.01
163	600750	华润江中	200	4,414.00	0.01
164	300111	向日葵	1,500	4,320.00	0.01
165	301255	通力科技	200	4,238.00	0.01
166	600989	宝丰能源	200	4,066.00	0.01
167	603277	银都股份	400	3,992.00	0.01
168	300677	英科医疗	100	3,917.00	0.01
169	002064	华峰化学	400	3,796.00	0.01
170	300471	厚普股份	400	3,444.00	0.01
171	300756	金马游乐	100	3,305.00	0.01
172	300351	永贵电器	200	3,300.00	0.01
173	600271	航天信息	500	3,290.00	0.01
174	603683	晶华新材	100	3,082.00	0.01
175	301239	普瑞眼科	100	3,045.00	0.01
176	301112	信邦智能	100	3,024.00	0.01
177	000792	盐湖股份	100	3,019.00	0.01

178	600571	信雅达	300	2,925.00	0.00
179	000403	派林生物	300	2,637.00	0.00
180	300669	沪宁股份	100	2,630.00	0.00
181	605366	宏柏新材	200	2,606.00	0.00
182	605286	同力天启	100	2,549.00	0.00
183	300118	东方日升	200	2,490.00	0.00
184	600426	华鲁恒升	100	2,392.00	0.00
185	603217	元利科技	100	2,243.00	0.00
186	688816	易思维	38	2,169.80	0.00
187	601112	振石股份	103	1,811.77	0.00
188	301268	铭利达	100	1,398.00	0.00
189	300758	七彩化学	100	1,255.00	0.00
190	300171	东富龙	100	1,106.00	0.00
191	603352	至信股份	41	1,046.32	0.00
192	603284	林平发展	19	662.53	0.00
193	301062	上海艾录	100	571.00	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	688525	佰维存储	1,551,380.99	1.36
2	688702	盛科通信	1,094,392.00	0.96
3	688082	盛美上海	1,023,112.08	0.90
4	688469	芯联集成	995,020.20	0.87
5	688396	华润微	974,668.42	0.86
6	688498	源杰科技	968,140.00	0.85
7	688981	中芯国际	945,256.04	0.83
8	688249	晶合集成	941,143.22	0.83

9	688012	中微公司	934,088.31	0.82
10	688183	生益电子	928,700.20	0.82
11	688428	诺诚健华	851,414.78	0.75
12	688802	沐曦股份	851,124.00	0.75
13	688757	胜科纳米	835,875.78	0.73
14	688072	拓荆科技	810,599.56	0.71
15	688002	睿创微纳	797,876.07	0.70
16	688322	奥比中光	792,942.61	0.70
17	688387	信科移动	776,424.33	0.68
18	688046	药康生物	731,355.57	0.64
19	688347	华虹宏力	727,905.35	0.64
20	688385	复旦微电	722,974.83	0.63

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	6,654,611.06	5.84
2	688256	寒武纪	6,093,591.20	5.35
3	688981	中芯国际	3,893,894.18	3.42
4	688008	澜起科技	3,487,581.93	3.06
5	688012	中微公司	3,430,254.07	3.01
6	688223	晶科能源	1,733,286.00	1.52
7	688469	芯联集成	1,667,584.00	1.46
8	688111	金山办公	1,632,961.27	1.43
9	688141	杰华特	1,614,485.54	1.42
10	688072	拓荆科技	1,574,321.51	1.38
11	688521	芯原股份	1,553,545.79	1.36
12	688525	佰维存储	1,476,431.05	1.30
13	688271	联影医疗	1,374,298.07	1.21

14	688728	格科微	1,317,609.27	1.16
15	688107	安路科技	1,312,894.71	1.15
16	688371	菲沃泰	1,197,783.98	1.05
17	688512	慧智微	1,193,446.41	1.05
18	688347	华虹宏力	1,191,327.34	1.05
19	688220	翱捷科技	1,151,421.58	1.01
20	688506	百利天恒	1,141,005.56	1.00

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	170,352,709.04
卖出股票收入（成交）总额	250,123,634.59

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	24,157.61	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,157.61	0.04

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	118068	迪威转债	90	14,157.17	0.02
2	118072	鼎通转债	50	5,000.15	0.01
3	118070	南芯转债	30	3,000.17	0.00
4	113703	翔26转债	10	1,000.10	0.00
5	118071	华峰转债	10	1,000.02	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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没有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	6,510.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,510.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	688072	拓荆科技	1,350,336.00	2.25	停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§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
泓德 上证 科创 板综 合指 数增 强A	287	36,871.00	1,988,871.57	18.7 9%	8,593,105.79	81.21%
泓德 上证 科创 板综 合指 数增 强C	949	28,525.37	1,200,188.34	4.43%	25,870,392.16	95.57%
合计	1,2 09	31,143.55	3,189,059.91	8.47%	34,463,497.95	91.53%

注：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	泓德上证科创板综合指数增强A	122,317.63	1.16%
	泓德上证科创板综合指数增强C	112,249.61	0.41%
	合计	234,567.24	0.62%

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德上证科创板综合指数增强A	泓德上证科创板综合指数增强C
基金合同生效日(2025年08月04日)基金份额总额	88,263,422.83	407,331,277.35
本报告期期初基金份额总额	23,087,812.04	83,897,594.46
本报告期基金总申购份额	7,927,445.55	16,155,630.36
减：本报告期基金总赎回份额	20,433,280.23	72,982,644.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,581,977.36	27,070,580.50

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，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

(1) 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

(2) 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

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期未发生公司被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

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，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

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	
中信证券	2	316,184,888.85	75.22%	58,780.18	75.22%	-
西南证券	3	72,239,492.97	17.19%	13,430.44	17.19%	-
东海证券	3	31,905,546.54	7.59%	5,931.99	7.59%	-

- 注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择中信证券、西南证券、东海证券作为证券经纪商。
- 2、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》中关于交易佣金分仓的规定。
- 3、基金专用交易单元的选择标准如下：
- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
 - （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
 - （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。
- 4、基金专用交易单元的选择程序如下：
- （1）本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
 - （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

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
中信证券	88,470.30	64.94%	-	-	-	-	-	-

西南证 券	34,695.53	25.47%	-	-	-	-	-	-
东海证 券	13,069.79	9.59%	-	-	-	-	-	-

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	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-28
3	泓德基金管理有限公司关于泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-05
4	泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
5	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-18
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-22

§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
无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日