

人保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:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:苏州银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月20日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	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	13
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	15
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§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	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	79
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	79
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	79
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
7.12 投资组合报告附注	79
§8 基金份额持有人信息	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81

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.....	81
§9 开放式基金份额变动.....	82
§10 重大事件揭示.....	82
10.1 基金份额持有人大会决议.....	82
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	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	82
10.4 基金投资策略的改变	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
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	83
10.8 其他重大事件	84
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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.....	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§12 备查文件目录.....	86
12.1 备查文件目录	86
12.2 存放地点.....	86
12.3 查阅方式.....	86

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	人保上证科创板综合指数增强	
基金主代码	024741	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年01月20日	
基金管理人	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	96,211,630.51份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保上证科创板综合 指数增强A	人保上证科创板综合 指数增强C
下属分级基金的交易代码	024741	024742
报告期末下属分级基金的份额总额	90,210,327.35份	6,001,303.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化方法进行组合管理和风险控制，在力求对标的指数上证科创板综合指数有效跟踪的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.50%，年跟踪误差不超过8.0%。
投资策略	1、资产配置策略； 2、股票投资策略。本基金为增强型股票指数基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。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。本基金在追求超额收益的同时，需要控制跟踪偏离过大的风险。本基金将根据投资组合相对标的指数的暴露度等

	因素的分析，对组合跟踪效果进行预估，及时调整投资组合，力求将跟踪误差控制在目标范围内。 本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用量化方法精选出具有投资价值的优质标的。其筛选维度主要包括但不限于：治理结构与管理层（例如：良好的公司治理结构，优秀、诚信的公司管理层等）、行业集中度及行业地位（例如：具备独特的核心竞争优势，如产品优势、成本优势、技术优势和定价能力等）、公司业绩表现（例如：业绩稳定并持续、具备中长期持续增长的能力等）。 3、债券投资策略；4、可转换债券及可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、参与国债期货交易策略；7、参与股指期货交易策略；8、股票期权投资策略；9、融资投资策略；10、参与转融通证券出借业务投资策略；11、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，追求实现超越业绩比较基准的投资回报，长期来看，本基金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。本基金如投资港股通标的股票，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	苏州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	董平
	联系电话	021-38572076	0512-69868888-91017
	电子邮箱	guolq@piccamc.com	custodyacc@suzhoubank.com

客户服务电话	400-820-7999	96067
传真	021-50765598	0512-65135118
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
邮政编码	100031	215100
法定代表人	黄明	崔庆军

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	fund.piccamc.com
基金中期报告置备地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

§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20日（基金合同生效日）-202
---------------	----------------------------------

	6年06月30日)	
	人保上证科创板综合指数增强A	人保上证科创板综合指数增强C
本期已实现收益	55,890,606.81	3,638,535.57
本期利润	81,509,972.12	4,811,921.11
加权平均基金份额本期利润	0.2536	0.2646
本期加权平均净值利润率	25.27%	26.05%
本期基金份额净值增长率	40.65%	40.40%
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	34,815,460.26	2,301,501.77
期末可供分配基金份额利润	0.3859	0.3835
期末基金资产净值	126,881,081.72	8,425,718.73
期末基金份额净值	1.4065	1.4040
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	40.65%	40.40%

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

3、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同于2026年1月20日生效，本期数据按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

人保上证科创板综合指数增强A

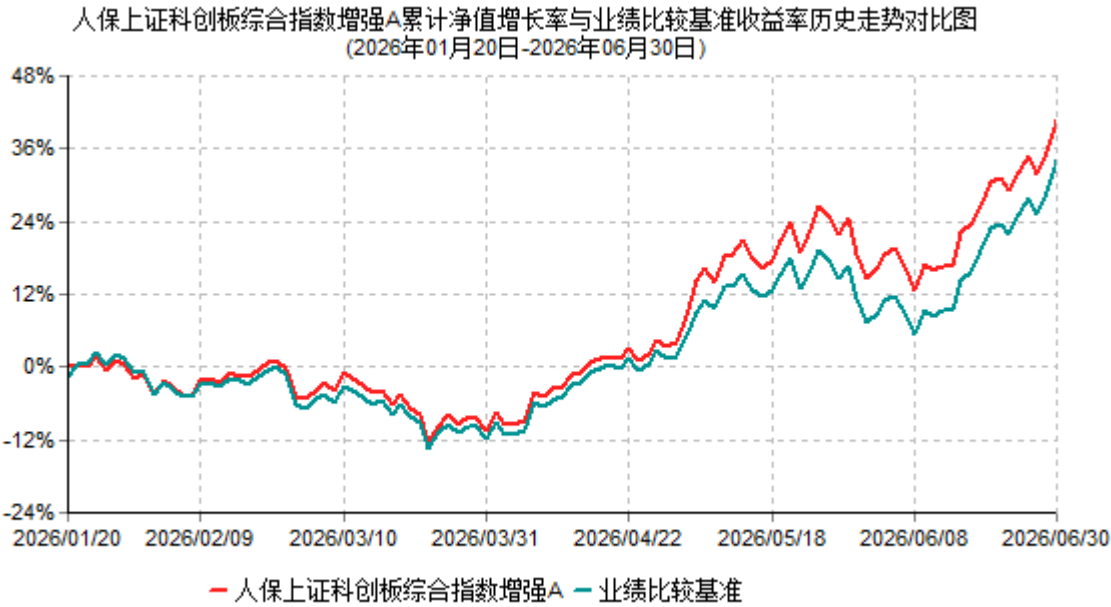
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

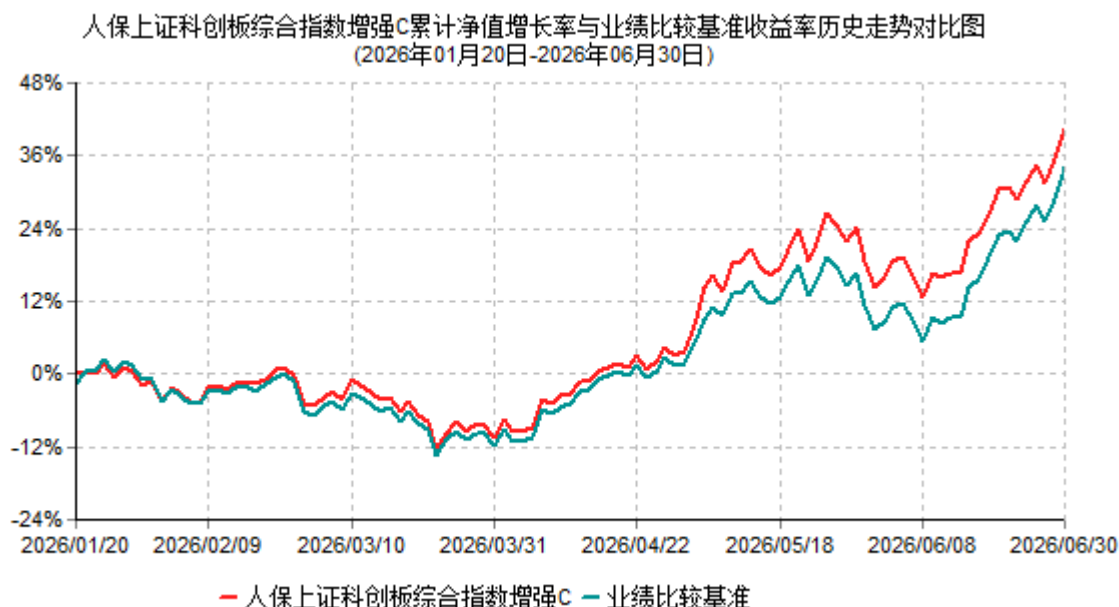
				④		
过去三个月	56.98%	2.37%	52.44%	2.24%	4.54%	0.13%
自基金合同生效起至今	40.65%	2.21%	34.25%	2.15%	6.40%	0.06%

人保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	56.82%	2.37%	52.44%	2.24%	4.38%	0.13%
自基金合同生效起至今	40.40%	2.21%	34.25%	2.15%	6.15%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：1、本基金基金合同于2026年1月20日生效。根据基金合同约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金仍在建仓期内。建仓期满后，本基金的各项投资比例应符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

§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

中国人保资产管理有限公司成立于2003年7月，系境内第一家保险资产管理公司，受托对人保集团内保险资金以及第三方资金实施集中化、专业化和市场化的投资管理，目前管理资产总规模近2万亿元。

公司拥有信用风险管理、股票投资管理、衍生品运用管理（股指期货和国债期货）、债权投资计划产品管理、股权投资计划产品管理等五大投资管理能力；具备境外投资业务、组合类保险资产管理产品业务、资产支持计划产品业务、集合资金信托投资等四项投资资质；拥有中国证监会颁发的公募基金业务牌照，获选全国社会保障基金理事会养老基金管理人，是中国资本市场秉持价值投资、长期投资理念，为客户创造绝对收益的重要机构投资者。

成立二十多年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管

控的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

人保资产是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，建立了较为完善的投研一体化平台和全面风险管理体系，不断提升资产负债匹配管理的精细化水平，坚持服务保险主业、服务国家战略。人保资产拥有一支具备国际投资视野、历经市场周期的高素质投研人才队伍，设立国家级博士后工作站。

人保资产通过实施投资赋能工程，加快推进公司高质量发展，建设服务大局、业绩突出、综合实力领先的一流综合资管公司，构建了市场化、专业化的人力资源管理机制，为青年员工提供定制化的人才培养计划、丰富的跨部门岗位历练平台以及多元化的职业发展通道，帮助员工能力成长。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2026年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、人保泰和积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、人保红利智享混合型证券投资基金、人保中证800指数增强型证券投资基金、人保中证A500指数增强型证券投资基金、人保核心智选混合型证券投资基金、人保中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、人保均衡智选混合型证券投资基金、人保中证A50指数增强型证券投资基金、人保中证500指数增强型证券投资基金、人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金、人保创业板综合指数增强型证券投资基金、人保中证港股通互联网指数型证券投资基金、人保睿逸智选混合型证券投资基金、人保新锐智选混合型证券投资基金、人保民鸿混合型证券投资基金、人保安悦债券型证券投资基金等。

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）	证券 从业	说明
----	----	-------------------	----------	----

		期限		年限	
		任职日期	离任日期		
刘石开	基金经理	2026-01-20	-	16.9年	上海交通大学理学硕士。历任银联商务有限公司数据分析员；长江证券股份有限公司高级产品开发经理；海富通基金管理有限公司数量分析师、基金经理助理；财通基金管理有限公司投资经理；长城证券股份有限公司资产管理部投资经理；2024年3月加入人保资产公募基金事业部。2024年9月19日起任人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2024年9月19日至2026年2月27日任人保行业轮动混合型证券投资基金基金经理，2024年12月23日起任人保中证800指数增强型证券投资基金基金经理，2025年3月28日起任人保中证A500指数增强型证券投资基金基金经理，2025年5月14日起任人保核心智选混合型证券投资基金基金经理，2025年9月26日起任人保均衡智选混合型证券投资基金基金经理，2026年1月20日起任人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2026年1月21日起任人保中证A5

					0指数增强型证券投资基金基金经理，2026年2月11日起任人保创业板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2026年4月30日起任人保新锐智选混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为本基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其"任职日期"为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合，建立了公平交易制度和流程。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》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

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

价值红利维度，上半年市场整体呈震荡抬升、结构分化态势，市场风格由一季度防御避险，逐步过渡至二季度稳健进攻，整体风格切换清晰、节奏有序。高股息、低估值红利板块全程具备扎实防御属性，阶段性托底市场走势，但随着行情演绎，板块超额收益有所收敛，市场资金布局重心持续动态优化。稳分红、低波动的核心价值标的全程受

长线资金青睐，配置稳定性较强；中小盘价值凭借估值修复空间更大、弹性更高的优势，整体修复表现显著优于大盘价值，成为价值行情主力。“中特估”叠加高股息的核心策略全程有效，市场逐步摒弃单纯的低估值炒作逻辑，持续聚焦基本面扎实、现金流稳定、分红机制完善的优质标的，整体呈现持续性结构性修复行情，无普涨普跌走势。

盈利质量层面，上半年市场板块盈利分化态势持续加剧，行业景气度差异逐步拉大。硬科技、高端制造、优质周期等高景气赛道，依托下游行业需求持续回暖、产业政策持续落地加持，盈利韧性充足，季度业绩持续兑现，基本面支撑扎实，成为上半年市场核心配置主线与资金重仓方向。消费、金融等传统板块复苏节奏偏缓，内需修复力度不足、行业景气度偏弱，整体盈利增长持续承压，资金配置意愿偏弱、持仓占比持续收缩。整体市场资金偏好全程聚焦业绩确定性高、基本面扎实、盈利质量优异的优质标的，坚决规避无业绩支撑、纯概念炒作的题材标的，投资理性度持续提升。

成长优选方面，上半年成长风格完成筑底回升、强势回归，结构性行情特征贯穿始终。中小盘成长全程延续强势表现，走势持续跑赢大盘成长，是上半年成长行情的核心主力。AI算力、高端智造、机器人等新兴高景气成长赛道市场活跃度居高不下，产业迭代加速、行业订单持续落地，成为驱动成长行情的核心动力。部分高位大盘成长、纯题材类科创板块，受估值消化回调、市场资金调仓换股影响阶段性回落，成长赛道内部结构性分化显著，行情彻底告别普涨模式，全面转向业绩兑现、择优上涨的精细化结构格局。

量价挖掘角度，上半年市场成交中枢稳步抬升，整体流动性环境优于往年同期，市场波动有序放大，结构性二八分化格局凸显。市场资金抱团特征清晰且持续强化，资金持续集中流向高景气优势赛道，板块轮动节奏逐步放缓，市场核心主线愈发明确。市场量价表现分层特征显著，中小盘成长及各细分赛道龙头量价协同性良好，上行趋势明确、走势稳健；大盘权重指数整体量能收缩、走势偏弱，量价匹配度不足，权重托底作用弱化，结构性行情贯穿上半年整体市场。

我们长期依托价值红利、盈利质量、成长优选、量价挖掘四大维度搭建增强策略体系，分维度精细化构建投资组合，并根据市场行情变化动态迭代优化策略。结合上半年成长主导、业绩为王、极致结构分化的核心市场特征，通过动态调整组合风格结构、优化行业与个股分散配置，兼顾组合攻守双重属性，精准捕捉各阶段结构性投资机会，持续增厚组合超额收益，实现策略适配市场行情的动态平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保上证科创板综合指数增强A基金份额净值为1.4065元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为40.65%，同期业绩比较基准收益率为34.25%；截至报告期末人保上证科创板综合指数增强C基金份额净值为1.4040元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为40.40%，同期业绩比较基准收益率为34.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年市场整体延续结构性分化行情，市场风格或实现稳健均衡切换，前期价值托底、成长主导的市场格局，有望逐步向价值修复与成长轮动的双向共振态势演变，整体行情演绎大概率更趋理性均衡。从价值红利维度来看，高股息、低估值优质标的或持续具备底部支撑韧性，前期收敛的超额收益存在稳步修复空间，市场资金预计持续聚焦分红稳定、现金流优质的核心价值标的，纯粹低估值炒作行情大概率持续退潮，中特估优质标的的结构性修复行情存在延续性。

从盈利质量层面判断，市场业绩分化格局大概率延续，高景气赛道盈利韧性有望持续凸显，政策与需求双向赋能的优质行业存在持续业绩兑现的可能性，预计持续占据市场核心配置主线地位。传统板块存在温和修复的预期，行业景气度或迎来边际改善。成长赛道大概率延续择优上涨格局，高端智造、新兴科技等优质成长领域产业迭代动能充足，具备较强的业绩兑现潜力。整体市场资金预计持续坚守业绩为王的投资逻辑，优先布局基本面扎实的优质标的。

从流动性与量价层面分析，市场流动性大概率维持平稳充裕状态，板块轮动节奏有望更具条理，核心赛道的资金抱团格局存在持续延续的概率。后续将持续依托四维增强策略体系，结合市场动态演绎趋势优化组合结构，平衡组合攻守属性，精准捕捉阶段性市场轮动机会，力争稳步增厚组合投资收益。

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中国证监会相关规定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。会计师事务所所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、投研、交易、合规风控及运营等部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人--中国人保资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中国人保资产管理有限公司编制和披露的本基金中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：人保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
资 产:		
货币资金	6.4.7.1	9,467,433.12
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	126,857,961.28

其中：股票投资		126,857,961.28
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		497,848.47
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		136,823,242.87
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,388,841.74
应付管理人报酬		89,270.66
应付托管费		16,738.24
应付销售服务费		3,833.42
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	17,758.36

负债合计		1,516,442.42
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	96,211,630.51
未分配利润	6.4.7.8	39,095,169.94
净资产合计		135,306,800.45
负债和净资产总计		136,823,242.87

注：1、报告截止日2026年06月30日，人保上证科创板综合指数增强A份额净值人民币1.4065元，基金份额总额90,210,327.35份；人保上证科创板综合指数增强C份额净值人民币1.4040元，基金份额总额6,001,303.16份；总份额合计96,211,630.51份。

2、本基金合同于2026年01月20日生效，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：人保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20日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月20日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		87,817,566.46
1.利息收入		17,077.61
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,077.61
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）		60,334,644.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	60,020,793.92
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	313,850.10
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	26,792,750.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	673,093.98
减：二、营业总支出		1,495,673.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,222,429.48
2.托管费	6.4.10.2.2	229,205.55
3.销售服务费	6.4.10.2.3	32,801.88
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.19	11,236.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		86,321,893.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		86,321,893.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		86,321,893.23

注：本基金合同于2026年01月20日生效，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：人保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20日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2026年01月20日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	463,826,128.11	-	463,826,128.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-367,614,497.60	39,095,169.94	-328,519,327.66
（一）、综合收益总额	-	86,321,893.23	86,321,893.23
（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）	-367,614,497.60	-47,226,723.29	-414,841,220.89
其中：1.基金申购款	71,189,593.01	8,344,703.95	79,534,296.96
2.基金赎回款	-438,804,090.61	-55,571,427.24	-494,375,517.85
（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	96,211,630.51	39,095,169.94	135,306,800.45

注：本基金合同于2026年01月20日生效，本期数据按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄明

贾鸣

沈静

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

人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可【2025】1191号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不约定期限，首次设立募集基金份额为463,826,128.11份。基金合同于2026年1月20日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司，基金托管人为苏州银行股份有限公司。根据基金合同相关规定，本基金份额分为A类基金份额（以下简称“人保上证科创板综合指数增强A”）和C类基金份额（以下简称“人保上证科创板综合指数增强C”）两类份额。其中，人保上证科创板综合指数增强A是指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额；人保上证科创板综合指数增强C是指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但在赎回时收取赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于依法发行上市的非成份股（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称：“港股通标的股票”）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中期票据等）、资产支持证券、国债期货、股指期货、股票期权、债券回购、货币市场工具（包括银行存款、同业存单等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金还可根据法律法规的规定参与融资业务及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产及存托凭证占基金资产的比例不低于80%，其中投资标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%，投资于港股通标的股票的比例不超过全部股票资产的50%；每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、股票期权、国债期货及其他

金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款税后利率 $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年1月20日(基金合同生效日)至2026年6月30日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历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自2026年1月20日(基金合同生效日)起至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和资产支持证券投资等。

本基金通常根据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,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b)后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

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

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

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

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

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

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

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

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

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估

值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

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认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

（2）投资收益

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

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

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

（3）公允价值变动收益

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后均不能低于面值；

4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）

的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026年06月30日
活期存款	5,758,029.98
等于：本金	5,757,784.32
加：应计利息	245.66
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	3,709,403.14
等于：本金	3,709,329.18
加：应计利息	73.96
减：坏账准备	-
合计	9,467,433.12

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		100,065,210.43	-	126,857,961.28	26,792,750.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	100,065,210.43	-	126,857,961.28	26,792,750.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,100.80
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	11,236.32
其他应付	1,421.24
合计	17,758.36

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 人保上证科创板综合指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (人保上证科创板综合指数增强A)	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	440,258,842.04	440,258,842.04
本期申购	58,574,313.08	58,574,313.08
本期赎回（以“-”号填列）	-408,622,827.77	-408,622,827.77
本期末	90,210,327.35	90,210,327.35

6.4.7.7.2 人保上证科创板综合指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (人保上证科创板综合指数增强C)	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	23,567,286.07	23,567,286.07
本期申购	12,615,279.93	12,615,279.93
本期赎回（以“-”号填列）	-30,181,262.84	-30,181,262.84
本期末	6,001,303.16	6,001,303.16

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 人保上证科创板综合指数增强A

单位：人民币元

项目 (人保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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	55,890,606.81	25,619,365.31	81,509,972.12

本期基金份额交易产生的变动数	-21,075,146.55	-23,764,071.20	-44,839,217.75
其中：基金申购款	8,044,504.50	-2,023,499.98	6,021,004.52
基金赎回款	-29,119,651.05	-21,740,571.22	-50,860,222.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,815,460.26	1,855,294.11	36,670,754.37

6.4.7.8.2 人保上证科创板综合指数增强C

单位：人民币元

项目 (人保上证科创板综合 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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,638,535.57	1,173,385.54	4,811,921.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,337,033.80	-1,050,471.74	-2,387,505.54
其中：基金申购款	2,876,236.55	-552,537.12	2,323,699.43
基金赎回款	-4,213,270.35	-497,934.62	-4,711,204.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,301,501.77	122,913.80	2,424,415.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	12,165.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,934.74
结算备付金利息收入	-
其他	1,977.21

合计	17,077.61
----	-----------

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	1,062,004,557.05
减：卖出股票成本总额	1,000,891,628.61
减：交易费用	1,092,134.52
买卖股票差价收入	60,020,793.92

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	313,850.10
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	313,850.10

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	26,792,750.85
——股票投资	26,792,750.85
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	26,792,750.85

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	641,750.16
基金认购款利息收入	31,212.02
转换费收入	131.80
合计	673,093.98

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	11,236.32
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	11,236.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大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

本基金本报告期内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
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
苏州银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国人民保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
中国人保香港资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
人保启元惠众（北京）私募基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
深圳市保腾盛私募股权基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
大成创新资本管理有限公司	基金管理人联营公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,222,429.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	517,539.83
应支付基金管理人的净管理费	704,889.65

注：1、支付基金管理人中国人保资产管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

2、本基金合同生效日为2026年1月20日。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	229,205.55

注：1、支付基金托管人苏州银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

2、本基金合同生效日为2026年1月20日。

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20日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保上证科创板综合指数增强A	人保上证科创板综合指数增强C	合计
中国人保资产管理有限公司	0.00	0.44	0.44
苏州银行股份有限公司	0.00	29,656.25	29,656.25
合计	0.00	29,656.69	29,656.69

注：1、本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值×0.40%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C类基金份额每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

2、本基金合同生效日为2026年1月20日。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况
本基金本报告期内无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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况
本基金本报告期内无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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本报告期末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年01月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
苏州银行股份有限公司	5,758,029.98	12,165.66

注：本基金由基金托管人苏州银行股份有限公司保管的银行存款利息收入，按银行同业或协议利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	116	9,498.08	183,782.28	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	670	13,185.60	94,798.30	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	56	2,495.36	26,245.52	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	73	2,991.54	22,497.87	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688260	昀冢科技	2026-06-26	-	144.00	2026-07-01	132.00	600	32,430.86	86,400.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	-	832.00	2026-07-13	890.99	3,400	1,542,610.26	2,828,800.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金

的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

为加强公募基金管理的内部控制，防范和化解经营风险，提高经营管理效益，保障基金持有人利益，基金管理人遵照中国法律和公司章程的规定履行职责，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公募基金事业部及各职能部门根据既定的业务规范、制度执行具体业务；董事会下设风险管理与消费者权益保护委员会、监事会、总裁室下设风险合规委员会、风险管理部、法律合规部为公司不同层面的监督机构，构成公司相对独立的监督系统。

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

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，主要包括利率风险、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。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日常通过对持仓品种组合的久期分析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0 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	9,467,433.12	-	-	-	9,467,433.12
交易性 金融资 产	-	-	-	126,857,961.28	126,857,961.28
应收申 购款	-	-	-	497,848.47	497,848.47
资产总 计	9,467,433.12	-	-	127,355,809.75	136,823,242.87
负债					
应付赎 回款	-	-	-	1,388,841.74	1,388,841.74
应付管 理人报 酬	-	-	-	89,270.66	89,270.66
应付托 管费	-	-	-	16,738.24	16,738.24
应付销	-	-	-	3,833.42	3,833.42

售服务费					
其他负债	-	-	-	17,758.36	17,758.36
负债总计	-	-	-	1,516,442.42	1,516,442.42
利率敏感度缺口	9,467,433.12	-	-	125,839,367.33	135,306,800.45

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

本基金本期末无债券投资，因此，市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

截至报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投	126,857,961.28	93.76

资		
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	126,857,961.28	93.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变	
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险	
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	1.业绩比较基准上升5%	6,736,990.65
	2.业绩比较基准下降5%	-6,736,990.65

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	123,588,012.09
第二层次	2,915,200.00
第三层次	354,749.19
合计	126,857,961.28

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	126,857,961.28	92.72
	其中：股票	126,857,961.28	92.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,467,433.12	6.92
8	其他各项资产	497,848.47	0.36
9	合计	136,823,242.87	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	96,935,623.76	71.64
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	21,944,954.89	16.22
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	1,861,662.66	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	762,012.98	0.56
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	121,504,254.29	89.80

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,237,921.19	3.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	118,104.00	0.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	210,000.00	0.16
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	218,624.00	0.16
J	金融业	133,068.00	0.10
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,003.80	0.01
M	科学研究和技术服务业	283,146.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	63,600.00	0.05
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	74,240.00	0.05

S	综合	-	-
	合计	5,353,706.99	3.96

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	6,927	11,052,374.85	8.17
2	688041	海光信息	22,355	8,278,056.50	6.12
3	688012	中微公司	13,000	6,090,500.00	4.50
4	688008	澜起科技	17,720	5,491,428.00	4.06
5	688981	中芯国际	32,000	5,082,240.00	3.76
6	688498	源杰科技	1,700	3,206,200.00	2.37
7	688525	佰维存储	6,100	3,017,853.00	2.23
8	688072	拓荆科技	3,400	2,828,800.00	2.09
9	688521	芯原股份	7,600	2,820,664.00	2.08
10	688120	华海清科	6,200	1,997,516.00	1.48
11	688347	华虹宏力	5,800	1,950,540.00	1.44
12	688795	摩尔线程	2,600	1,862,874.00	1.38
13	688361	中科飞测	3,900	1,677,000.00	1.24
14	688802	沐曦股份	1,900	1,573,770.00	1.16
15	688082	盛美上海	2,604	1,124,928.00	0.83
16	688702	盛科通信	2,300	896,977.00	0.66
17	688396	华润微	8,400	819,420.00	0.61
18	688126	沪硅产业	18,300	729,987.00	0.54
19	688629	华丰科技	3,800	712,538.00	0.53
20	688172	燕东微	8,500	711,110.00	0.53

21	688146	中船特气	2,000	699,980.00	0.52
22	688111	金山办公	2,700	575,235.00	0.43
23	688183	生益电子	4,300	569,320.00	0.42
24	688110	东芯股份	2,700	549,990.00	0.41
25	688536	思瑞浦	1,500	546,135.00	0.40
26	688002	睿创微纳	3,400	525,946.00	0.39
27	688388	嘉元科技	11,700	514,800.00	0.38
28	688127	蓝特光学	5,200	507,520.00	0.38
29	688167	炬光科技	1,300	460,473.00	0.34
30	688519	南亚新材	1,196	454,527.84	0.34
31	688387	信科移动	21,800	432,512.00	0.32
32	688017	绿的谐波	1,000	417,860.00	0.31
33	688668	鼎通科技	1,100	410,630.00	0.30
34	688506	百利天恒	1,374	403,997.22	0.30
35	688548	广钢气体	7,700	401,170.00	0.30
36	688459	哈铁科技	46,400	386,512.00	0.29
37	688600	皖仪科技	11,600	386,048.00	0.29
38	688378	奥来德	6,200	384,400.00	0.28
39	688766	普冉股份	499	382,533.40	0.28
40	688549	中巨芯	10,300	379,143.00	0.28
41	688215	瑞晟智能	9,400	377,504.00	0.28
42	688025	杰普特	800	376,000.00	0.28
43	688212	澳华内镜	12,700	373,380.00	0.28
44	688249	晶合集成	6,300	371,889.00	0.27
45	688357	建龙微纳	12,571	370,467.37	0.27
46	688390	固德威	3,400	368,934.00	0.27
47	688395	正弦电气	16,500	364,650.00	0.27
48	688099	晶晨股份	3,500	360,150.00	0.27
49	688370	丛麟科技	17,100	357,732.00	0.26
50	688627	精智达	493	352,495.00	0.26
51	688331	荣昌生物	2,700	351,702.00	0.26

52	688221	前沿生物	15,600	349,440.00	0.26
53	688203	海正生材	35,000	349,300.00	0.26
54	688455	科捷智能	18,435	343,997.10	0.25
55	688015	交控科技	22,100	339,898.00	0.25
56	688251	井松智能	13,200	338,316.00	0.25
57	688409	富创精密	1,088	333,200.00	0.25
58	688045	必易微	4,100	331,198.00	0.24
59	688266	泽璟制药	2,800	326,648.00	0.24
60	688517	金冠电气	18,300	319,884.00	0.24
61	688372	伟测科技	1,700	316,200.00	0.23
62	688313	仕佳光子	1,700	313,905.00	0.23
63	688200	华峰测控	592	310,859.20	0.23
64	688037	芯源微	700	307,335.00	0.23
65	688247	宣泰医药	40,700	306,064.00	0.23
66	688355	明志科技	15,873	305,555.25	0.23
67	688571	杭华股份	34,900	305,375.00	0.23
68	688080	映翰通	7,000	302,750.00	0.22
69	688376	美埃科技	2,600	302,380.00	0.22
70	688048	长光华芯	600	301,200.00	0.22
71	688503	聚和材料	2,236	296,717.20	0.22
72	688392	骄成超声	1,300	295,334.00	0.22
73	688265	南模生物	8,500	294,015.00	0.22
74	688092	爱科科技	13,700	290,988.00	0.22
75	688558	国盛智科	8,800	289,168.00	0.21
76	688162	巨一科技	12,200	288,408.00	0.21
77	688186	广大特材	18,800	284,820.00	0.21
78	688188	柏楚电子	2,660	283,822.00	0.21
79	688687	凯因科技	17,400	283,794.00	0.21
80	688271	联影医疗	2,800	283,444.00	0.21
81	688273	麦澜德	7,300	282,802.00	0.21
82	688157	松井股份	10,600	279,734.00	0.21

83	688136	科兴制药	13,500	279,585.00	0.21
84	688557	兰剑智能	8,983	278,742.49	0.21
85	688380	中微半导	4,200	276,822.00	0.20
86	688606	奥泰生物	6,700	275,236.00	0.20
87	688147	微导纳米	1,700	275,196.00	0.20
88	688630	芯碁微装	500	274,695.00	0.20
89	688075	安旭生物	9,200	273,792.00	0.20
90	688597	煜邦电力	42,100	273,650.00	0.20
91	688070	纵横股份	7,300	272,509.00	0.20
92	688569	铁科轨道	16,800	271,320.00	0.20
93	688533	上声电子	12,998	271,138.28	0.20
94	688129	东来技术	10,348	271,014.12	0.20
95	688285	高铁电气	37,700	270,309.00	0.20
96	688777	中控技术	2,300	270,250.00	0.20
97	688718	唯赛勃	16,900	269,893.00	0.20
98	688592	司南导航	6,494	269,111.36	0.20
99	688692	达梦数据	1,100	268,719.00	0.20
100	688449	联芸科技	3,100	267,561.00	0.20
101	688310	迈得医疗	17,400	267,438.00	0.20
102	688113	联测科技	7,600	266,760.00	0.20
103	688588	凌志软件	29,300	266,337.00	0.20
104	688681	科汇股份	19,019	265,885.62	0.20
105	688280	精进电动	48,400	265,716.00	0.20
106	688466	金科环境	20,600	264,298.00	0.20
107	688288	鸿泉技术	14,800	262,996.00	0.19
108	688329	艾隆科技	13,000	262,730.00	0.19
109	688358	祥生医疗	8,552	261,434.64	0.19
110	688343	云天励飞	3,200	261,312.00	0.19
111	688089	嘉必优	24,600	261,006.00	0.19
112	688722	同益中	17,200	260,924.00	0.19
113	688301	奕瑞科技	2,100	260,400.00	0.19

114	688700	东威科技	2,900	259,260.00	0.19
115	688400	凌云光	3,900	258,180.00	0.19
116	688026	洁特生物	16,300	256,073.00	0.19
117	688416	恒烁股份	1,811	253,540.00	0.19
118	688027	国盾量子	500	252,005.00	0.19
119	688077	大地熊	9,511	251,946.39	0.19
120	688531	日联科技	1,400	248,976.00	0.18
121	688279	峰昭科技	1,100	246,884.00	0.18
122	688501	青达环保	12,300	236,160.00	0.17
123	688690	纳微科技	5,300	233,730.00	0.17
124	688182	灿勤科技	5,300	228,271.00	0.17
125	688258	卓易信息	1,900	225,226.00	0.17
126	688469	芯联集成	21,200	224,932.00	0.17
127	688535	华海诚科	1,200	224,400.00	0.17
128	688019	安集科技	650	220,649.00	0.16
129	688059	华锐精密	1,100	219,681.00	0.16
130	688375	国博电子	2,100	219,030.00	0.16
131	688559	海目星	2,600	218,192.00	0.16
132	688778	厦钨新能	4,000	217,600.00	0.16
133	688141	杰华特	1,400	214,900.00	0.16
134	688107	安路科技	4,700	214,320.00	0.16
135	688403	汇成股份	5,200	206,440.00	0.15
136	688275	万润新能	1,600	204,080.00	0.15
137	688515	裕太微	800	199,008.00	0.15
138	688257	新锐股份	1,900	193,610.00	0.14
139	688233	神工股份	900	192,978.00	0.14
140	688234	天岳先进	1,100	190,861.00	0.14
141	688046	药康生物	7,800	188,760.00	0.14
142	688036	传音控股	3,200	188,640.00	0.14
143	688518	联赢激光	6,100	188,490.00	0.14
144	688336	三生国健	3,500	185,850.00	0.14

145	688578	艾力斯	1,700	185,640.00	0.14
146	688222	成都先导	5,700	183,027.00	0.14
147	688308	欧科亿	1,001	181,991.81	0.13
148	688585	上纬新材	1,092	181,053.60	0.13
149	688297	中无人机	4,300	178,665.00	0.13
150	688486	龙迅股份	2,800	178,024.00	0.13
151	688717	艾罗能源	2,100	173,397.00	0.13
152	688223	晶科能源	36,500	173,375.00	0.13
153	688368	晶丰明源	800	173,216.00	0.13
154	688052	纳芯微	600	172,986.00	0.13
155	688300	联瑞新材	700	171,080.00	0.13
156	688102	斯瑞新材	3,600	169,848.00	0.13
157	688291	金橙子	2,900	169,592.00	0.13
158	688231	隆达股份	4,600	168,958.00	0.12
159	688208	道通科技	6,500	163,735.00	0.12
160	688100	威胜信息	5,300	162,127.00	0.12
161	688011	新光光电	2,300	160,701.00	0.12
162	688213	思特威	1,500	160,605.00	0.12
163	688248	南网科技	2,300	159,114.00	0.12
164	688411	海博思创	544	158,412.80	0.12
165	688628	优利德	1,600	158,304.00	0.12
166	688678	福立旺	6,500	157,105.00	0.12
167	688322	奥比中光	1,200	156,660.00	0.12
168	688655	迅捷兴	2,900	155,324.00	0.11
169	688047	龙芯中科	1,000	154,670.00	0.11
170	688063	派能科技	2,900	154,483.00	0.11
171	688433	华曙高科	1,800	154,080.00	0.11
172	688775	影石创新	1,100	152,515.00	0.11
173	688187	时代电气	2,200	151,052.00	0.11
174	688150	莱特光电	2,200	150,964.00	0.11
175	688009	中国通号	31,500	149,940.00	0.11

176	688472	阿特斯	13,800	149,316.00	0.11
177	688151	华强科技	9,900	147,213.00	0.11
178	688293	奥浦迈	3,500	145,915.00	0.11
179	688112	鼎阳科技	1,900	139,574.00	0.10
180	688359	三孚新科	700	138,908.00	0.10
181	688538	和辉光电	53,400	138,840.00	0.10
182	688502	茂莱光学	200	138,720.00	0.10
183	688522	纳睿雷达	6,800	136,136.00	0.10
184	688303	大全能源	7,800	135,954.00	0.10
185	688728	格科微	6,400	134,656.00	0.10
186	688636	智明达	3,700	134,051.00	0.10
187	688295	中复神鹰	2,200	133,188.00	0.10
188	688677	海泰新光	1,300	131,469.00	0.10
189	688698	伟创电气	2,500	131,125.00	0.10
190	688001	华兴源创	1,500	128,550.00	0.10
191	688577	浙海德曼	2,800	128,324.00	0.09
192	688235	百济神州	500	127,305.00	0.09
193	688220	翱捷科技	1,000	124,320.00	0.09
194	688432	有研硅	3,100	123,907.00	0.09
195	688609	九联科技	11,200	123,312.00	0.09
196	688545	兴福电子	900	119,754.00	0.09
197	688103	国力电子	1,600	119,056.00	0.09
198	688226	威腾电气	2,700	115,641.00	0.09
199	688097	博众精工	1,800	113,490.00	0.08
200	688593	新相微	2,800	108,976.00	0.08
201	688255	凯尔达	3,900	108,420.00	0.08
202	688268	华特气体	400	107,000.00	0.08
203	688315	诺禾致源	8,500	106,335.00	0.08
204	688362	甬矽电子	1,100	106,040.00	0.08
205	688259	创耀科技	2,600	101,712.00	0.08
206	688686	奥普特	600	101,034.00	0.07

207	688122	西部超导	1,600	100,496.00	0.07
208	688373	盟科药业	22,100	100,113.00	0.07
209	688652	京仪装备	500	100,085.00	0.07
210	688318	财富趋势	1,400	99,834.00	0.07
211	688788	科思科技	2,200	98,956.00	0.07
212	688683	莱尔科技	2,600	98,592.00	0.07
213	688137	近岸蛋白	2,700	97,200.00	0.07
214	688656	浩欧博	1,000	96,770.00	0.07
215	688435	英方软件	3,000	96,000.00	0.07
216	688420	美腾科技	4,500	94,815.00	0.07
217	688676	金盘科技	1,100	93,104.00	0.07
218	688205	德科立	443	92,228.17	0.07
219	688648	中邮科技	2,500	91,375.00	0.07
220	688617	惠泰医疗	500	90,780.00	0.07
221	688114	华大智造	1,774	90,615.92	0.07
222	688615	合合信息	800	90,480.00	0.07
223	688385	复旦微电	1,260	89,825.40	0.07
224	688003	天准科技	701	89,237.30	0.07
225	688281	华秦科技	1,775	89,158.25	0.07
226	688236	春立医疗	6,150	88,929.00	0.07
227	688260	昀冢科技	600	86,400.00	0.06
228	688065	凯赛生物	1,800	86,130.00	0.06
229	688269	凯立新材	2,700	85,617.00	0.06
230	688123	聚辰股份	400	85,040.00	0.06
231	688608	恒玄科技	500	83,595.00	0.06
232	688605	先锋精科	800	83,216.00	0.06
233	688568	中科星图	2,000	82,940.00	0.06
234	688599	天合光能	5,800	81,896.00	0.06
235	688125	安达智能	500	81,750.00	0.06
236	688507	索辰科技	300	80,904.00	0.06
237	688202	美迪西	1,000	80,710.00	0.06

238	688512	慧智微	5,000	79,850.00	0.06
239	688733	壹石通	1,900	78,565.00	0.06
240	688028	沃尔德	500	77,935.00	0.06
241	688195	腾景科技	400	77,032.00	0.06
242	688685	迈信林	1,400	76,860.00	0.06
243	688800	瑞可达	800	76,776.00	0.06
244	688552	航天南湖	2,700	75,951.00	0.06
245	688603	天承科技	354	73,614.30	0.05
246	688035	德邦科技	800	73,440.00	0.05
247	688523	航天环宇	1,400	73,360.00	0.05
248	688190	云路股份	800	72,568.00	0.05
249	688708	佳驰科技	1,400	71,120.00	0.05
250	688088	虹软科技	2,000	71,100.00	0.05
251	688143	长盈通	400	70,352.00	0.05
252	688352	颀中科技	2,900	70,122.00	0.05
253	688448	磁谷科技	1,100	69,916.00	0.05
254	688237	超卓航科	1,300	69,446.00	0.05
255	688319	欧林生物	1,517	66,717.66	0.05
256	688757	胜科纳米	1,000	66,700.00	0.05
257	688662	富信科技	390	65,520.00	0.05
258	688582	芯动联科	1,000	65,000.00	0.05
259	688180	君实生物	1,889	63,885.98	0.05
260	688661	和林微纳	398	63,274.04	0.05
261	688332	中科蓝讯	400	63,000.00	0.05
262	688386	泛亚微透	692	62,169.28	0.05
263	688484	南芯科技	1,100	62,139.00	0.05
264	688333	铂力特	599	61,337.60	0.05
265	688584	上海合晶	1,700	61,115.00	0.05
266	688709	成都华微	1,600	60,944.00	0.05
267	688653	康希通信	3,500	60,830.00	0.04
268	688349	三一重能	4,000	60,720.00	0.04

269	688218	江苏北人	1,100	60,456.00	0.04
270	688020	方邦股份	242	60,403.20	0.04
271	688410	山外山	4,200	60,312.00	0.04
272	688583	思看科技	700	60,039.00	0.04
273	688365	光云科技	3,800	59,926.00	0.04
274	688138	清溢光电	1,264	59,408.00	0.04
275	688032	禾迈股份	700	59,164.00	0.04
276	688353	华盛锂电	500	58,035.00	0.04
277	688401	路维光电	600	57,588.00	0.04
278	688169	石头科技	600	56,982.00	0.04
279	688479	友车科技	1,500	56,955.00	0.04
280	688513	苑东生物	1,288	56,620.48	0.04
281	688383	新益昌	300	56,412.00	0.04
282	688563	航材股份	1,100	56,353.00	0.04
283	688596	正帆科技	700	55,342.00	0.04
284	688772	珠海冠宇	2,800	54,964.00	0.04
285	688153	唯捷创芯	1,700	54,604.00	0.04
286	688278	特宝生物	1,000	54,400.00	0.04
287	688697	纽威数控	4,000	54,360.00	0.04
288	688625	呈和科技	640	54,022.40	0.04
289	688106	金宏气体	1,300	53,924.00	0.04
290	688819	天能股份	2,400	53,280.00	0.04
291	688425	铁建重工	13,200	53,064.00	0.04
292	688580	伟思医疗	994	52,950.38	0.04
293	688726	拉普拉斯	1,000	52,850.00	0.04
294	688610	埃科光电	200	52,680.00	0.04
295	688475	萤石网络	1,916	52,402.60	0.04
296	688006	杭可科技	1,431	52,303.05	0.04
297	688798	艾为电子	700	51,324.00	0.04
298	688306	均普智能	5,000	50,500.00	0.04
299	688206	概伦电子	1,100	48,807.00	0.04

300	688530	欧莱新材	500	48,450.00	0.04
301	688350	富淼科技	1,400	48,342.00	0.04
302	688062	迈威生物	1,700	48,025.00	0.04
303	688192	迪哲医药	1,200	47,916.00	0.04
304	688055	龙腾光电	8,300	47,808.00	0.04
305	688131	皓元医药	500	47,300.00	0.03
306	688526	科前生物	3,900	47,190.00	0.03
307	688179	阿拉丁	1,700	47,107.00	0.03
308	688691	灿芯股份	400	46,372.00	0.03
309	688550	瑞联新材	800	46,280.00	0.03
310	688031	星环科技	400	46,072.00	0.03
311	688363	华熙生物	1,288	46,071.76	0.03
312	688516	奥特维	800	45,912.00	0.03
313	688252	天德钰	1,900	45,600.00	0.03
314	688156	路德科技	1,500	45,375.00	0.03
315	688633	星球石墨	1,500	44,595.00	0.03
316	688191	智洋创新	1,243	44,375.10	0.03
317	688520	神州细胞	1,288	44,062.48	0.03
318	688366	昊海生科	1,500	43,305.00	0.03
319	688418	震有科技	900	43,272.00	0.03
320	688029	南微医学	600	43,080.00	0.03
321	688351	微电生理	1,900	43,054.00	0.03
322	688225	亚信安全	3,400	42,228.00	0.03
323	688312	燕麦科技	500	41,995.00	0.03
324	688456	有研粉材	300	41,880.00	0.03
325	688095	福昕软件	701	41,660.43	0.03
326	688786	悦安新材	900	41,472.00	0.03
327	688398	赛特新材	1,596	41,352.36	0.03
328	688607	康众医疗	800	40,800.00	0.03
329	688561	奇安信	1,700	40,766.00	0.03
330	688158	优刻得	1,100	40,436.00	0.03

331	688198	佰仁医疗	450	40,158.00	0.03
332	688428	诺诚健华	1,400	39,858.00	0.03
333	688084	晶品特装	789	39,670.92	0.03
334	688443	智翔金泰	1,700	39,525.00	0.03
335	688267	中触媒	2,000	39,400.00	0.03
336	688305	科德数控	600	39,162.00	0.03
337	688325	赛微微电	300	39,123.00	0.03
338	688779	五矿新能	4,800	38,928.00	0.03
339	688166	博瑞医药	1,100	38,511.00	0.03
340	688508	芯朋微	400	37,184.00	0.03
341	688168	安博通	538	36,987.50	0.03
342	688170	德龙激光	383	36,771.83	0.03
343	688253	英诺特	600	36,168.00	0.03
344	688261	东微半导	343	35,990.99	0.03
345	688239	航宇科技	600	35,898.00	0.03
346	688799	华纳药厂	800	35,896.00	0.03
347	688611	杭州柯林	500	35,725.00	0.03
348	688016	心脉医疗	400	35,456.00	0.03
349	688478	晶升股份	400	35,420.00	0.03
350	688539	高华科技	1,100	35,068.00	0.03
351	688276	百克生物	2,500	34,850.00	0.03
352	688262	国芯科技	800	34,584.00	0.03
353	688116	天奈科技	900	34,380.00	0.03
354	688010	福光股份	701	34,089.63	0.03
355	688090	瑞松科技	320	34,064.00	0.03
356	688314	康拓医疗	1,000	33,880.00	0.03
357	688160	步科股份	300	32,631.00	0.02
358	688327	云从科技	2,600	32,396.00	0.02
359	688083	中望软件	500	32,375.00	0.02
360	688155	先惠技术	400	32,356.00	0.02
361	688381	帝奥微	600	32,100.00	0.02

362	688485	九州一轨	500	32,030.00	0.02
363	688567	孚能科技	3,000	31,500.00	0.02
364	688419	耐科装备	400	31,460.00	0.02
365	688230	芯导科技	399	31,445.19	0.02
366	688371	菲沃泰	800	31,192.00	0.02
367	688658	悦康药业	2,400	30,864.00	0.02
368	688227	品高股份	300	30,807.00	0.02
369	688079	美迪凯	1,000	30,750.00	0.02
370	688337	普源精电	403	30,196.79	0.02
371	688176	亚虹医药	3,000	29,760.00	0.02
372	688612	威迈斯	1,000	29,590.00	0.02
373	688488	艾迪药业	2,300	29,555.00	0.02
374	688135	利扬芯片	700	29,456.00	0.02
375	688321	微芯生物	1,100	28,963.00	0.02
376	688328	深科达	300	28,710.00	0.02
377	688660	电气风电	3,300	28,446.00	0.02
378	688510	航亚科技	1,187	28,345.56	0.02
379	688299	长阳科技	1,690	28,239.90	0.02
380	688326	经纬恒润	396	28,068.48	0.02
381	688165	埃夫特	1,374	28,029.60	0.02
382	688556	高测股份	2,100	27,888.00	0.02
383	688439	振华风光	600	27,720.00	0.02
384	688618	三旺通信	900	27,693.00	0.02
385	688551	科威尔	390	27,405.30	0.02
386	688787	海天瑞声	200	26,890.00	0.02
387	688710	益诺思	400	26,880.00	0.02
388	688667	菱电电控	200	26,730.00	0.02
389	688663	新风光	300	26,538.00	0.02
390	688085	三友医疗	2,200	26,334.00	0.02
391	688499	利元亨	500	26,275.00	0.02
392	688068	热景生物	300	25,980.00	0.02

393	688689	银河微电	400	25,888.00	0.02
394	688768	容知日新	500	25,770.00	0.02
395	688679	通源环境	600	25,254.00	0.02
396	688379	华光新材	300	25,209.00	0.02
397	688382	益方生物	1,400	25,200.00	0.02
398	688598	金博股份	500	24,725.00	0.02
399	688699	明微电子	300	24,585.00	0.02
400	688339	亿华通	1,300	24,310.00	0.02
401	688601	力芯微	400	24,220.00	0.02
402	688128	中国电研	1,000	23,740.00	0.02
403	688543	国科军工	600	23,670.00	0.02
404	688721	龙图光罩	400	23,352.00	0.02
405	688590	新致软件	1,860	23,119.80	0.02
406	688586	江航装备	1,956	22,865.64	0.02
407	688711	宏微科技	500	22,725.00	0.02
408	688109	品茗科技	300	22,710.00	0.02
409	688500	慧辰股份	500	22,665.00	0.02
410	688105	诺唯赞	1,300	22,555.00	0.02
411	688720	艾森股份	220	22,220.00	0.02
412	688093	世华科技	600	22,140.00	0.02
413	688626	翔宇医疗	500	22,130.00	0.02
414	688758	赛分科技	1,000	22,010.00	0.02
415	688621	阳光诺和	400	21,964.00	0.02
416	688595	芯海科技	500	21,930.00	0.02
417	688050	爱博医疗	599	21,833.55	0.02
418	688789	宏华数科	400	21,268.00	0.02
419	688139	海尔生物	800	21,136.00	0.02
420	688161	威高骨科	1,000	20,980.00	0.02
421	688631	莱斯信息	447	20,968.77	0.02
422	688323	瑞华泰	369	20,848.50	0.02
423	688693	锆威特	200	20,790.00	0.02

424	688591	泰凌微	600	20,628.00	0.02
425	688185	康希诺	400	20,396.00	0.02
426	688091	上海谊众	500	20,100.00	0.01
427	688623	双元科技	200	20,092.00	0.01
428	688087	英科再生	600	20,052.00	0.01
429	688750	金天钛业	1,200	19,956.00	0.01
430	688290	景业智能	300	19,908.00	0.01
431	688061	灿瑞科技	400	19,868.00	0.01
432	688665	四方光电	300	19,710.00	0.01
433	688739	成大生物	1,000	19,490.00	0.01
434	688289	圣湘生物	1,346	19,382.40	0.01
435	688173	希荻微	1,000	19,140.00	0.01
436	688219	会通股份	1,462	18,918.28	0.01
437	688277	天智航	1,100	18,810.00	0.01
438	688049	炬芯科技	400	18,764.00	0.01
439	688108	赛诺医疗	1,000	18,530.00	0.01
440	688181	八亿时空	295	18,467.00	0.01
441	688776	国光电气	300	18,402.00	0.01
442	688309	恒誉环保	300	18,264.00	0.01
443	688707	振华新材	1,374	17,655.90	0.01
444	688307	中润光学	220	17,589.00	0.01
445	688282	理工导航	300	17,460.00	0.01
446	688345	博力威	300	17,424.00	0.01
447	688348	昱能科技	500	17,390.00	0.01
448	688199	久日新材	500	17,265.00	0.01
449	688330	宏力达	500	16,915.00	0.01
450	688369	致远互联	800	16,808.00	0.01
451	688216	气派科技	400	16,804.00	0.01
452	688197	首药控股	500	16,705.00	0.01
453	688458	美芯晟	400	16,704.00	0.01
454	688767	博拓生物	500	16,255.00	0.01

455	688073	毕得医药	300	16,146.00	0.01
456	688210	统联精密	398	16,122.98	0.01
457	688408	中信博	500	16,075.00	0.01
458	688553	汇宇制药	1,500	15,945.00	0.01
459	688570	天玛智控	1,100	15,653.00	0.01
460	688581	安杰思	300	15,513.00	0.01
461	688228	开普云	200	15,468.00	0.01
462	688356	键凯科技	200	15,416.00	0.01
463	688566	吉贝尔	600	15,354.00	0.01
464	688562	航天软件	1,000	15,060.00	0.01
465	688177	百奥泰	895	15,053.90	0.01
466	688163	赛伦生物	300	14,643.00	0.01
467	688007	光峰科技	1,100	14,630.00	0.01
468	688334	西高院	800	14,512.00	0.01
469	688196	卓越新能	400	14,360.00	0.01
470	688232	新点软件	800	14,224.00	0.01
471	688620	安凯微	851	13,786.20	0.01
472	688211	中科微至	400	13,768.00	0.01
473	688399	硕世生物	300	13,617.00	0.01
474	688117	圣诺生物	500	13,515.00	0.01
475	688069	德林海	360	13,449.60	0.01
476	688450	光格科技	200	13,398.00	0.01
477	688119	中钢洛耐	2,800	13,300.00	0.01
478	688283	坤恒顺维	400	13,244.00	0.01
479	688101	三达膜	800	13,224.00	0.01
480	688171	纬德信息	300	13,188.00	0.01
481	688311	盟升电子	500	13,095.00	0.01
482	688056	莱伯泰科	200	12,910.00	0.01
483	688696	极米科技	200	12,908.00	0.01
484	688680	海优新材	300	12,600.00	0.01
485	688716	中研股份	400	12,572.00	0.01

486	688505	复旦张江	1,700	12,546.00	0.01
487	688320	禾川科技	302	12,517.90	0.01
488	688081	兴图新科	300	12,264.00	0.01
489	688377	迪威尔	520	12,261.60	0.01
490	688207	格灵深瞳	600	12,060.00	0.01
491	688335	复洁科技	500	12,020.00	0.01
492	688682	霍莱沃	300	11,670.00	0.01
493	688589	力合微	500	11,490.00	0.01
494	688130	晶华微	400	11,248.00	0.01
495	688039	当虹科技	300	11,196.00	0.01
496	688391	钜泉科技	312	11,191.44	0.01
497	688148	芳源股份	1,300	11,154.00	0.01
498	688023	安恒信息	300	11,016.00	0.01
499	688071	华依科技	300	10,932.00	0.01
500	688316	青云科技	200	10,800.00	0.01
501	688057	金达莱	700	10,787.00	0.01
502	688298	东方生物	600	10,716.00	0.01
503	688671	碧兴物联	300	10,671.00	0.01
504	688133	泰坦科技	500	10,565.00	0.01
505	688302	海创药业	300	10,551.00	0.01
506	688602	康鹏科技	1,300	10,244.00	0.01
507	688429	时创能源	1,000	10,190.00	0.01
508	688755	汉邦科技	367	10,114.52	0.01
509	688178	万德斯	298	10,075.38	0.01
510	688367	工大高科	300	9,990.00	0.01
511	688389	普门科技	1,000	9,790.00	0.01
512	688619	罗普特	600	9,738.00	0.01
513	688639	华恒生物	600	9,684.00	0.01
514	688030	山石网科	600	9,474.00	0.01
515	688096	京源环保	700	9,352.00	0.01
516	688292	浩瀚深度	500	9,300.00	0.01

517	688317	之江生物	600	9,120.00	0.01
518	688489	三未信安	392	8,898.40	0.01
519	688272	富吉瑞	200	8,880.00	0.01
520	688338	赛科希德	300	8,853.00	0.01
521	688098	申联生物	1,000	8,590.00	0.01
522	688238	和元生物	1,573	8,525.66	0.01
523	688246	嘉和美康	400	8,220.00	0.01
524	688509	正元地信	1,900	8,132.00	0.01
525	688175	高凌信息	320	8,048.00	0.01
526	688576	西山科技	200	7,970.00	0.01
527	688737	中自科技	400	7,656.00	0.01
528	688579	地纬智能	1,000	7,590.00	0.01
529	688013	天臣医疗	300	7,401.00	0.01
530	688426	康为世纪	400	7,336.00	0.01
531	688657	浩辰软件	200	7,154.00	0.01
532	688244	永信至诚	500	7,130.00	0.01
533	688560	明冠新材	600	7,110.00	0.01
534	688670	金迪克	400	6,776.00	0.01
535	688038	中科通达	400	6,728.00	0.00
536	688060	云涌科技	200	6,578.00	0.00
537	688132	邦彦技术	500	6,575.00	0.00
538	688651	盛邦安全	200	6,444.00	0.00
539	688638	誉辰智能	200	6,234.00	0.00
540	688616	西力科技	600	6,060.00	0.00
541	688118	普元信息	300	6,036.00	0.00
542	688468	科美诊断	1,000	5,690.00	0.00
543	688613	奥精医疗	400	5,644.00	0.00
544	688695	中创股份	300	5,610.00	0.00
545	688004	博汇科技	300	5,460.00	0.00
546	688393	安必平	300	5,334.00	0.00
547	688573	信宇人	300	5,316.00	0.00

548	688659	元琛科技	500	5,220.00	0.00
549	688565	力源科技	500	4,725.00	0.00
550	688051	佳华科技	200	4,596.00	0.00
551	688528	秦川物联	500	4,570.00	0.00
552	688058	宝兰德	200	4,184.00	0.00
553	688217	睿昂基因	200	4,132.00	0.00
554	688067	爱威科技	200	4,030.00	0.00
555	688021	奥福科技	200	3,872.00	0.00
556	688296	和达科技	300	3,432.00	0.00
557	688701	卓锦股份	400	3,012.00	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	300130	新国都	38,000	799,520.00	0.59
2	300502	新易盛	600	364,200.00	0.27
3	300223	北京君正	900	224,010.00	0.17
4	300475	香农芯创	700	210,000.00	0.16
5	688808	联讯仪器	116	183,782.28	0.14
6	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.12
7	300750	宁德时代	400	157,204.00	0.12
8	300672	国科微	500	147,500.00	0.11
9	300613	富瀚微	1,800	144,144.00	0.11
10	300661	圣邦股份	1,000	143,480.00	0.11
11	301308	江波龙	200	140,760.00	0.10
12	300759	康龙化成	4,700	135,971.00	0.10
13	301127	武汉天源	5,700	118,104.00	0.09
14	300438	鹏辉能源	1,400	115,990.00	0.09
15	300772	运达股份	8,000	98,400.00	0.07

16	300014	亿纬锂能	1,500	97,545.00	0.07
17	300033	同花顺	400	96,400.00	0.07
18	688820	盛合晶微	670	94,798.30	0.07
19	300395	菲利华	700	93,611.00	0.07
20	300489	光智科技	300	93,585.00	0.07
21	300999	金龙鱼	3,600	83,736.00	0.06
22	300814	中富电路	400	81,800.00	0.06
23	301626	苏州天脉	200	76,792.00	0.06
24	301087	可孚医疗	1,600	76,240.00	0.06
25	300860	锋尚文化	2,900	74,240.00	0.05
26	301289	国缆检测	1,500	70,515.00	0.05
27	300664	鹏鹞环保	15,000	63,600.00	0.05
28	301489	思泉新材	300	49,374.00	0.04
29	300390	天华新能	500	46,755.00	0.03
30	300909	汇创达	800	46,576.00	0.03
31	300558	贝达药业	700	45,549.00	0.03
32	300938	信测标准	900	44,892.00	0.03
33	301280	珠城科技	800	40,456.00	0.03
34	300863	卡倍亿	500	38,315.00	0.03
35	300803	指南针	400	36,668.00	0.03
36	301200	大族数控	100	36,065.00	0.03
37	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.03
38	300604	长川科技	100	34,142.00	0.03
39	301108	洁雅股份	1,400	33,026.00	0.02
40	300928	华安鑫创	1,100	31,768.00	0.02
41	300127	银河磁体	1,100	30,745.00	0.02
42	300590	移为通信	2,100	30,135.00	0.02
43	301234	五洲医疗	900	29,601.00	0.02
44	300073	当升科技	600	28,824.00	0.02
45	301511	德福科技	200	28,770.00	0.02
46	300913	兆龙互连	600	28,746.00	0.02

47	301371	敷尔佳	1,100	28,600.00	0.02
48	300294	博雅生物	1,900	27,056.00	0.02
49	300796	贝斯美	4,200	26,418.00	0.02
50	300413	芒果超媒	1,800	26,334.00	0.02
51	301180	万祥科技	2,100	26,313.00	0.02
52	300919	中伟新材	600	26,250.00	0.02
53	688797	臻宝科技	56	26,245.52	0.02
54	300681	英搏尔	900	25,758.00	0.02
55	688635	长进光子	73	22,497.87	0.02
56	300188	国投智能	2,400	22,440.00	0.02
57	301053	远信工业	600	22,140.00	0.02
58	301285	鸿日达	200	22,066.00	0.02
59	300955	嘉亨家化	600	21,654.00	0.02
60	300918	南山智尚	2,000	21,440.00	0.02
61	300866	安克创新	200	20,900.00	0.02
62	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
63	300124	汇川技术	300	19,899.00	0.01
64	301316	慧博云通	500	19,690.00	0.01
65	300408	三环集团	100	16,690.00	0.01
66	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.01
67	300226	上海钢联	980	15,003.80	0.01
68	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.01
69	301039	中集车辆	1,300	9,165.00	0.01
70	300277	汽轮科技	400	6,016.00	0.00
71	300737	科顺股份	800	5,256.00	0.00
72	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
73	300628	亿联网络	100	3,382.00	0.00
74	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	39,643,839.02	29.30
2	688256	寒武纪	38,473,819.79	28.43
3	688981	中芯国际	28,887,971.13	21.35
4	688525	佰维存储	21,220,215.89	15.68
5	688012	中微公司	20,276,371.08	14.99
6	688008	澜起科技	19,409,829.95	14.35
7	688111	金山办公	16,550,868.05	12.23
8	688795	摩尔线程	15,475,457.38	11.44
9	688521	芯原股份	15,052,337.05	11.12
10	688326	经纬恒润	10,574,155.49	7.81
11	688331	荣昌生物	10,325,438.63	7.63
12	688388	嘉元科技	10,123,449.77	7.48
13	688347	华虹宏力	9,581,226.87	7.08
14	688498	源杰科技	8,835,428.08	6.53
15	688167	炬光科技	8,606,668.13	6.36
16	688378	奥来德	8,390,859.45	6.20
17	688072	拓荆科技	8,365,074.57	6.18
18	688271	联影医疗	7,937,911.39	5.87
19	688059	华锐精密	7,746,837.72	5.73
20	688802	沐曦股份	7,735,973.08	5.72
21	688027	国盾量子	7,482,808.96	5.53
22	688233	神工股份	7,276,006.56	5.38
23	688506	百利天恒	7,242,868.32	5.35
24	688556	高测股份	7,186,134.18	5.31
25	688120	华海清科	6,845,186.25	5.06
26	688048	长光华芯	6,141,831.24	4.54
27	688127	蓝特光学	5,857,966.18	4.33

28	688322	奥比中光	5,841,429.49	4.32
29	688488	艾迪药业	5,772,421.69	4.27
30	688025	杰普特	5,455,882.79	4.03
31	688196	卓越新能	5,426,152.54	4.01
32	688536	思瑞浦	5,356,803.58	3.96
33	688768	容知日新	5,344,485.66	3.95
34	688676	金盘科技	5,128,474.21	3.79
35	688002	睿创微纳	4,995,251.23	3.69
36	688519	南亚新材	4,764,558.17	3.52
37	688668	鼎通科技	4,681,013.22	3.46
38	688398	赛特新材	4,666,456.62	3.45
39	688428	诺诚健华	4,600,625.27	3.40
40	688029	南微医学	4,566,705.16	3.38
41	688082	盛美上海	4,444,635.52	3.28
42	688550	瑞联新材	4,282,184.27	3.16
43	688089	嘉必优	4,244,499.07	3.14
44	688717	艾罗能源	4,208,114.41	3.11
45	688778	厦钨新能	4,101,813.46	3.03
46	688557	兰剑智能	4,049,204.74	2.99
47	688597	煜邦电力	3,949,485.32	2.92
48	688629	华丰科技	3,923,483.40	2.90
49	688548	广钢气体	3,868,442.60	2.86
50	688321	微芯生物	3,838,700.39	2.84
51	688036	传音控股	3,832,035.79	2.83
52	688722	同益中	3,812,283.53	2.82
53	688396	华润微	3,754,965.71	2.78
54	688383	新益昌	3,724,817.87	2.75
55	688092	爱科科技	3,599,723.62	2.66
56	688281	华秦科技	3,592,972.64	2.66
57	688188	柏楚电子	3,530,314.85	2.61
58	300750	宁德时代	3,528,668.00	2.61

59	688080	映翰通	3,497,671.09	2.58
60	688045	必易微	3,455,649.13	2.55
61	688392	骄成超声	3,388,987.44	2.50
62	688183	生益电子	3,320,385.15	2.45
63	688122	西部超导	3,317,740.98	2.45
64	688221	前沿生物	3,314,788.10	2.45
65	688372	伟测科技	3,271,175.54	2.42
66	688361	中科飞测	3,256,371.27	2.41
67	688333	铂力特	3,239,329.35	2.39
68	688385	复旦微电	3,233,449.57	2.39
69	688448	磁谷科技	3,228,975.95	2.39
70	688469	芯联集成	3,227,768.67	2.39
71	688533	上声电子	3,198,818.65	2.36
72	688661	和林微纳	3,159,709.46	2.34
73	688411	海博思创	3,146,897.04	2.33
74	688123	聚辰股份	3,138,156.79	2.32
75	688375	国博电子	3,099,066.77	2.29
76	688019	安集科技	3,074,699.03	2.27
77	688208	道通科技	3,073,458.75	2.27
78	688350	富淼科技	3,053,873.29	2.26
79	688239	航宇科技	3,046,635.28	2.25
80	688702	盛科通信	2,985,459.29	2.21
81	688203	海正生材	2,982,575.81	2.20
82	688301	奕瑞科技	2,962,206.99	2.19
83	688362	甬矽电子	2,959,985.00	2.19
84	688126	沪硅产业	2,948,955.95	2.18
85	688401	路维光电	2,943,618.82	2.18
86	688630	芯碁微装	2,917,689.64	2.16
87	688772	珠海冠宇	2,899,872.24	2.14
88	688248	南网科技	2,875,825.60	2.13
89	688258	卓易信息	2,850,727.63	2.11

90	688313	仕佳光子	2,845,867.20	2.10
91	688257	新锐股份	2,817,831.71	2.08
92	688273	麦澜德	2,812,637.65	2.08
93	688049	炬芯科技	2,806,934.14	2.07
94	688300	联瑞新材	2,788,132.92	2.06
95	688633	星球石墨	2,781,364.61	2.06
96	688358	祥生医疗	2,779,012.25	2.05
97	688255	凯尔达	2,758,796.15	2.04
98	688571	杭华股份	2,719,248.45	2.01
99	688129	东来技术	2,716,664.59	2.01
100	688681	科汇股份	2,711,731.27	2.00

注：本项"买入金额"按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	42,072,364.34	31.09
2	688041	海光信息	38,241,551.48	28.26
3	688981	中芯国际	25,802,413.30	19.07
4	688525	佰维存储	23,631,584.52	17.47
5	688008	澜起科技	20,982,525.70	15.51
6	688012	中微公司	18,881,096.25	13.95
7	688521	芯原股份	15,672,975.32	11.58
8	688111	金山办公	14,391,183.79	10.64
9	688795	摩尔线程	14,088,352.42	10.41
10	688498	源杰科技	11,840,923.84	8.75
11	688388	嘉元科技	10,792,369.38	7.98
12	688167	炬光科技	10,786,202.45	7.97
13	688331	荣昌生物	10,466,817.61	7.74

14	688326	经纬恒润	9,644,686.84	7.13
15	688347	华虹宏力	9,613,410.83	7.10
16	688059	华锐精密	9,058,362.73	6.69
17	688072	拓荆科技	8,502,056.28	6.28
18	688378	奥来德	8,497,931.26	6.28
19	688048	长光华芯	8,331,903.16	6.16
20	688025	杰普特	7,869,322.66	5.82
21	688027	国盾量子	7,067,903.37	5.22
22	688127	蓝特光学	7,029,349.49	5.20
23	688271	联影医疗	6,972,904.86	5.15
24	688519	南亚新材	6,894,984.98	5.10
25	688556	高测股份	6,811,252.97	5.03
26	688802	沐曦股份	6,800,646.14	5.03
27	688506	百利天恒	6,751,863.85	4.99
28	688668	鼎通科技	6,732,053.41	4.98
29	688233	神工股份	6,397,676.95	4.73
30	688120	华海清科	6,076,654.72	4.49
31	688488	艾迪药业	5,895,645.86	4.36
32	688196	卓越新能	5,560,464.24	4.11
33	688322	奥比中光	5,493,991.12	4.06
34	688536	思瑞浦	5,381,845.56	3.98
35	688398	赛特新材	5,356,124.22	3.96
36	688002	睿创微纳	5,229,984.93	3.87
37	688768	容知日新	5,082,171.73	3.76
38	688383	新益昌	4,948,411.58	3.66
39	688428	诺诚健华	4,718,626.70	3.49
40	688676	金盘科技	4,677,995.55	3.46
41	688029	南微医学	4,204,381.88	3.11
42	688548	广钢气体	4,166,096.85	3.08
43	688629	华丰科技	4,091,129.86	3.02
44	688045	必易微	3,985,079.37	2.95

45	688550	瑞联新材	3,921,240.14	2.90
46	688702	盛科通信	3,830,350.79	2.83
47	688448	磁谷科技	3,756,697.18	2.78
48	688089	嘉必优	3,655,138.66	2.70
49	688778	厦钨新能	3,650,750.38	2.70
50	688392	骄成超声	3,619,614.33	2.68
51	688321	微芯生物	3,590,122.94	2.65
52	688300	联瑞新材	3,546,903.46	2.62
53	688717	艾罗能源	3,545,959.69	2.62
54	300750	宁德时代	3,535,892.00	2.61
55	688350	富淼科技	3,379,434.19	2.50
56	688597	煜邦电力	3,313,701.79	2.45
57	688036	传音控股	3,308,595.80	2.45
58	688308	欧科亿	3,261,379.06	2.41
59	688372	伟测科技	3,254,553.87	2.41
60	688722	同益中	3,251,735.27	2.40
61	688677	海泰新光	3,202,943.06	2.37
62	688092	爱科科技	3,187,088.16	2.36
63	688557	兰剑智能	3,133,815.62	2.32
64	688333	铂力特	3,130,886.00	2.31
65	688082	盛美上海	3,118,910.16	2.31
66	688183	生益电子	3,104,581.61	2.29
67	688200	华峰测控	3,091,186.29	2.28
68	688188	柏楚电子	3,083,526.89	2.28
69	688313	仕佳光子	3,045,758.78	2.25
70	688469	芯联集成	3,033,773.99	2.24
71	688633	星球石墨	2,995,446.00	2.21
72	688661	和林微纳	2,984,582.03	2.21
73	688630	芯碁微装	2,923,543.02	2.16
74	688411	海博思创	2,911,387.23	2.15
75	688257	新锐股份	2,908,108.98	2.15

76	688239	航宇科技	2,899,928.94	2.14
77	688301	奕瑞科技	2,878,105.29	2.13
78	688375	国博电子	2,868,066.97	2.12
79	688080	映翰通	2,859,839.05	2.11
80	688281	华秦科技	2,857,854.14	2.11
81	688396	华润微	2,837,586.00	2.10
82	688019	安集科技	2,813,235.43	2.08
83	688401	路维光电	2,811,029.49	2.08
84	688122	西部超导	2,786,490.17	2.06
85	688286	敏芯股份	2,766,429.93	2.04
86	688248	南网科技	2,752,448.32	2.03
87	688123	聚辰股份	2,745,010.47	2.03
88	688273	麦澜德	2,744,792.10	2.03
89	688777	中控技术	2,729,041.97	2.02
90	688208	道通科技	2,728,205.51	2.02
91	688545	兴福电子	2,721,124.79	2.01
92	688129	东来技术	2,719,156.31	2.01
93	688056	莱伯泰科	2,711,978.56	2.00

注：本项"卖出金额"按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,100,956,839.04
卖出股票收入（成交）总额	1,062,004,557.05

注：本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末无国债期货投资。

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未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2
本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	497,848.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	497,848.47
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	688072	拓荆科技	2,828,800.00	2.09	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

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	688808	联讯仪器	183,782.28	0.14	科创板打新限售

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
人保 上证 科创	517	174,488.06	49,999,277.78	55.4 3%	40,211,049.57	44.57%

板综合指数增强A						
人保上证科创板综合指数增强C	264	22,732.21	0.00	0.00%	6,001,303.16	100.00%
合计	758	126,928.27	49,999,277.78	51.97%	46,212,352.73	48.03%

注：1、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）。

2、若同一持有人同时持有多个类别基金份额，将会合并计算，所以会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末无管理人的从业人员持有本基金。

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

	合计	0
--	----	---

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	人保上证科创板综合指数增强A	人保上证科创板综合指数增强C
基金合同生效日(2026年01月20日)基金份额总额	440,258,842.04	23,567,286.07
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	58,574,313.08	12,615,279.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	408,622,827.77	30,181,262.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	90,210,327.35	6,001,303.16

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

2026年3月28日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，新任公司公募基金事业部副总经理王小虎、公司公募基金事业部副总经理靳戈、公司公募基金事业部总经理助理及公募基金财务负责人沈静、公司公募基金首席信息官朱佑翰。

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	3	1,948,854,628.52	90.12%	380,787.25	90.13%	-
招商证券	2	213,732,154.00	9.88%	41,712.88	9.87%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1)基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；
- (2)公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；
- (3)研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；
- (4)运营结算能力：具备公募基金券商结算的运营经验，运营系统完备，运营团队满足要求；
- (5)信息技术能力：信息系统接入规范，满足系统兼容性、安全与稳定性要求，具备较好的服务能力。

2、基金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确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-16
2	人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
3	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-28
4	人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-24

	额投资业务公告		
5	中国人保资产管理有限公司 基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-28
6	中国人保资产管理有限公司 旗下公募基金通过证券公司 证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-31
7	中国人保资产管理有限公司 关于调整旗下部分基金风险 评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-17
8	公司旗下基金2026年1季度 报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
9	人保上证科创板综合指数增 强型证券投资基金2026年第 1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
10	中国人保资产管理有限公司 关于调整旗下部分基金最低 赎回份额和最低持有限额的 公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-06
11	2025年度公募基金管理人以 股东身份（通过公募基金持 股）参与股东大会投票信息 披露	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-08
12	关于暂停网上交易系统服务 的通知	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

机构	1	20260507 - 20260630	-	49,999,277.78	-	49,999,277.78	51.97%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。 当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

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、中国证监会准予人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

基金托管人地址：中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址: fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司
二〇二六年八月二十九日