

兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:兴银基金管理有限责任公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
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
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50

7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	兴银上证科创板综合价格 ETF
场内简称	科综价格(扩位证券简称:科创综指 ETF 兴银)
基金主代码	589580
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 05 月 27 日
基金管理人	兴银基金管理有限责任公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,354,822.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 06 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人可根据基金运作及指数情况决定本基金采用抽样复制投资策略或完全复制投资策略，并在招募说明书中披露所使用的复制方法。 本基金采用抽样复制投资策略时，基金管理人将依托指数投资平台，综合考虑指数成份股构成、代表性、相关性、流动性等因素，构建指数化投资组合，追求投资组合与标的指数的风险收益特征尽可能相近，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 本基金采用完全复制投资策略时，将完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序

	后及时对相关成份股进行调整。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，理论上其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用最优化抽样复制标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

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		兴银基金管理有限责任公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张庄波	韩鑫普
	联系电话	86-21-20296383	0755-82943666
	电子邮箱	zhangzb@hffunds.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		40000-96326	95565
传真		86-21-68630069	0755-82960794
注册地址		福建省泉州市丰泽区滨海街102号厦门银行泉州分行大厦19楼1908	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址		中国上海市浦东新区滨江大道5129号陆家嘴滨江中心N1幢三层、五层	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		200120	518000
法定代表人		易勇	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hffunds.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17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）
本期已实现收益	3,151,757.81
本期利润	7,737,611.68
加权平均基金份额本期利润	0.8523
本期加权平均净值利润率	56.08%
本期基金份额净值增长率	53.83%
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	7,717,076.21
期末可供分配基金份额利润	0.7453
期末基金资产净值	20,891,609.35
期末基金份额净值	2.0176
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	101.76%

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。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），即如果期末未分配利润（报表数，下同）的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	57.34%	2.34%	55.44%	2.36%	1.90%	-0.02%
过去六个月	53.83%	2.20%	53.71%	2.23%	0.12%	-0.03%
过去一年	96.26%	1.91%	104.19%	1.96%	-7.93%	-0.05%
自基金合同生效起至今	101.76%	1.84%	115.89%	1.89%	-14.13%	-0.05%

注：1、本基金成立于 2025 年 5 月 27 日；
2、比较基准：上证科创板综合价格指数收益率×100%。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年05月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2025 年 5 月 27 日生效；
2、比较基准：上证科创板综合价格指数收益率×100%。

3.3 其他指标

注：无。

§ 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

兴银基金管理有限责任公司，注册地为福建省泉州市丰泽区，公司主要办公场所位于上海市浦东新区。本公司经证监会证监许可（2013）1289 号文批准，于 2013 年 10 月 25 日成立。2016 年 9 月 23 日，公司股东同比例增资，公司注册资本由 10,000 万元变更为 14,300 万元。增资后股东出资比例维持不变，华福证券股份有限公司出资比例为 76%，国脉科技股份有限公司出资比例为 24%。2016 年 10 月 24 日，公司法定名称由“华福基金管理有限责任公司”变更为“兴银基金管理有限责任公司”。截至报告期末，本公司共管理基金 72 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

林学晨	本基金的基金经理、公司 指数与量化投资部副总经理（主持工作）	2025- 09-22	-	12 年	硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾任湘财证券研究所金融工程分析师。2015 年 7 月加入兴银基金管理有限责任公司，历任中央交易室衍生品交易员、衍生品业务部投资经理助理、投资经理；现任指数与量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
李浩	本基金的基金经理	2026- 01-28	-	8 年	历任国盛证券有限责任公司研究所助理金融工程研究员、上海珠池资产管理有限公司量化研究员、上海驰泰资产管理有限公司量化研究员、西藏东财基金管理有限公司资深量化研究员，现任指数与量化投资部基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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》等有关法律法规的规定，基金合同、招募说明书等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定，严格执行公司公平交易管理制度，加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析，确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人制定了异常交易监控管理的制度，并根据法律法规及监管规定结合实践予以修订完善。本报告期内，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

2026 年上半年，科技成长板块成为 A 股市场较为突出的结构性主线之一，科创综指整体呈现前期震荡、随后走强的运行节奏。年初，外部环境变化、市场风险偏好波动及交易结构调整仍对指数形成一定扰动，板块主要以震荡整固为主；进入二季度后，随着产业催化逐步增多、科技企业基本面预期改善以及资金风险偏好回升，板块上行动能明显增强。市场资金进一步向景气趋势较为明确、技术壁垒较高且业绩兑现能力较强的硬科技领域集中，科创综指也较好地体现了科技成长资产的整体弹性。

从行情结构看，人工智能带来的算力需求扩张仍是贯穿上半年的重要产业线索，并逐步向半导体设备、先进封装、存储芯片、电子材料、CPO 及光通信等多个环节延伸。与此同时，存储行业供需格局改善、国产半导体产业链持续取得突破，也为相关方向提供了较强支撑。伴随上市公司年报和一季报陆续披露，部分光通信、高端设备及半导体材料企业在订单、营收及盈利表现方面出现改善，市场对科技板块的定价逻辑进一步由产业预期向景气验证和业绩兑现转变。尽管期间仍受到海外市场波动、阶段性获利了结及细分方向轮动等因素影响，但科技产业景气向上的核心逻辑依然清晰。

政策层面，科创板制度建设持续深化，服务硬科技企业发展的资本市场环境进一步完善。科创板“1+6”改革实施以来，科创成长层、第五套上市标准、IPO 预先审阅机制，以及并购重组、再融资和股权激励等配套安排不断细化，对处于研发投入期、产业化初期或商业模式验证阶段的科技企业形成更加多元的支持。人工智能大模型企业适用科创板第五套上市标准的审核规则进一步明确，为通用大模型和行业大模型企业申报上市提供了更清晰的制度路径。同时，量子科技、生物制造、具身智能等未来产业的支持机制持续完善，科创板服务科技创新、新质生产力和产业升级的定位进一步强化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴银上证科创板综合价格 ETF 基金份额净值为 2.0176 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 53.83%，同期业绩比较基准收益率为 53.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，人工智能基础设施建设、半导体国产替代、高端制造升级以及未来产业培育，仍有望为科创板提供中长期产业支撑。经过上半年的持续上涨，部分细分行业的估值水平和交易热度所处位置相对较高，市场对业绩兑现能力、订单持续性和技术突破质量的要求也将随之提高。下半年板块机会预计更多围绕财报业绩、资本开支、产品放量及产业景气扩散展开，细分行业之间的分化可能进一步加大。整体来看，科技成长方向仍具备较强的产业基础和政策支持，拥有核心技术壁

垒、真实订单支撑和持续盈利改善能力的细分领域，有望获得中长期资金关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，成立估值小组，明确参与估值流程各方的人员分工和职责。估值小组组长由分管基金事务部的公司领导担任，成员由基金事务部、合规与风险管理部、研究发展部、权益投资部/固定收益部（视会议议题内容选择相关投资方向部门）部门负责人组成。估值小组成员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力。估值小组严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值小组依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算，提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值小组。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值小组审议，同时按流程对外公布。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

本报告期本基金没有应分配但尚未分配的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日；根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

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	87,164.20	58,202.61
结算备付金		340,296.97	636,703.95
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	20,632,438.82	13,074,249.66
其中：股票投资		20,632,438.82	13,074,249.66
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		21,059,899.99	13,769,156.22
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		-	-
应付管理人报酬		2,237.82	1,692.28
应付托管费		745.92	564.11
应付销售服务费		-	-
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	165,306.90	186,000.00
负债合计		168,290.64	188,256.39
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	10,354,822.00	10,354,822.00
未分配利润	6.4.7.8	10,536,787.35	3,226,077.83
净资产合计		20,891,609.35	13,580,899.83
负债和净资产总计		21,059,899.99	13,769,156.22

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.0176 元，基金份额总额 10,354,822.00 份。

6.2 利润表

会计主体：兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		7,766,080.98	3,728,647.59
1. 利息收入		784.90	355,514.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	784.90	80,606.76
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		-	274,907.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,177,668.50	1,427,579.22
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,146,526.57	1,085,049.09
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	31,141.93	342,530.13
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	4,585,853.87	1,939,147.74
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	1,773.71	6,406.21
减：二、营业总支出		28,469.30	97,450.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,194.67	50,643.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,398.24	16,881.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.18	14,876.39	29,925.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,737,611.68	3,631,196.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,737,611.68	3,631,196.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,737,611.68	3,631,196.65

6.3 净资产变动表

会计主体：兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金

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	10,354,822.00	3,226,077.83	13,580,899.83
二、本期期初净资产	10,354,822.00	3,226,077.83	13,580,899.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	7,310,709.52	7,310,709.52
（一）、综合收益总额	-	7,737,611.68	7,737,611.68
（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）	-	-426,902.16	-426,902.16
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	12,998,621.73	36,998,621.73
2. 基金赎回款	-24,000,000.00	-13,425,523.89	-37,425,523.89
（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	10,354,822.00	10,536,787.35	20,891,609.35
项 目	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	518,354,822.00	-	518,354,822.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-440,000,000.00	2,193,933.47	-437,806,066.53
（一）、综合收益总额	-	3,631,196.65	3,631,196.65
（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）	-440,000,000.00	-1,437,263.18	-441,437,263.18
其中：1. 基金申购款	4,000,000.00	-50,541.25	3,949,458.75
2. 基金赎回款	-444,000,000.00	-1,386,721.93	-445,386,721.93
（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	78,354,822.00	2,193,933.47	80,548,755.47

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：

易勇	刘钊	崔可
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

兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可〔2025〕216 号文准予注册，本基金首次募集有效认购资金人民币 513,039,000.00 元，有效认购股票市值人民币 5,315,822.00 元，共计人民币 518,354,822.00 元。《兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 5 月 27 日正式生效。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴银基金管理有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《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》相关规定以及《兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、科创板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权等）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。本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通证券出借等相关业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证科创板综合价格指数收益率。

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》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业

协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	87,164.20
等于：本金	87,131.41
加：应计利息	32.79
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	87,164.20

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	15,249,409.93	-	20,632,438.82	5,383,028.89
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	15,249,409.93	-	20,632,438.82	5,383,028.89

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产、负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	164,876.39
其他应付	430.51
合计	165,306.90

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,354,822.00	10,354,822.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-24,000,000.00	-24,000,000.00
本期末	10,354,822.00	10,354,822.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,743,176.82	-517,098.99	3,226,077.83
本期期初	3,743,176.82	-517,098.99	3,226,077.83
本期利润	3,151,757.81	4,585,853.87	7,737,611.68
本期基金份额交易产生的变动数	822,141.58	-1,249,043.74	-426,902.16
其中：基金申购款	14,648,924.50	-1,650,302.77	12,998,621.73
基金赎回款	-13,826,782.92	401,259.03	-13,425,523.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,717,076.21	2,819,711.14	10,536,787.35

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	628.20
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	156.70
其他	—
合计	784.90

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	110,111.64
股票投资收益——赎回差价收入	3,036,414.93
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	3,146,526.57

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	2,988,279.65
减：卖出股票成本总额	2,873,269.75
减：交易费用	4,898.26
买卖股票差价收入	110,111.64

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	37,425,523.89
减：现金支付赎回款总额	3,293,289.89
减：赎回股票成本总额	31,095,819.07
减：交易费用	—
赎回差价收入	3,036,414.93

6.4.7.11 债券投资收益

注：本基金在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

注：本基金在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

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	31,141.93
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	31,141.93

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,585,853.87
——股票投资	4,585,853.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,585,853.87

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
ETF 基金替代损益	1,773.71
合计	1,773.71

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出成本)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.18 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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	14,876.39

6.4.7.19 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。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期末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
兴银基金管理有限责任公司（以下简称“兴银基金”）	基金管理人
华福证券股份有限公司（以下简称“华福证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商

“招商证券”)	
上海兴瀚资产管理有限公司(以下简称“兴瀚资管”)	基金管理人的子公司
国脉科技股份有限公司	基金管理人的股东

注：本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同生效日为 2025 年 05 月 27 日。

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		上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同生效 日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华福证券	6,617,981.45	100.00%	643,675,391.55	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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		上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日 （基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华福证券	-	-	3,989,110,000.00	100.00%

注：本基金本报告期末未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

注：本基金本报告期以及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 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
华福证券	3,337.74	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同生效日）至 2025 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
华福证券	294,679.10	100.00%	0.00	0.00%

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	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同 生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	10,194.67	50,643.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,390.08	123.27
应支付基金管理人的净管理费	8,804.59	50,520.55

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同 生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,398.24	16,881.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

注：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

注：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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同 生效日）至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,000,100.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,000,100.00	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	28.97%	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份

		额的比例		额的比例
招商证券	3,936,222.00	38.01%	2,647,822.00	25.57%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 05 月 27 日（基金合同 生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	87,164.20	628.20	1,247,290.80	47,898.77

注：本基金的上述存款由本基金托管人招商证券转存于招商银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末以及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	845.00	500	259,512.81	416,000.00	-
688121	*ST	2026-	未	6.48	2026-	5.18	200	2,379.27	1,296.00	-

	卓然	05-06	如期刊登定期报告		07-07					
688260	昀冢科技	2026-06-26	交易异常波动	144.00	2026-07-01	130.70	200	5,624.00	28,800.00	-

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银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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涉及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。

本基金管理人建立了董事会（下设“合规及风险管理委员会”）、经营管理层（下设“风险控制委员会”）、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有需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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有需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

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有需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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有需按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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，保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上

市或可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金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，保障基金持有人利益。

本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持有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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。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	87,164.20	-	-	-	87,164.20
结算备付金	340,296.97	-	-	-	340,296.97
交易性金融资产	-	-	-	20,632,438.82	20,632,438.82
资产总计	427,461.17	-	-	20,632,438.82	21,059,899.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,237.82	2,237.82
应付托管费	-	-	-	745.92	745.92

其他负债	-	-	-	165,306.90	165,306.90
负债总计	-	-	-	168,290.64	168,290.64
利率敏感度缺口	427,461.17	-	-	20,464,148.18	20,891,609.35
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	58,202.61	-	-	-	58,202.61
结算备付金	636,703.95	-	-	-	636,703.95
交易性金融资产	-	-	-	13,074,249.66	13,074,249.66
资产总计	694,906.56	-	-	13,074,249.66	13,769,156.22
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,692.28	1,692.28
应付托管费	-	-	-	564.11	564.11
其他负债	-	-	-	186,000.00	186,000.00
负债总计	-	-	-	188,256.39	188,256.39
利率敏感度缺口	694,906.56	-	-	12,885,993.27	13,580,899.83

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

注：于 6 月 30 日，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

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

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基

金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金采用完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

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	20,632,438.82	98.76	13,074,249.66	96.27
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	20,632,438.82	98.76	13,074,249.66	96.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	以沪深 300 指数为基准衡量其他价格风险，且其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上涨 5%	1,569,487.64	1,035,468.74
	沪深 300 指数下跌 5%	-1,569,487.64	-1,035,468.74

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	20,186,342.82	12,856,073.66
第二层次	446,096.00	218,176.00
第三层次	-	-
合计	20,632,438.82	13,074,249.66

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	20,632,438.82	97.97
	其中：股票	20,632,438.82	97.97
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	427,461.17	2.03
8	其他各项资产	-	-

9	合计	21,059,899.99	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	16,714,994.72	80.01
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	3,527,440.89	16.88
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	312,422.07	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	77,581.14	0.37
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	20,632,438.82	98.76

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资组合。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	776	1,238,146.80	5.93
2	688041	海光信息	3,100	1,147,930.00	5.49
3	688012	中微公司	1,341	628,258.50	3.01

4	688498	源杰科技	290	546,940.00	2.62
5	688008	澜起科技	1,559	483,134.10	2.31
6	688981	中芯国际	2,755	437,549.10	2.09
7	688072	拓荆科技	500	416,000.00	1.99
8	688082	盛美上海	684	295,488.00	1.41
9	688525	佰维存储	591	292,385.43	1.40
10	688146	中船特气	800	279,992.00	1.34
11	688521	芯原股份	700	259,798.00	1.24
12	688702	盛科通信	600	233,994.00	1.12
13	688120	华海清科	700	225,526.00	1.08
14	688347	华虹宏力	599	201,443.70	0.96
15	688361	中科飞测	451	193,930.00	0.93
16	688037	芯源微	400	175,620.00	0.84
17	688126	沪硅产业	4,400	175,516.00	0.84
18	688396	华润微	1,773	172,956.15	0.83
19	688172	燕东微	1,996	166,985.36	0.80
20	688409	富创精密	524	160,475.00	0.77
21	688249	晶合集成	2,659	156,960.77	0.75
22	688519	南亚新材	411	156,196.44	0.75
23	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.73
24	688506	百利天恒	517	152,013.51	0.73
25	688111	金山办公	697	148,495.85	0.71
26	688183	生益电子	1,100	145,640.00	0.70
27	688795	摩尔线程	200	143,298.00	0.69
28	688627	精智达	200	143,000.00	0.68
29	688110	东芯股份	700	142,590.00	0.68
30	688048	长光华芯	244	122,488.00	0.59
31	688313	仕佳光子	657	121,315.05	0.58
32	688777	中控技术	1,017	119,497.50	0.57
33	688271	联影医疗	1,167	118,135.41	0.57
34	688630	芯碁微装	200	109,878.00	0.53
35	688167	炬光科技	290	102,720.90	0.49
36	688300	联瑞新材	418	102,159.20	0.49
37	688629	华丰科技	543	101,817.93	0.49
38	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.48
39	688002	睿创微纳	651	100,703.19	0.48
40	688019	安集科技	291	98,782.86	0.47
41	688147	微导纳米	600	97,128.00	0.46
42	688025	杰普特	200	94,000.00	0.45
43	688548	广钢气体	1,800	93,780.00	0.45
44	688234	天岳先进	535	92,827.85	0.44
45	688387	信科移动	4,506	89,399.04	0.43
46	688141	杰华特	565	86,727.50	0.42

47	688036	传音控股	1,468	86,538.60	0.41
48	688775	影石创新	616	85,408.40	0.41
49	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.40
50	688375	国博电子	800	83,440.00	0.40
51	688187	时代电气	1,200	82,392.00	0.39
52	688585	上纬新材	496	82,236.80	0.39
53	688047	龙芯中科	492	76,097.64	0.36
54	688295	中复神鹰	1,252	75,796.08	0.36
55	688728	格科微	3,600	75,744.00	0.36
56	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.36
57	688220	翱捷科技	600	74,592.00	0.36
58	688549	中巨芯	2,000	73,620.00	0.35
59	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.35
60	688432	有研硅	1,800	71,946.00	0.34
61	688301	奕瑞科技	560	69,440.00	0.33
62	688336	三生国健	1,305	69,295.50	0.33
63	688257	新锐股份	640	65,216.00	0.31
64	688322	奥比中光	496	64,752.80	0.31
65	688099	晶晨股份	628	64,621.20	0.31
66	688331	荣昌生物	493	64,218.18	0.31
67	688578	艾力斯	576	62,899.20	0.30
68	688368	晶丰明源	280	60,625.60	0.29
69	688449	联芸科技	700	60,417.00	0.29
70	688001	华兴源创	700	59,990.00	0.29
71	688188	柏楚电子	560	59,752.00	0.29
72	688411	海博思创	200	58,240.00	0.28
73	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.28
74	688385	复旦微电	800	57,032.00	0.27
75	688535	华海诚科	296	55,352.00	0.26
76	688248	南网科技	800	55,344.00	0.26
77	688503	聚和材料	417	55,335.90	0.26
78	688266	泽璟制药	469	54,713.54	0.26
79	688507	索辰科技	200	53,936.00	0.26
80	688195	腾景科技	280	53,922.40	0.26
81	688472	阿特斯	4,970	53,775.40	0.26
82	688268	华特气体	200	53,500.00	0.26
83	688545	兴福电子	400	53,224.00	0.25
84	688065	凯赛生物	1,108	53,017.80	0.25
85	688213	思特威	493	52,785.51	0.25
86	688303	大全能源	3,000	52,290.00	0.25
87	688102	斯瑞新材	1,100	51,898.00	0.25
88	688122	西部超导	822	51,629.82	0.25
89	688433	华曙高科	600	51,360.00	0.25

90	688469	芯联集成	4,800	50,928.00	0.24
91	688235	百济神州	200	50,922.00	0.24
92	688003	天准科技	400	50,920.00	0.24
93	688200	华峰测控	96	50,409.60	0.24
94	688020	方邦股份	200	49,920.00	0.24
95	688515	裕太微	200	49,752.00	0.24
96	688233	神工股份	231	49,531.02	0.24
97	688676	金盘科技	585	49,514.40	0.24
98	688362	甬矽电子	509	49,067.60	0.23
99	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.23
100	688127	蓝特光学	494	48,214.40	0.23
101	688403	汇成股份	1,200	47,640.00	0.23
102	688372	伟测科技	255	47,430.00	0.23
103	688332	中科蓝讯	296	46,620.00	0.22
104	688599	天合光能	3,260	46,031.20	0.22
105	688530	欧莱新材	474	45,930.60	0.22
106	688390	固德威	419	45,465.69	0.22
107	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.22
108	688279	峰昭科技	200	44,888.00	0.21
109	688169	石头科技	471	44,730.87	0.21
110	688388	嘉元科技	1,015	44,660.00	0.21
111	688662	富信科技	260	43,680.00	0.21
112	688123	聚辰股份	200	42,520.00	0.20
113	688652	京仪装备	212	42,436.04	0.20
114	688097	博众精工	672	42,369.60	0.20
115	688205	德科立	200	41,638.00	0.20
116	688605	先锋精科	400	41,608.00	0.20
117	688603	天承科技	200	41,590.00	0.20
118	688568	中科星图	997	41,345.59	0.20
119	688333	铂力特	400	40,960.00	0.20
120	688343	云天励飞	500	40,830.00	0.20
121	688800	瑞可达	420	40,307.40	0.19
122	688297	中无人机	964	40,054.20	0.19
123	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.19
124	688318	财富趋势	560	39,933.60	0.19
125	688359	三孚新科	200	39,688.00	0.19
126	688596	正帆科技	500	39,530.00	0.19
127	688400	凌云光	587	38,859.40	0.19
128	688352	顾中科技	1,600	38,688.00	0.19
129	688131	皓元医药	400	37,840.00	0.18
130	688383	新益昌	200	37,608.00	0.18
131	688416	恒烁股份	260	36,400.00	0.17
132	688308	欧科亿	200	36,362.00	0.17

133	688584	上海合晶	1,000	35,950.00	0.17
134	688018	乐鑫科技	280	35,817.60	0.17
135	688700	东威科技	400	35,760.00	0.17
136	688608	恒玄科技	213	35,611.47	0.17
137	688531	日联科技	200	35,568.00	0.17
138	688143	长盈通	200	35,176.00	0.17
139	688778	厦钨新能	639	34,761.60	0.17
140	688006	杭可科技	942	34,430.10	0.16
141	688150	莱特光电	496	34,035.52	0.16
142	688686	奥普特	200	33,678.00	0.16
143	688349	三一重能	2,210	33,547.80	0.16
144	688757	胜科纳米	500	33,350.00	0.16
145	688180	君实生物	976	33,008.32	0.16
146	688125	安达智能	200	32,700.00	0.16
147	688582	芯动联科	492	31,980.00	0.15
148	688380	中微半导	485	31,966.35	0.15
149	688661	和林微纳	200	31,796.00	0.15
150	688726	拉普拉斯	600	31,710.00	0.15
151	688772	珠海冠宇	1,600	31,408.00	0.15
152	688516	奥特维	544	31,220.16	0.15
153	688028	沃尔德	200	31,174.00	0.15
154	688819	天能股份	1,400	31,080.00	0.15
155	688206	概伦电子	700	31,059.00	0.15
156	688005	容百科技	1,000	30,600.00	0.15
157	688484	南芯科技	541	30,561.09	0.15
158	688708	佳驰科技	600	30,480.00	0.15
159	688709	成都华微	800	30,472.00	0.15
160	688106	金宏气体	730	30,280.40	0.14
161	688475	萤石网络	1,100	30,085.00	0.14
162	688337	普源精电	400	29,972.00	0.14
163	688563	航材股份	577	29,559.71	0.14
164	688798	艾为电子	400	29,328.00	0.14
165	688425	铁建重工	7,207	28,972.14	0.14
166	688260	昀冢科技	200	28,800.00	0.14
167	688720	艾森股份	280	28,280.00	0.14
168	688281	华秦科技	560	28,128.80	0.13
169	688456	有研粉材	200	27,920.00	0.13
170	688090	瑞松科技	260	27,677.00	0.13
171	688278	特宝生物	506	27,526.40	0.13
172	688107	安路科技	600	27,360.00	0.13
173	688593	新相微	700	27,244.00	0.13
174	688223	晶科能源	5,700	27,075.00	0.13
175	688787	海天瑞声	200	26,890.00	0.13

176	688114	华大智造	520	26,561.60	0.13
177	688378	奥来德	428	26,536.00	0.13
178	688690	纳微科技	600	26,460.00	0.13
179	688319	欧林生物	600	26,388.00	0.13
180	688401	路维光电	274	26,298.52	0.13
181	688523	航天环宇	500	26,200.00	0.13
182	688325	赛微微电	200	26,082.00	0.12
183	688617	惠泰医疗	143	25,963.08	0.12
184	688363	华熙生物	724	25,897.48	0.12
185	688275	万润新能	200	25,510.00	0.12
186	688055	龙腾光电	4,402	25,355.52	0.12
187	688208	道通科技	1,000	25,190.00	0.12
188	688559	海目星	300	25,176.00	0.12
189	688561	奇安信	1,000	23,980.00	0.11
190	688376	美埃科技	206	23,957.80	0.11
191	688520	神州细胞	700	23,947.00	0.11
192	688258	卓易信息	200	23,708.00	0.11
193	688192	迪哲医药	593	23,678.49	0.11
194	688353	华盛锂电	200	23,214.00	0.11
195	688691	灿芯股份	200	23,186.00	0.11
196	688031	星环科技	200	23,036.00	0.11
197	688009	中国通号	4,800	22,848.00	0.11
198	688381	帝奥微	423	22,630.50	0.11
199	688615	合合信息	200	22,620.00	0.11
200	688307	中润光学	280	22,386.00	0.11
201	688160	步科股份	200	21,754.00	0.10
202	688262	国芯科技	499	21,571.77	0.10
203	688669	聚石化学	200	21,400.00	0.10
204	688779	五矿新能	2,600	21,086.00	0.10
205	688626	翔宇医疗	475	21,023.50	0.10
206	688182	灿勤科技	488	21,018.16	0.10
207	688261	东微半导	200	20,986.00	0.10
208	688116	天奈科技	547	20,895.40	0.10
209	688227	品高股份	200	20,538.00	0.10
210	688677	海泰新光	200	20,226.00	0.10
211	688538	和辉光电	7,700	20,020.00	0.10
212	688191	智洋创新	560	19,992.00	0.10
213	688100	威胜信息	651	19,914.09	0.10
214	688628	优利德	200	19,788.00	0.09
215	688598	金博股份	400	19,780.00	0.09
216	688029	南微医学	274	19,673.20	0.09
217	688656	浩欧博	200	19,354.00	0.09
218	688170	德龙激光	200	19,202.00	0.09

219	688328	深科达	200	19,140.00	0.09
220	688231	隆达股份	520	19,099.60	0.09
221	688543	国科军工	480	18,936.00	0.09
222	688508	芯朋微	200	18,592.00	0.09
223	688166	博瑞医药	530	18,555.30	0.09
224	688439	振华风光	400	18,480.00	0.09
225	688079	美迪凯	600	18,450.00	0.09
226	688158	优刻得	500	18,380.00	0.09
227	688138	清溢光电	387	18,189.00	0.09
228	688190	云路股份	200	18,142.00	0.09
229	688386	泛亚微透	200	17,968.00	0.09
230	688567	孚能科技	1,700	17,850.00	0.09
231	688198	佰仁医疗	200	17,848.00	0.09
232	688486	龙迅股份	280	17,802.40	0.09
233	688016	心脉医疗	200	17,728.00	0.08
234	688478	晶升股份	200	17,710.00	0.08
235	688088	虹软科技	494	17,561.70	0.08
236	688480	赛恩斯	200	17,518.00	0.08
237	688209	英集芯	600	17,448.00	0.08
238	688068	热景生物	200	17,320.00	0.08
239	688306	均普智能	1,700	17,170.00	0.08
240	688153	唯捷创芯	534	17,152.08	0.08
241	688239	航宇科技	283	16,931.89	0.08
242	688032	禾迈股份	200	16,904.00	0.08
243	688625	呈和科技	200	16,882.00	0.08
244	688135	利扬芯片	400	16,832.00	0.08
245	688379	华光新材	200	16,806.00	0.08
246	688312	燕麦科技	200	16,798.00	0.08
247	688733	壹石通	400	16,540.00	0.08
248	688062	迈威生物	585	16,526.25	0.08
249	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.08
250	688699	明微电子	200	16,390.00	0.08
251	688165	埃夫特	800	16,320.00	0.08
252	688155	先惠技术	200	16,178.00	0.08
253	688202	美迪西	200	16,142.00	0.08
254	688091	上海谊众	400	16,080.00	0.08
255	688327	云从科技	1,289	16,060.94	0.08
256	688063	派能科技	300	15,981.00	0.08
257	688222	成都先导	493	15,830.23	0.08
258	688230	芯导科技	200	15,762.00	0.08
259	688698	伟创电气	300	15,735.00	0.08
260	688419	耐科装备	200	15,730.00	0.08
261	688612	威迈斯	528	15,623.52	0.07

262	688371	菲沃泰	400	15,596.00	0.07
263	688660	电气风电	1,800	15,516.00	0.07
264	688719	爱科赛博	200	15,400.00	0.07
265	688103	国力电子	200	14,882.00	0.07
266	688112	鼎阳科技	201	14,765.46	0.07
267	688083	中望软件	228	14,763.00	0.07
268	688093	世华科技	400	14,760.00	0.07
269	688556	高测股份	1,100	14,608.00	0.07
270	688050	爱博医疗	400	14,580.00	0.07
271	688046	药康生物	600	14,520.00	0.07
272	688252	天德钰	600	14,400.00	0.07
273	688382	益方生物	800	14,400.00	0.07
274	688128	中国电研	602	14,291.48	0.07
275	688611	杭州柯林	200	14,290.00	0.07
276	688428	诺诚健华	500	14,235.00	0.07
277	688326	经纬恒润	200	14,176.00	0.07
278	688323	瑞华泰	248	14,012.00	0.07
279	688011	新光光电	200	13,974.00	0.07
280	688443	智翔金泰	600	13,950.00	0.07
281	688591	泰凌微	400	13,752.00	0.07
282	688711	宏微科技	300	13,635.00	0.07
283	688351	微电生理	600	13,596.00	0.07
284	688518	联赢激光	439	13,565.10	0.06
285	688105	诺唯赞	780	13,533.00	0.06
286	688221	前沿生物	600	13,440.00	0.06
287	688290	景业智能	200	13,272.00	0.06
288	688321	微芯生物	504	13,270.32	0.06
289	688758	赛分科技	600	13,206.00	0.06
290	688665	四方光电	200	13,140.00	0.06
291	688418	震有科技	272	13,077.76	0.06
292	688305	科德数控	200	13,054.00	0.06
293	688689	银河微电	200	12,944.00	0.06
294	688408	中信博	400	12,860.00	0.06
295	688577	浙海德曼	280	12,832.40	0.06
296	688485	九州一轨	200	12,812.00	0.06
297	688522	纳睿雷达	633	12,672.66	0.06
298	688788	科思科技	280	12,594.40	0.06
299	688161	威高骨科	600	12,588.00	0.06
300	688181	八亿时空	200	12,520.00	0.06
301	688139	海尔生物	473	12,496.66	0.06
302	688586	江航装备	1,067	12,473.23	0.06
303	688776	国光电气	200	12,268.00	0.06
304	688601	力芯微	200	12,110.00	0.06

305	688678	福立旺	500	12,085.00	0.06
306	688253	英诺特	200	12,056.00	0.06
307	688721	龙图光罩	205	11,967.90	0.06
308	688697	纽威数控	877	11,918.43	0.06
309	688095	福昕软件	200	11,886.00	0.06
310	688510	航亚科技	494	11,796.72	0.06
311	688226	威腾电气	275	11,778.25	0.06
312	688291	金橙子	200	11,696.00	0.06
313	688739	成大生物	600	11,694.00	0.06
314	688512	慧智微	729	11,642.13	0.06
315	688750	金天钛业	700	11,641.00	0.06
316	688282	理工导航	200	11,640.00	0.06
317	688345	博力威	200	11,616.00	0.06
318	688550	瑞联新材	200	11,570.00	0.06
319	688289	圣湘生物	800	11,520.00	0.06
320	688173	希荻微	600	11,484.00	0.05
321	688049	炬芯科技	241	11,305.31	0.05
322	688552	航天南湖	400	11,252.00	0.05
323	688108	赛诺医疗	600	11,118.00	0.05
324	688179	阿拉丁	400	11,084.00	0.05
325	688218	江苏北人	200	10,992.00	0.05
326	688621	阳光诺和	200	10,982.00	0.05
327	688685	迈信林	200	10,980.00	0.05
328	688073	毕得医药	200	10,764.00	0.05
329	688655	迅捷兴	200	10,712.00	0.05
330	688580	伟思医疗	200	10,654.00	0.05
331	688789	宏华数科	200	10,634.00	0.05
332	688499	利元亨	200	10,510.00	0.05
333	688069	德林海	280	10,460.80	0.05
334	688653	康希通信	600	10,428.00	0.05
335	688219	会通股份	800	10,352.00	0.05
336	688768	容知日新	200	10,308.00	0.05
337	688707	振华新材	800	10,280.00	0.05
338	688607	康众医疗	200	10,200.00	0.05
339	688185	康希诺	200	10,198.00	0.05
340	688177	百奥泰	600	10,092.00	0.05
341	688277	天智航	585	10,003.50	0.05
342	688061	灿瑞科技	200	9,934.00	0.05
343	688010	福光股份	203	9,871.89	0.05
344	688334	西高院	539	9,777.46	0.05
345	688163	赛伦生物	200	9,762.00	0.05
346	688620	安凯微	600	9,720.00	0.05
347	688101	三达膜	578	9,554.34	0.05

348	688553	汇宇制药	888	9,439.44	0.05
349	688631	莱斯信息	200	9,382.00	0.04
350	688035	德邦科技	100	9,180.00	0.04
351	688399	硕世生物	200	9,078.00	0.04
352	688087	英科再生	271	9,056.82	0.04
353	688562	航天软件	600	9,036.00	0.04
354	688799	华纳药厂	200	8,974.00	0.04
355	688663	新风光	100	8,846.00	0.04
356	688207	格灵深瞳	440	8,844.00	0.04
357	688609	九联科技	800	8,808.00	0.04
358	688171	纬德信息	200	8,792.00	0.04
359	688513	苑东生物	200	8,792.00	0.04
360	688232	新点软件	490	8,712.20	0.04
361	688526	科前生物	706	8,542.60	0.04
362	688570	天玛智控	600	8,538.00	0.04
363	688679	通源环境	200	8,418.00	0.04
364	688216	气派科技	200	8,402.00	0.04
365	688680	海优新材	200	8,400.00	0.04
366	688276	百克生物	600	8,364.00	0.04
367	688458	美芯晟	200	8,352.00	0.04
368	688293	奥浦迈	200	8,338.00	0.04
369	688320	禾川科技	200	8,290.00	0.04
370	688136	科兴制药	400	8,284.00	0.04
371	688210	统联精密	202	8,183.02	0.04
372	688479	友车科技	213	8,087.61	0.04
373	688360	德马科技	451	8,072.90	0.04
374	688366	昊海生科	278	8,025.86	0.04
375	688311	盟升电子	306	8,014.14	0.04
376	688377	迪威尔	337	7,946.46	0.04
377	688176	亚虹医药	800	7,936.00	0.04
378	688365	光云科技	500	7,885.00	0.04
379	688410	山外山	549	7,883.64	0.04
380	688259	创耀科技	200	7,824.00	0.04
381	688007	光峰科技	585	7,780.50	0.04
382	688682	霍莱沃	200	7,780.00	0.04
383	688273	麦澜德	200	7,748.00	0.04
384	688085	三友医疗	646	7,732.62	0.04
385	688636	智明达	213	7,716.99	0.04
386	688658	悦康药业	600	7,716.00	0.04
387	688119	中钢洛耐	1,600	7,600.00	0.04
388	688683	莱尔科技	200	7,584.00	0.04
389	688117	圣诺生物	280	7,568.40	0.04
390	688237	超卓航科	141	7,532.22	0.04

391	688315	诺禾致源	600	7,506.00	0.04
392	688070	纵横股份	200	7,466.00	0.04
393	688225	亚信安全	600	7,452.00	0.04
394	688505	复旦张江	1,000	7,380.00	0.04
395	688566	吉贝尔	287	7,344.33	0.04
396	688023	安恒信息	200	7,344.00	0.04
397	688648	中邮科技	200	7,310.00	0.03
398	688057	金达莱	474	7,304.34	0.03
399	688071	华依科技	200	7,288.00	0.03
400	688196	卓越新能	200	7,180.00	0.03
401	688298	东方生物	400	7,144.00	0.03
402	688236	春立医疗	493	7,128.78	0.03
403	688671	碧兴物联	200	7,114.00	0.03
404	688302	海创药业	200	7,034.00	0.03
405	688575	亚辉龙	800	7,008.00	0.03
406	688039	当虹科技	187	6,978.84	0.03
407	688348	昱能科技	200	6,956.00	0.03
408	688600	皖仪科技	209	6,955.52	0.03
409	688211	中科微至	201	6,918.42	0.03
410	688199	久日新材	200	6,906.00	0.03
411	688350	富淼科技	200	6,906.00	0.03
412	688148	芳源股份	791	6,786.78	0.03
413	688178	万德斯	200	6,762.00	0.03
414	688488	艾迪药业	524	6,733.40	0.03
415	688710	益诺思	100	6,720.00	0.03
416	688489	三未信安	296	6,719.20	0.03
417	688299	长阳科技	400	6,684.00	0.03
418	688197	首药控股	200	6,682.00	0.03
419	688367	工大高科	200	6,660.00	0.03
420	688283	坤恒顺维	200	6,622.00	0.03
421	688558	国盛智科	200	6,572.00	0.03
422	688175	高凌信息	260	6,539.00	0.03
423	688767	博拓生物	200	6,502.00	0.03
424	688186	广大特材	428	6,484.20	0.03
425	688569	铁科轨道	400	6,460.00	0.03
426	688269	凯立新材	202	6,405.42	0.03
427	688435	英方软件	200	6,400.00	0.03
428	688539	高华科技	200	6,376.00	0.03
429	688595	芯海科技	145	6,359.70	0.03
430	688267	中触媒	321	6,323.70	0.03
431	688602	康鹏科技	800	6,304.00	0.03
432	688716	中研股份	200	6,286.00	0.03
433	688557	兰剑智能	200	6,206.00	0.03

434	688330	宏力达	182	6,157.06	0.03
435	688618	三旺通信	200	6,154.00	0.03
436	688015	交控科技	400	6,152.00	0.03
437	688358	祥生医疗	200	6,114.00	0.03
438	688429	时创能源	600	6,114.00	0.03
439	688722	同益中	400	6,068.00	0.03
440	688156	路德科技	200	6,050.00	0.03
441	688075	安旭生物	200	5,952.00	0.03
442	688151	华强科技	400	5,948.00	0.03
443	688633	星球石墨	200	5,946.00	0.03
444	688338	赛科希德	200	5,902.00	0.03
445	688357	建龙微纳	200	5,894.00	0.03
446	688212	澳华内镜	200	5,880.00	0.03
447	688389	普门科技	600	5,874.00	0.03
448	688459	哈铁科技	700	5,831.00	0.03
449	688589	力合微	253	5,813.94	0.03
450	688130	晶华微	200	5,624.00	0.03
451	688255	凯尔达	200	5,560.00	0.03
452	688786	悦安新材	120	5,529.60	0.03
453	688588	凌志软件	594	5,399.46	0.03
454	688096	京源环保	400	5,344.00	0.03
455	688339	亿华通	285	5,329.50	0.03
456	688077	大地熊	200	5,298.00	0.03
457	688157	松井股份	200	5,278.00	0.03
458	688571	杭华股份	600	5,250.00	0.03
459	688129	东来技术	200	5,238.00	0.03
460	688398	赛特新材	200	5,182.00	0.02
461	688098	申联生物	600	5,154.00	0.02
462	688247	宣泰医药	680	5,113.60	0.02
463	688590	新致软件	400	4,972.00	0.02
464	688639	华恒生物	300	4,842.00	0.02
465	688335	复洁科技	200	4,808.00	0.02
466	688560	明冠新材	400	4,740.00	0.02
467	688162	巨一科技	200	4,728.00	0.02
468	688133	泰坦科技	216	4,564.08	0.02
469	688395	正弦电气	200	4,420.00	0.02
470	688238	和元生物	815	4,417.30	0.02
471	688280	精进电动	800	4,392.00	0.02
472	688285	高铁电气	600	4,302.00	0.02
473	688509	正元地信	1,000	4,280.00	0.02
474	688092	爱科科技	200	4,248.00	0.02
475	688420	美腾科技	200	4,214.00	0.02
476	688370	丛麟科技	200	4,184.00	0.02

477	688533	上声电子	200	4,172.00	0.02
478	688317	之江生物	274	4,164.80	0.02
479	688246	嘉和美康	200	4,110.00	0.02
480	688203	海正生材	400	3,992.00	0.02
481	688030	山石网科	250	3,947.50	0.02
482	688355	明志科技	200	3,850.00	0.02
483	688501	青达环保	200	3,840.00	0.02
484	688737	中自科技	200	3,828.00	0.02
485	688597	煜邦电力	580	3,770.00	0.02
486	688373	盟科药业	828	3,750.84	0.02
487	688695	中创股份	200	3,740.00	0.02
488	688455	科捷智能	200	3,732.00	0.02
489	688579	地纬智能	491	3,726.69	0.02
490	688292	浩瀚深度	200	3,720.00	0.02
491	688426	康为世纪	200	3,668.00	0.02
492	688393	安必平	200	3,556.00	0.02
493	688288	鸿泉技术	200	3,554.00	0.02
494	688573	信宇人	200	3,544.00	0.02
495	688517	金冠电气	200	3,496.00	0.02
496	688310	迈得医疗	223	3,427.51	0.02
497	688468	科美诊断	600	3,414.00	0.02
498	688670	金迪克	200	3,388.00	0.02
499	688529	豪森智能	215	3,381.95	0.02
500	688038	中科通达	200	3,364.00	0.02
501	688687	凯因科技	200	3,262.00	0.02
502	688619	罗普特	200	3,246.00	0.02
503	688793	倍轻松	200	3,222.00	0.02
504	688718	唯赛勃	200	3,194.00	0.02
505	688244	永信至诚	200	2,852.00	0.01
506	688613	奥精医疗	200	2,822.00	0.01
507	688681	科汇股份	200	2,796.00	0.01
508	688132	邦彦技术	200	2,630.00	0.01
509	688466	金科环境	200	2,566.00	0.01
510	688565	力源科技	262	2,475.90	0.01
511	688089	嘉必优	224	2,376.64	0.01
512	688296	和达科技	200	2,288.00	0.01
513	688659	元琛科技	200	2,088.00	0.01
514	688616	西力科技	200	2,020.00	0.01
515	688528	秦川物联	200	1,828.00	0.01
516	688026	洁特生物	100	1,571.00	0.01
517	688701	卓锦股份	200	1,506.00	0.01
518	688121	*ST 卓然	200	1,296.00	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资组合。

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	688498	源杰科技	180,986.00	1.33
2	688795	摩尔线程	144,000.00	1.06
3	688027	国盾量子	128,970.00	0.95
4	688183	生益电子	69,916.00	0.51
5	688012	中微公司	68,384.00	0.50
6	688167	炬光科技	65,654.00	0.48
7	688469	芯联集成	57,206.78	0.42
8	688200	华峰测控	53,904.00	0.40
9	688125	安达智能	53,876.00	0.40
10	688111	金山办公	53,598.00	0.39
11	688041	海光信息	48,038.00	0.35
12	688627	精智达	47,194.00	0.35
13	688195	腾景科技	46,198.00	0.34
14	688235	百济神州	46,168.00	0.34
15	688411	海博思创	45,598.00	0.34
16	688025	杰普特	44,892.00	0.33
17	688031	星环科技	44,776.00	0.33
18	688223	晶科能源	43,873.65	0.32
19	688702	盛科通信	42,382.00	0.31
20	688630	芯碁微装	37,456.00	0.28

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	161,452.32	1.19
2	688223	晶科能源	104,466.12	0.77
3	688469	芯联集成	84,555.62	0.62
4	688617	惠泰医疗	72,927.00	0.54
5	688009	中国通号	69,342.68	0.51
6	688270	ST 臻镭	62,000.00	0.46
7	688506	百利天恒	51,766.00	0.38

8	688411	海博思创	51,590.00	0.38
9	688019	安集科技	47,910.00	0.35
10	688525	佰维存储	47,452.00	0.35
11	688538	和辉光电	47,070.32	0.35
12	688521	芯原股份	43,144.00	0.32
13	688017	绿的谐波	39,042.00	0.29
14	688608	恒玄科技	35,872.00	0.26
15	688120	华海清科	34,436.00	0.25
16	688205	德科立	33,760.00	0.25
17	688361	中科飞测	33,556.00	0.25
18	688048	长光华芯	32,506.00	0.24
19	688052	纳芯微	32,488.00	0.24
20	688981	中芯国际	31,659.00	0.23

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,629,701.80
卖出股票收入（成交）总额	2,988,279.65

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内未进行国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

无

7.12.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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	416,000.00	1.99	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资组合。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的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

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
367	28,214.77	7,894,422.00	76.24%	2,460,400.00	23.76%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金管理人所有从业人员期末未持有本基金。

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

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	10,354,822.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	24,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	10,354,822.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会，大会表决投票时间自 2026 年 3 月 25 日起至 2026 年 4 月 23 日 17:00 止（以基金管理人收到表决票的时间为准），审议《关于持续运作兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金有关事项的议案》。

根据计票结果，出具表决意见的基金份额持有人所持有的本基金基金份额总数小于在权益登记

日本基金基金份额总数的二分之一，故未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

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) 2026 年 5 月 15 日，张庄波担任基金管理人督察长，吴真子不再担任基金管理人督察长。

(2) 2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

(3) 2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内无改聘情况。

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

注：报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.7 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	
华福证券	6	6,617,981.45	100.00%	3,337.74	100.00%	—

注：基金租用证券公司交易单元的选择标准是：

（一）财务状况良好，经审计的最近一年年报中资产、经营情况需满足下列条件之一：

- 1、总资产 100 亿元以上；
- 2、净资产 20 亿元以上；
- 3、营业收入 10 亿元以上；
- 4、净资本 20 亿元以上。

（二）经营行为规范、合规风控能力较强，近三年内无重大违法违规记录。

（三）研究团队具备丰富的产业研究经验与资源，能够为基金业务提供较高质量的研究服务。

（四）交易系统完善，交易链路安全、稳健、性能高，可为多种类型机构提供交易服务，能及时响应交易系统需求。

选择程序是：研究与创新投资部对拟选择参与证券交易的证券公司开展尽职调查，对其财务状况、经营行为、合规风控、研究服务、交易服务等进行评估，并出具证券公司参与证券交易准入评估报告，经研究与创新部负责人、交易部、合规与风险管理部审核，督察长、总经理审批后，交由交易部办理协议签署等事宜。

本报告期内本基金租用证券公司交易单元变更情况如下：无。

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

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定报刊和网站	2026-01-22
2	兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定报刊和网站	2026-01-29
3	关于兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金调整基金份额参考净值（IOPV）相关事项的公告	证监会规定报刊和网站	2026-02-09
4	兴银基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定报刊和网站	2026-03-21
5	兴银基金管理有限责任公司关于以通讯方式	证监会规定报刊和	2026-03-23

	召开兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	网站	
6	兴银基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026-03-24
7	兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定报刊和网站	2026-03-31
8	兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会规定报刊和网站	2026-04-22
9	兴银基金管理有限责任公司关于兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026-04-28
10	兴银基金管理有限责任公司关于督察长变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026-05-16
11	兴银基金管理有限责任公司关于兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金溢价风险提示公告	证监会规定报刊和网站	2026-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260313~20260630	—	3,000,100.00	—	3,000,100.00	28.97%
	2	20260101~20260104; 20260106~20260106; 20260115~20260323; 20260325~20260415; 20260417~20260426; 20260428~20260428;	2,647,822.00	21,546,300.00	20,257,900.00	3,936,222.00	38.01%

		20260508~20260510; 20260513~20260630					
	3	20260427~20260427	1,673,800.00	8,352,200.00	9,070,700.00	955,300.00	9.23%
个人	1	20260225~20260225	-	20,533,100.00	20,533,100.00	-	-
	2	20260506~20260507	-	6,078,500.00	5,782,700.00	295,800.00	2.86%
	3	20260610~20260610	-	4,080,800.00	4,080,800.00	-	-
产品特有风险							
(1) 赎回申请延缓支付的风险 上述高占比投资者大额赎回时易构成本基金巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付的风险。 (2) 基金净值大幅波动的风险 上述高占比投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。 (3) 基金规模过小导致的风险 上述高占比投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。							

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. 中国证监会准予基金募集注册的文件
2. 《兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
4. 《兴银上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告
7. 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（40000-96326）咨询本基金管理人。

兴银基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日