

招商上证科创板综合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：招商基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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及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责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 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	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	57
10.8 其他重大事件	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商上证科创板综合 ETF
场内简称	科创全指（扩位证券简称：科创综指 ETF 招商）
基金主代码	589770
交易代码	589770
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 26 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	168,569,166.00 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 3 月 5 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。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。
投资策略	本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现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。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份券被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的成份券时，基金管理人将通过投资成份券、备选成份券、非成份券、成份券衍生品等进行替代，运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。 本基金其他主要投资策略包括：债券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、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
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		招商基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	许俊
	联系电话	0755 - 83196666	010-66596688
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-887-9555	95566
传真		0755 - 83196475	010-66594942
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518040	100818
法定代表人		王颖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

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 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	46,754,688.48
本期利润	139,655,994.25
加权平均基金份额本期利润	0.6934
本期加权平均净值利润率	45.92%
本期基金份额净值增长率	54.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	106,783,682.73
期末可供分配基金份额利润	0.6335
期末基金资产净值	342,157,812.95
期末基金份额净值	2.0298

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	102.98%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用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；

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

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	56.32%	2.34%	55.71%	2.36%	0.61%	-0.02%
过去六个月	54.75%	2.21%	53.99%	2.23%	0.76%	-0.02%
过去一年	106.51%	1.95%	104.94%	1.96%	1.57%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	102.98%	1.91%	99.01%	1.94%	3.97%	-0.03%

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：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前, 公司注册资本金为人民币 13.1 亿元, 招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%, 招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
房俊一	本基金 基金经 理	2025 年 2 月 26 日	-	6	男，硕士。2019 年 7 月至 2021 年 4 月在中证指数有限公司工作，任研究开发部研究员；2021 年 4 月至 2024 年 8 月在华宝基金管理有限公司工作，历任高级分析师、基金经理助理等职位。2024 年 8 月加入招商基金管理有限公司指数产品管理事业部，曾任招商中证生物科技主题交易型开放式指数证券投资基金、招商创业板大盘交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300ESG 基准交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金、招商中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、招商沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券

					投资基金、招商中证半导体产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、招商中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金、招商中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、招商深证 100 指数证券投资基金、招商上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商国证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、招商上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同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，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库, 制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度, 明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分, 投资组合经理在授权范围内可以自主决策, 超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放, 在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求, 对连续四个季度期间内、不同时间窗下 (如日内、3 日内、5 日内) 公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析, 相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内, 公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易, 严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易, 基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据, 并留存记录备查, 完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内, 本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行, 公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 15 次, 为旗下指数及量化等组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内, 财政政策与货币政策协同巩固复苏底盘, 国内经济整体保持一定韧性, 但内生增长动力仍待补强。资本市场流动性整体充裕, 板块结构性分化进一步放大, 资金向硬科技主线集中, 传统板块持续承压。聚焦市场各行业表现, 可以看到行业表现分化较大。其中, 电子、通信、建筑材料、机械设备行业涨幅居前。而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料行业表现较为疲软。本基金跟踪的标的指数上证科创板综合指数报告期内上涨 53.99%。关于本基金的运作, 报告期内仓位相对较高, 紧跟指数表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内, 本基金份额净值增长率为 54.75%, 同期业绩基准增长率为 53.99%。

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，经济预计仍将保持韧性增长。展望政策层面，财政政策依然保持积极，货币政策适度宽松，政策重心向提振内需、科技创新倾斜。就投资机会而言，除了关注科技自主可控板块的景气度外，建议关注低估值板块。在做相关投资决策时，建议综合把握政策支持、产业趋势和业绩兑现这三个维度，在科技成长、顺周期修复、高股息防御中寻求结构性机会，同时保持对市场波动抬升的警惕。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，估值委员会成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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约定。

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

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,783,813.48	2,313,291.13
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	340,558,893.11	337,075,068.56
其中：股票投资		340,520,892.30	337,075,068.56
基金投资		-	-
债券投资		38,000.81	-
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
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		342,342,706.59	339,388,359.69
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		37,654.32	41,164.49
应付托管费		12,551.41	13,721.51
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	134,687.91	160,500.00
负债合计		184,893.64	215,386.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	168,569,166.00	258,569,166.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	173,588,646.95	80,603,807.69
净资产合计		342,157,812.95	339,172,973.69
负债和净资产总计		342,342,706.59	339,388,359.69

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0298 元，基金份额总额 168,569,166.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		140,085,001.05	32,400,611.63

1.利息收入		1,765.96	54,431.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,765.96	54,431.34
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）		47,150,448.32	9,617,478.38
其中：股票投资收益	6.4.7.10	46,570,194.11	6,841,743.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	68,422.29	37,150.95
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	511,831.92	2,738,583.56
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	92,901,305.77	22,663,393.83
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	31,481.00	65,308.08
减：二、营业总支出		429,006.80	561,224.60
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	226,362.32	374,251.99
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	75,454.07	124,750.64
3.销售服务费		-	-
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		0.05	0.07
8.其他费用	6.4.7.19	127,190.36	62,221.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		139,655,994.25	31,839,387.03
减：所得税费用		-	-

四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		139,655,994.25	31,839,387.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		139,655,994.25	31,839,387.03

6.3 净资产变动表

会计主体：招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	258,569,166.00	-	80,603,807.69	339,172,973.69
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	258,569,166.00	-	80,603,807.69	339,172,973.69
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-90,000,000.00	-	92,984,839.26	2,984,839.26
(一)、综合收益总额	-	-	139,655,994.25	139,655,994.25
(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)	-90,000,000.00	-	-46,671,154.99	-136,671,154.99
其中：1.基金申购款	50,000,000.00	-	25,887,451.09	75,887,451.09
2.基金赎回款	-140,000,000.00	-	-72,558,606.08	-212,558,606.08
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	168,569,166.00	-	173,588,646.95	342,157,812.95
项目	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30			

	日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,288,569,166.00	-	-	1,288,569,166.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-580,000,000.00	-	-12,142,383.35	-592,142,383.35
（一）、综合收益总额	-	-	31,839,387.03	31,839,387.03
（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）	-580,000,000.00	-	-43,981,770.38	-623,981,770.38
其中：1.基金申购款	1,115,000,000.00	-	-71,343,548.17	1,043,656,451.83
2.基金赎回款	-1,695,000,000.00	-	27,361,777.79	-1,667,638,222.21
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	708,569,166.00	-	-12,142,383.35	696,426,782.65

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：

____钟文岳____ ____欧志明____ ____何剑萍____
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

招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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”）证监许可[2025]128号《关于准予招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予公开募集注册。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。募集期间为2025年2月17日至2025年2月21日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,288,565,000.00元，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(25)第00046号验资报告。《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2025年2月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,288,569,166.00份基金份额，其中认购资金利息折合4,166.00份基金份额。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券（含存托凭证，下同）和备选成份券（含存托凭证，下同）。为更好地实现基金的投资目标，本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份券（包括主板、科创板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份券和备选成份券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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货和股票期权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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]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[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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《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》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(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;取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,继续免征增值税直至债券到期。

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,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。

(5)对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税;自 2023 年 8 月 28 日起,出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,260,077.86
等于: 本金	1,259,983.47
加: 应计利息	94.39
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	523,735.62
等于: 本金	523,725.04
加: 应计利息	10.58
减: 坏账准备	-

合计	1,783,813.48
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		219,313,559.37	-	340,520,892.30	121,207,332.93
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	37,999.87	0.94	38,000.81	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	37,999.87	0.94	38,000.81	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		219,351,559.24	0.94	340,558,893.11	121,207,332.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	126,560.21
其他	8,127.70
合计	134,687.91

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	258,569,166.00	258,569,166.00
本期申购	50,000,000.00	50,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-140,000,000.00	-140,000,000.00
基金份额折算变动份额	-	-
本期末	168,569,166.00	168,569,166.00

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

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	101,982,493.94	-21,378,686.25	80,603,807.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	101,982,493.94	-21,378,686.25	80,603,807.69
本期利润	46,754,688.48	92,901,305.77	139,655,994.25
本期基金份额交易产生的变动数	-41,953,499.69	-4,717,655.30	-46,671,154.99
其中：基金申购款	24,748,224.31	1,139,226.78	25,887,451.09
基金赎回款	-66,701,724.00	-5,856,882.08	-72,558,606.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,783,682.73	66,804,964.22	173,588,646.95

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,498.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	267.08
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,765.96

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,341,306.68
股票投资收益——赎回差价收入	34,228,887.43
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	46,570,194.11

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	43,456,391.90
减：卖出股票成本总额	31,078,325.26
减：交易费用	36,759.96
买卖股票差价收入	12,341,306.68

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	212,558,606.08
减：现金支付赎回款总额	-4,011,216.92
减：赎回股票成本总额	182,340,935.57
减：交易费用	-
赎回差价收入	34,228,887.43

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	68,409.31
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	68,422.29

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	166,428.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	97,999.63
减：应计利息总额	12.90
减：交易费用	6.66
买卖债券差价收入	68,409.31

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	511,831.92
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	511,831.92

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	92,901,305.77
——股票投资	92,901,305.77
——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	92,901,305.77

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	31,481.00
合计	31,481.00

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	7,545.47
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他	60,137.52
合计	127,190.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东
招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“招商上证科创板综合 ETF 联接”)	本基金的联接基金

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	226,362.32	374,251.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	19,314.34	66,794.20
应支付基金管理人的净管理费	207,047.98	307,457.79

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,454.07	124,750.64

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本报告期内及上年度可比期间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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 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额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商上证科创板综合 ETF 联接	116,471,700.00	69.09%	188,413,200.00	72.87%
招商证券股份有限公司	1,628,666.00	0.97%	4,584,466.00	1.77%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	1,260,077.86	1,498.88	5,399,069.61	46,915.24

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位:	总金额

				股/张)	
招商证券	603459	红板科技	网下申购	1,980	35,046.00

上年度可比期间 2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 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 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	332	3,711.76	5,839.88	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	53	1,774.97	1,798.29	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	198	3,504.60	16,695.36	-
688635	长进光子	2026 年	6 个月	新股流通	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-

		5 月 20 日		受限						
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,392	24,387.84	50,000.64	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	102	2,313.36	4,856.22	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	90	8,296.20	41,683.50	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	121	5,391.76	56,709.07	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	75	6,141.00	118,824.75	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	139	7,777.05	7,936.90	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,012	9,583.64	70,981.68	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	434	8,541.12	61,406.66	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 6 月 23 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	170	16,999.96	17,000.26	-
118072	鼎通转债	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	210	20,999.91	21,000.55	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	6,228	1,840,343.23	5,181,696.00	-
688260	昀冢科技	2026 年 6 月 26 日	重大事项停牌	144.00	2026 年 7 月 1 日	132.00	2,794	83,974.44	402,336.00	-
688121	卓然股份	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	5,762	70,881.92	37,337.76	-

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参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，董事会及下设审计委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、监察稽核部门和风险管理部门等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该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交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	38,000.81	-
未评级	-	-
合计	38,000.81	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产分别在证券交易所以及银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子证券的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,783,813.48	-	-	-	1,783,813.48
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	38,000.81	340,520,892.30	340,558,893.11
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,783,813.48	-	38,000.81	340,520,892.30	342,342,706.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	37,654.32	37,654.32
应付托管费	-	-	-	12,551.41	12,551.41
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	134,687.91	134,687.91
负债总计	-	-	-	184,893.64	184,893.64
利率敏感度缺口	1,783,813.48	-	38,000.81	340,335,998.66	342,157,812.95
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	2,313,291.13	-	-	-	2,313,291.13
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	337,075,068.56	337,075,068.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,313,291.13	-	-	337,075,068.56	339,388,359.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	41,164.49	41,164.49
应付托管费	-	-	-	13,721.51	13,721.51
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	160,500.00	160,500.00
负债总计	-	-	-	215,386.00	215,386.00
利率敏感度缺口	2,313,291.13	-	-	336,859,682.56	339,172,973.69

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-1,076.33	-
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	1,113.40	-

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值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。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	340,520,892.30	99.52	337,075,068.56	99.38

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	340,520,892.30	99.52	337,075,068.56	99.38

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2.其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	17,026,044.62	16,853,753.43
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-17,026,044.62	-16,853,753.43

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	334,343,563.67	329,870,342.66
第二层次	5,659,370.57	6,126,109.36
第三层次	555,958.87	1,078,616.54
合计	340,558,893.11	337,075,068.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有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应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，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

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	340,520,892.30	99.47
	其中：股票	340,520,892.30	99.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,000.81	0.01
	其中：债券	38,000.81	0.01
	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	1,783,813.48	0.52
8	其他各项资产	-	-
9	合计	342,342,706.59	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	275,497,776.61	80.52
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	58,427,809.85	17.08
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	4,966,262.11	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	1,010,161.86	0.30
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	339,902,010.43	99.34

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	618,881.87	0.18
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	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	618,881.87	0.18

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	14,068	22,446,197.40	6.56
2	688041	海光信息	51,825	19,190,797.50	5.61
3	688012	中微公司	20,851	9,768,693.50	2.86
4	688008	澜起科技	25,526	7,910,507.40	2.31
5	688795	摩尔线程	10,547	7,556,820.03	2.21
6	688802	沐曦股份	9,012	7,464,639.60	2.18
7	688981	中芯国际	44,539	7,073,683.98	2.07
8	688072	拓荆科技	6,228	5,181,696.00	1.51
9	688525	佰维存储	10,412	5,151,128.76	1.51
10	688498	源杰科技	2,676	5,046,936.00	1.48
11	688082	盛美上海	10,793	4,662,576.00	1.36
12	688521	芯原股份	11,739	4,356,812.46	1.27
13	688146	中船特气	11,795	4,128,132.05	1.21
14	688120	华海清科	11,041	3,557,189.38	1.04
15	688702	盛科通信	9,055	3,531,359.45	1.03
16	688361	中科飞测	7,826	3,365,180.00	0.98
17	688347	华虹宏力	9,002	3,027,372.60	0.88
18	688126	沪硅产业	73,584	2,935,265.76	0.86
19	688396	华润微	29,644	2,891,772.20	0.85
20	688506	百利天恒	9,140	2,687,434.20	0.79
21	688172	燕东微	31,768	2,657,710.88	0.78
22	688249	晶合集成	44,857	2,647,908.71	0.77
23	688766	普冉股份	3,374	2,586,508.40	0.76

24	688183	生益电子	18,464	2,444,633.60	0.71
25	688200	华峰测控	4,537	2,382,378.70	0.70
26	688111	金山办公	10,323	2,199,315.15	0.64
27	688777	中控技术	17,703	2,080,102.50	0.61
28	688409	富创精密	6,790	2,079,437.50	0.61
29	688110	东芯股份	9,946	2,026,000.20	0.59
30	688519	南亚新材	5,233	1,988,749.32	0.58
31	688469	芯联集成	186,882	1,982,818.02	0.58
32	688048	长光华芯	3,922	1,968,844.00	0.58
33	688037	芯源微	4,398	1,930,941.90	0.56
34	688629	华丰科技	10,265	1,924,790.15	0.56
35	688271	联影医疗	18,449	1,867,592.27	0.55
36	688313	仕佳光子	10,009	1,848,161.85	0.54
37	688017	绿的谐波	4,077	1,703,615.22	0.50
38	688019	安集科技	4,976	1,689,152.96	0.49
39	688234	天岳先进	9,591	1,664,134.41	0.49
40	688147	微导纳米	10,268	1,662,183.84	0.49
41	688002	睿创微纳	10,502	1,624,554.38	0.47
42	688630	芯碁微装	2,953	1,622,348.67	0.47
43	688627	精智达	2,175	1,555,125.00	0.45
44	688548	广钢气体	29,408	1,532,156.80	0.45
45	688141	杰华特	9,941	1,525,943.50	0.45
46	688036	传音控股	25,660	1,512,657.00	0.44
47	688387	信科移动	76,140	1,510,617.60	0.44
48	688585	上纬新材	9,069	1,503,640.20	0.44
49	688047	龙芯中科	9,019	1,394,968.73	0.41
50	688375	国博电子	13,179	1,374,569.70	0.40
51	688187	时代电气	19,453	1,335,642.98	0.39
52	688300	联瑞新材	5,459	1,334,179.60	0.39
53	688775	影石创新	9,536	1,322,166.40	0.39
54	688728	格科微	57,892	1,218,047.68	0.36
55	688295	中复神鹰	20,116	1,217,822.64	0.36
56	688549	中巨芯	32,875	1,210,128.75	0.35
57	688411	海博思创	4,106	1,195,667.20	0.35
58	688322	奥比中光	9,005	1,175,602.75	0.34
59	688668	鼎通科技	3,146	1,174,401.80	0.34
60	688220	翱捷科技	9,299	1,156,051.68	0.34
61	688536	思瑞浦	3,112	1,133,048.08	0.33
62	688027	国盾量子	2,246	1,132,006.46	0.33
63	688432	有研硅	27,847	1,113,044.59	0.33
64	688578	艾力斯	9,966	1,088,287.20	0.32
65	688223	晶科能源	228,738	1,086,505.50	0.32
66	688545	兴福电子	8,113	1,079,515.78	0.32

67	688336	三生国健	20,080	1,066,248.00	0.31
68	688331	荣昌生物	7,967	1,037,781.42	0.30
69	688025	杰普特	2,205	1,036,350.00	0.30
70	688167	炬光科技	2,898	1,026,500.58	0.30
71	688188	柏楚电子	9,120	973,104.00	0.28
72	688362	甬矽电子	10,074	971,133.60	0.28
73	688213	思特威	9,028	966,627.96	0.28
74	688368	晶丰明源	4,459	965,462.68	0.28
75	688099	晶晨股份	9,354	962,526.60	0.28
76	688052	纳芯微	3,245	935,565.95	0.27
77	688009	中国通号	192,184	914,795.84	0.27
78	688122	西部超导	14,447	907,416.07	0.27
79	688001	华兴源创	10,541	903,363.70	0.26
80	688449	联芸科技	10,244	884,159.64	0.26
81	688472	阿特斯	80,982	876,225.24	0.26
82	688127	蓝特光学	8,967	875,179.20	0.26
83	688403	汇成股份	22,033	874,710.10	0.26
84	688248	南网科技	12,531	866,894.58	0.25
85	688676	金盘科技	10,220	865,020.80	0.25
86	688385	复旦微电	11,972	853,483.88	0.25
87	688303	大全能源	47,860	834,199.80	0.24
88	688502	茂莱光学	1,200	832,320.00	0.24
89	688301	奕瑞科技	6,679	828,196.00	0.24
90	688102	斯瑞新材	17,452	823,385.36	0.24
91	688233	神工股份	3,831	821,443.02	0.24
92	688538	和辉光电	307,655	799,903.00	0.23
93	688257	新锐股份	7,796	794,412.40	0.23
94	688433	华曙高科	9,174	785,294.40	0.23
95	688195	腾景科技	4,076	784,956.08	0.23
96	688065	凯赛生物	16,010	766,078.50	0.22
97	688268	华特气体	2,836	758,630.00	0.22
98	688652	京仪装备	3,768	754,240.56	0.22
99	688123	聚辰股份	3,532	750,903.20	0.22
100	688568	中科星图	17,983	745,755.01	0.22
101	688205	德科立	3,549	738,866.31	0.22
102	688599	天合光能	52,279	738,179.48	0.22
103	688503	聚和材料	5,457	724,143.90	0.21
104	688400	凌云光	10,718	709,531.60	0.21
105	688372	伟测科技	3,801	706,986.00	0.21
106	688266	泽璟制药	5,875	685,377.50	0.20
107	688018	乐鑫科技	5,299	677,848.08	0.20
108	688343	云天励飞	8,042	656,709.72	0.19
109	688235	百济神州	2,559	651,546.99	0.19

110	688388	嘉元科技	14,685	646,140.00	0.19
111	688308	欧科亿	3,530	641,789.30	0.19
112	688531	日联科技	3,604	640,935.36	0.19
113	688332	中科蓝讯	4,061	639,607.50	0.19
114	688352	颀中科技	26,445	639,440.10	0.19
115	688097	博众精工	10,053	633,841.65	0.19
116	688608	恒玄科技	3,784	632,646.96	0.18
117	688692	达梦数据	2,587	631,978.23	0.18
118	688297	中无人机	15,059	625,701.45	0.18
119	688800	瑞可达	6,502	623,996.94	0.18
120	688333	铂力特	6,087	623,308.80	0.18
121	689009	九号公司	16,281	621,120.15	0.18
122	688150	莱特光电	9,025	619,295.50	0.18
123	688778	厦钨新能	11,273	613,251.20	0.18
124	688392	骄成超声	2,654	602,935.72	0.18
125	688535	华海诚科	3,210	600,270.00	0.18
126	688757	胜科纳米	8,924	595,230.80	0.17
127	688380	中微半导	8,973	591,410.43	0.17
128	688582	芯动联科	9,039	587,535.00	0.17
129	688700	东威科技	6,571	587,447.40	0.17
130	688390	固德威	5,377	583,458.27	0.17
131	688617	惠泰医疗	3,192	579,539.52	0.17
132	688180	君实生物	17,012	575,345.84	0.17
133	688603	天承科技	2,749	571,654.55	0.17
134	688318	财富趋势	7,965	567,984.15	0.17
135	688003	天准科技	4,388	558,592.40	0.16
136	688507	索辰科技	2,035	548,798.80	0.16
137	688169	石头科技	5,723	543,513.31	0.16
138	688709	成都华微	14,237	542,287.33	0.16
139	688349	三一重能	35,613	540,605.34	0.16
140	688484	南芯科技	9,561	540,100.89	0.16
141	688028	沃尔德	3,453	538,219.11	0.16
142	688661	和林微纳	3,375	536,557.50	0.16
143	688584	上海合晶	14,831	533,174.45	0.16
144	688596	正帆科技	6,619	523,298.14	0.15
145	688563	航材股份	9,959	510,199.57	0.15
146	688143	长盈通	2,877	506,006.76	0.15
147	688625	呈和科技	5,939	501,310.99	0.15
148	688772	珠海冠宇	25,299	496,619.37	0.15
149	688106	金宏气体	11,965	496,308.20	0.15
150	688615	合合信息	4,377	495,038.70	0.14
151	688006	杭可科技	13,424	490,647.20	0.14
152	688278	特宝生物	9,019	490,633.60	0.14

153	688005	容百科技	15,854	485,132.40	0.14
154	688475	萤石网络	17,597	481,277.95	0.14
155	688819	天能股份	21,662	480,896.40	0.14
156	688425	铁建重工	118,855	477,797.10	0.14
157	688114	华大智造	9,322	476,167.76	0.14
158	688686	奥普特	2,808	472,839.12	0.14
159	688726	拉普拉斯	8,945	472,743.25	0.14
160	688523	航天环宇	8,990	471,076.00	0.14
161	688559	海目星	5,601	470,035.92	0.14
162	688279	峰岬科技	2,076	465,937.44	0.14
163	688605	先锋精科	4,409	458,624.18	0.13
164	688708	佳驰科技	8,988	456,590.40	0.13
165	688020	方邦股份	1,791	447,033.60	0.13
166	688131	皓元医药	4,709	445,471.40	0.13
167	688206	概伦电子	9,767	433,361.79	0.13
168	688515	裕太微	1,739	432,593.64	0.13
169	688059	华锐精密	2,147	428,777.37	0.13
170	688055	龙腾光电	74,402	428,555.52	0.13
171	688281	华秦科技	8,522	428,060.06	0.13
172	688662	富信科技	2,535	425,880.00	0.12
173	688192	迪哲医药	10,477	418,346.61	0.12
174	688359	三孚新科	2,107	418,113.08	0.12
175	688401	路维光电	4,343	416,841.14	0.12
176	688353	华盛锂电	3,560	413,209.20	0.12
177	688383	新益昌	2,191	411,995.64	0.12
178	688107	安路科技	8,995	410,172.00	0.12
179	688610	埃科光电	1,538	405,109.20	0.12
180	688516	奥特维	7,028	403,336.92	0.12
181	688319	欧林生物	9,153	402,548.94	0.12
182	688260	昀冢科技	2,794	402,336.00	0.12
183	688593	新相微	10,254	399,085.68	0.12
184	688690	纳微科技	8,937	394,121.70	0.12
185	688363	华熙生物	10,862	388,533.74	0.11
186	688182	灿勤科技	8,948	385,390.36	0.11
187	688798	艾为电子	5,231	383,536.92	0.11
188	688208	道通科技	15,022	378,404.18	0.11
189	688090	瑞松科技	3,540	376,833.00	0.11
190	688158	优刻得	10,166	373,702.16	0.11
191	688561	奇安信	15,258	365,886.84	0.11
192	688520	神州细胞	10,497	359,102.37	0.10
193	688378	奥来德	5,790	358,980.00	0.10
194	688376	美埃科技	3,048	354,482.40	0.10
195	688779	五矿新能	43,096	349,508.56	0.10

196	688530	欧莱新材	3,597	348,549.30	0.10
197	688275	万润新能	2,717	346,553.35	0.10
198	688416	恒烁股份	2,445	342,300.00	0.10
199	688166	博瑞医药	9,656	338,056.56	0.10
200	688100	威胜信息	10,897	333,339.23	0.10
201	688138	清溢光电	7,052	331,444.00	0.10
202	688337	普源精电	4,384	328,493.12	0.10
203	688262	国芯科技	7,405	320,118.15	0.09
204	688088	虹软科技	9,002	320,021.10	0.09
205	688116	天奈科技	8,253	315,264.60	0.09
206	688258	卓易信息	2,635	312,352.90	0.09
207	688456	有研粉材	2,236	312,145.60	0.09
208	688153	唯捷创芯	9,608	308,608.96	0.09
209	688029	南微医学	4,218	302,852.40	0.09
210	688031	星环科技	2,623	302,117.14	0.09
211	688691	灿芯股份	2,585	299,679.05	0.09
212	688371	菲沃泰	7,613	296,830.87	0.09
213	688717	艾罗能源	3,575	295,187.75	0.09
214	688125	安达智能	1,798	293,973.00	0.09
215	688381	帝奥微	5,481	293,233.50	0.09
216	688063	派能科技	5,457	290,694.39	0.08
217	688222	成都先导	8,990	288,668.90	0.08
218	688327	云从科技	23,049	287,190.54	0.08
219	688261	东微半导	2,726	286,039.18	0.08
220	688663	新风光	3,227	285,460.42	0.08
221	688567	孚能科技	27,183	285,421.50	0.08
222	688209	英集芯	9,767	284,024.36	0.08
223	688079	美迪凯	9,148	281,301.00	0.08
224	688035	德邦科技	3,058	280,724.40	0.08
225	688669	聚石化学	2,622	280,554.00	0.08
226	688312	燕麦科技	3,337	280,274.63	0.08
227	688198	佰仁医疗	3,124	278,785.76	0.08
228	688478	晶升股份	3,127	276,895.85	0.08
229	688306	均普智能	27,270	275,427.00	0.08
230	688612	威迈斯	9,295	275,039.05	0.08
231	688508	芯朋微	2,940	273,302.40	0.08
232	688486	龙迅股份	4,225	268,625.50	0.08
233	688720	艾森股份	2,648	267,448.00	0.08
234	688191	智洋创新	7,376	263,323.20	0.08
235	688231	隆达股份	7,161	263,023.53	0.08
236	688112	鼎阳科技	3,573	262,472.58	0.08
237	688677	海泰新光	2,587	261,623.31	0.08
238	688227	品高股份	2,520	258,778.80	0.08

239	688660	电气风电	29,858	257,375.96	0.08
240	688321	微芯生物	9,762	257,033.46	0.08
241	688239	航宇科技	4,244	253,918.52	0.07
242	688062	迈威生物	8,973	253,487.25	0.07
243	688698	伟创电气	4,784	250,920.80	0.07
244	688325	赛微微电	1,909	248,952.69	0.07
245	688083	中望软件	3,825	247,668.75	0.07
246	688628	优利德	2,488	246,162.72	0.07
247	688556	高测股份	18,527	246,038.56	0.07
248	688202	美迪西	3,040	245,358.40	0.07
249	688611	杭州柯林	3,392	242,358.40	0.07
250	688016	心脉医疗	2,726	241,632.64	0.07
251	688583	思看科技	2,789	239,212.53	0.07
252	688351	微电生理	10,483	237,544.78	0.07
253	688155	先惠技术	2,931	237,088.59	0.07
254	688190	云路股份	2,606	236,390.26	0.07
255	688165	埃夫特	11,587	236,374.80	0.07
256	688032	禾迈股份	2,795	236,233.40	0.07
257	688518	联赢激光	7,584	234,345.60	0.07
258	688382	益方生物	12,910	232,380.00	0.07
259	688093	世华科技	6,285	231,916.50	0.07
260	688598	金博股份	4,625	228,706.25	0.07
261	688550	瑞联新材	3,934	227,581.90	0.07
262	688160	步科股份	2,083	226,567.91	0.07
263	688179	阿拉丁	8,148	225,781.08	0.07
264	688323	瑞华泰	3,991	225,491.50	0.07
265	688135	利扬芯片	5,300	223,024.00	0.07
266	688543	国科军工	5,646	222,734.70	0.07
267	688485	九州一轨	3,457	221,455.42	0.06
268	688788	科思科技	4,893	220,087.14	0.06
269	688678	福立旺	9,094	219,801.98	0.06
270	688170	德龙激光	2,280	218,902.80	0.06
271	688046	药康生物	9,033	218,598.60	0.06
272	688252	天德钰	9,050	217,200.00	0.06
273	688711	宏微科技	4,775	217,023.75	0.06
274	688128	中国电研	9,097	215,962.78	0.06
275	688307	中润光学	2,695	215,465.25	0.06
276	688710	益诺思	3,184	213,964.80	0.06
277	688230	芯导科技	2,706	213,259.86	0.06
278	688552	航天南湖	7,475	210,271.75	0.06
279	688439	振华风光	4,550	210,210.00	0.06
280	688789	宏华数科	3,923	208,585.91	0.06
281	688418	震有科技	4,324	207,897.92	0.06

282	688328	深科达	2,171	207,764.70	0.06
283	688386	泛亚微透	2,292	205,913.28	0.06
284	688586	江航装备	17,530	204,925.70	0.06
285	688758	赛分科技	9,226	203,064.26	0.06
286	688699	明微电子	2,458	201,433.10	0.06
287	688105	诺唯赞	11,513	199,750.55	0.06
288	688499	利元亨	3,772	198,218.60	0.06
289	688419	耐科装备	2,503	196,860.95	0.06
290	688697	纽威数控	14,348	194,989.32	0.06
291	688480	赛恩斯	2,207	193,311.13	0.06
292	688305	科德数控	2,937	191,697.99	0.06
293	688181	八亿时空	3,046	190,679.60	0.06
294	688719	爱科赛博	2,472	190,344.00	0.06
295	688139	海尔生物	7,118	188,057.56	0.05
296	688161	威高骨科	8,951	187,791.98	0.05
297	688289	圣湘生物	13,003	187,243.20	0.05
298	688221	前沿生物	8,359	187,241.60	0.05
299	688443	智翔金泰	8,045	187,046.25	0.05
300	688733	壹石通	4,520	186,902.00	0.05
301	688253	英诺特	3,097	186,687.16	0.05
302	688522	纳睿雷达	9,315	186,486.30	0.05
303	688591	泰凌微	5,420	186,339.60	0.05
304	688068	热景生物	2,137	185,064.20	0.05
305	688091	上海谊众	4,560	183,312.00	0.05
306	688326	经纬恒润	2,586	183,295.68	0.05
307	688786	悦安新材	3,960	182,476.80	0.05
308	688226	威腾电气	4,260	182,455.80	0.05
309	688689	银河微电	2,800	181,216.00	0.05
310	688049	炬芯科技	3,857	180,931.87	0.05
311	688601	力芯微	2,984	180,681.20	0.05
312	688739	成大生物	9,267	180,613.83	0.05
313	688173	希荻微	9,291	177,829.74	0.05
314	688685	迈信林	3,239	177,821.10	0.05
315	688693	锆威特	1,706	177,338.70	0.05
316	688721	龙图光罩	3,021	176,365.98	0.05
317	688787	海天瑞声	1,306	175,591.70	0.05
318	688108	赛诺医疗	9,409	174,348.77	0.05
319	688277	天智航	10,121	173,069.10	0.05
320	688010	福光股份	3,558	173,025.54	0.05
321	688750	金天钛业	10,353	172,170.39	0.05
322	688513	苑东生物	3,905	171,663.80	0.05
323	688631	莱斯信息	3,651	171,268.41	0.05
324	688428	诺诚健华	6,000	170,820.00	0.05

325	688379	华光新材	2,022	169,908.66	0.05
326	688479	友车科技	4,426	168,055.22	0.05
327	688512	慧智微	10,492	167,557.24	0.05
328	688653	康希通信	9,597	166,795.86	0.05
329	688551	科威尔	2,369	166,469.63	0.05
330	688655	迅捷兴	3,045	163,090.20	0.05
331	688168	安博通	2,372	163,075.00	0.05
332	688667	菱电电控	1,196	159,845.40	0.05
333	688219	会通股份	12,351	159,821.94	0.05
334	688577	浙海德曼	3,486	159,763.38	0.05
335	688050	爱博医疗	4,356	158,776.20	0.05
336	688408	中信博	4,933	158,595.95	0.05
337	688626	翔宇医疗	3,573	158,140.98	0.05
338	688177	百奥泰	9,143	153,785.26	0.04
339	688103	国力电子	2,010	149,564.10	0.04
340	688365	光云科技	9,474	149,404.98	0.04
341	688776	国光电气	2,425	148,749.50	0.04
342	688011	新光光电	2,127	148,613.49	0.04
343	688553	汇宇制药	13,856	147,289.28	0.04
344	688210	统联精密	3,593	145,552.43	0.04
345	688290	景业智能	2,192	145,461.12	0.04
346	688707	振华新材	11,319	145,449.15	0.04
347	688087	英科再生	4,320	144,374.40	0.04
348	688620	安凯微	8,897	144,131.40	0.04
349	688665	四方光电	2,183	143,423.10	0.04
350	688320	禾川科技	3,455	143,209.75	0.04
351	688218	江苏北人	2,585	142,071.60	0.04
352	688595	芯海科技	3,203	140,483.58	0.04
353	688636	智明达	3,812	138,108.76	0.04
354	688570	天玛智控	9,702	138,059.46	0.04
355	688510	航亚科技	5,781	138,050.28	0.04
356	688683	莱尔科技	3,640	138,028.80	0.04
357	688345	博力威	2,370	137,649.60	0.04
358	688007	光峰科技	10,341	137,535.30	0.04
359	688621	阳光诺和	2,474	135,847.34	0.04
360	688562	航天软件	8,970	135,088.20	0.04
361	688799	华纳药厂	2,978	133,622.86	0.04
362	688286	敏芯股份	1,156	133,020.92	0.04
363	688117	圣诺生物	4,920	132,987.60	0.04
364	688656	浩欧博	1,372	132,768.44	0.04
365	688448	磁谷科技	2,074	131,823.44	0.04
366	688539	高华科技	4,133	131,760.04	0.04
367	688185	康希诺	2,575	131,299.25	0.04

368	688658	悦康药业	10,150	130,529.00	0.04
369	688291	金橙子	2,230	130,410.40	0.04
370	688293	奥浦迈	3,128	130,406.32	0.04
371	688069	德林海	3,476	129,863.36	0.04
372	688045	必易微	1,604	129,571.12	0.04
373	688109	品茗科技	1,704	128,992.80	0.04
374	688609	九联科技	11,701	128,828.01	0.04
375	688623	双元科技	1,281	128,689.26	0.04
376	688334	西高院	7,045	127,796.30	0.04
377	688276	百克生物	9,159	127,676.46	0.04
378	688526	科前生物	10,458	126,541.80	0.04
379	688366	昊海生科	4,360	125,873.20	0.04
380	688232	新点软件	7,075	125,793.50	0.04
381	688061	灿瑞科技	2,525	125,416.75	0.04
382	688176	亚虹医药	12,587	124,863.04	0.04
383	688679	通源环境	2,956	124,418.04	0.04
384	688095	福昕软件	2,087	124,030.41	0.04
385	688115	思林杰	1,502	123,539.50	0.04
386	688101	三达膜	7,396	122,255.88	0.04
387	688199	久日新材	3,537	122,132.61	0.04
388	688377	迪威尔	5,149	121,413.42	0.04
389	688488	艾迪药业	9,365	120,340.25	0.04
390	688348	昱能科技	3,450	119,991.00	0.04
391	688228	开普云	1,529	118,252.86	0.03
392	688580	伟思医疗	2,215	117,993.05	0.03
393	688119	中钢洛耐	24,802	117,809.50	0.03
394	688282	理工导航	1,996	116,167.20	0.03
395	688505	复旦张江	15,717	115,991.46	0.03
396	688163	赛伦生物	2,363	115,338.03	0.03
397	688207	格灵深瞳	5,720	114,972.00	0.03
398	688315	诺禾致源	9,171	114,729.21	0.03
399	688633	星球石墨	3,826	113,746.98	0.03
400	688151	华强科技	7,598	112,982.26	0.03
401	688575	亚辉龙	12,865	112,697.40	0.03
402	688648	中邮科技	3,074	112,354.70	0.03
403	688350	富淼科技	3,227	111,428.31	0.03
404	688566	吉贝尔	4,348	111,265.32	0.03
405	688073	毕得医药	2,039	109,738.98	0.03
406	688197	首药控股	3,279	109,551.39	0.03
407	688225	亚信安全	8,744	108,600.48	0.03
408	688767	博拓生物	3,305	107,445.55	0.03
409	688299	长阳科技	6,413	107,161.23	0.03
410	688330	宏力达	3,159	106,868.97	0.03

411	688216	气派科技	2,527	106,159.27	0.03
412	688237	超卓航科	1,974	105,451.08	0.03
413	688696	极米科技	1,626	104,942.04	0.03
414	688311	盟升电子	3,960	103,712.40	0.03
415	688360	德马科技	5,788	103,605.20	0.03
416	688458	美芯晟	2,475	103,356.00	0.03
417	688356	键凯科技	1,332	102,670.56	0.03
418	688211	中科微至	2,972	102,296.24	0.03
419	688607	康众医疗	2,002	102,102.00	0.03
420	688600	皖仪科技	3,056	101,703.68	0.03
421	688410	山外山	7,080	101,668.80	0.03
422	688309	恒誉环保	1,666	101,426.08	0.03
423	688196	卓越新能	2,820	101,238.00	0.03
424	688267	中触媒	5,129	101,041.30	0.03
425	688768	容知日新	1,923	99,111.42	0.03
426	688148	芳源股份	11,392	97,743.36	0.03
427	688558	国盛智科	2,965	97,429.90	0.03
428	688398	赛特新材	3,753	97,240.23	0.03
429	688085	三友医疗	8,119	97,184.43	0.03
430	688450	光格科技	1,449	97,068.51	0.03
431	688056	莱伯泰科	1,490	96,179.50	0.03
432	688186	广大特材	6,326	95,838.90	0.03
433	688159	有方科技	2,148	95,349.72	0.03
434	688175	高凌信息	3,783	95,142.45	0.03
435	688136	科兴制药	4,581	94,872.51	0.03
436	688259	创耀科技	2,409	94,240.08	0.03
437	688039	当虹科技	2,521	94,083.72	0.03
438	688269	凯立新材	2,967	94,083.57	0.03
439	688236	春立医疗	6,462	93,440.52	0.03
440	688680	海优新材	2,224	93,408.00	0.03
441	688429	时创能源	9,051	92,229.69	0.03
442	688602	康鹏科技	11,689	92,109.32	0.03
443	688057	金达莱	5,963	91,889.83	0.03
444	688639	华恒生物	5,646	91,126.44	0.03
445	688389	普门科技	9,301	91,056.79	0.03
446	688581	安杰思	1,759	90,957.89	0.03
447	688081	兴图新科	2,216	90,590.08	0.03
448	688075	安旭生物	3,044	90,589.44	0.03
449	688084	晶品特装	1,799	90,453.72	0.03
450	688511	天微电子	2,986	90,207.06	0.03
451	688391	钜泉科技	2,511	90,069.57	0.03
452	688157	松井股份	3,401	89,752.39	0.03
453	688212	澳华内镜	3,044	89,493.60	0.03

454	688459	哈铁科技	10,607	88,356.31	0.03
455	688489	三未信安	3,855	87,508.50	0.03
456	688283	坤恒顺维	2,630	87,079.30	0.03
457	688682	霍莱沃	2,235	86,941.50	0.03
458	688590	新致软件	6,872	85,418.96	0.02
459	688399	硕世生物	1,843	83,653.77	0.02
460	688716	中研股份	2,644	83,100.92	0.02
461	688215	瑞晟智能	2,061	82,769.76	0.02
462	688273	麦澜德	2,121	82,167.54	0.02
463	688339	亿华通	4,376	81,831.20	0.02
464	688571	杭华股份	9,216	80,640.00	0.02
465	688588	凌志软件	8,838	80,337.42	0.02
466	688171	纬德信息	1,823	80,139.08	0.02
467	688023	安恒信息	2,177	79,939.44	0.02
468	688098	申联生物	9,290	79,801.10	0.02
469	688500	慧辰股份	1,748	79,236.84	0.02
470	688298	东方生物	4,420	78,941.20	0.02
471	688238	和元生物	14,484	78,503.28	0.02
472	688335	复洁科技	3,250	78,130.00	0.02
473	688247	宣泰医药	10,268	77,215.36	0.02
474	688229	博睿数据	1,002	76,853.40	0.02
475	688358	祥生医疗	2,498	76,363.86	0.02
476	688569	铁科轨道	4,727	76,341.05	0.02
477	688533	上声电子	3,644	76,013.84	0.02
478	688302	海创药业	2,145	75,439.65	0.02
479	688722	同益中	4,947	75,045.99	0.02
480	688557	兰剑智能	2,404	74,596.12	0.02
481	688130	晶华微	2,652	74,574.24	0.02
482	688133	泰坦科技	3,525	74,483.25	0.02
483	688618	三旺通信	2,409	74,124.93	0.02
484	688080	映翰通	1,704	73,698.00	0.02
485	688657	浩辰软件	2,047	73,221.19	0.02
486	688272	富吉瑞	1,644	72,993.60	0.02
487	688070	纵横股份	1,943	72,532.19	0.02
488	688509	正元地信	16,930	72,460.40	0.02
489	688589	力合微	3,151	72,409.98	0.02
490	688280	精进电动	13,053	71,660.97	0.02
491	688592	司南导航	1,726	71,525.44	0.02
492	688755	汉邦科技	2,580	71,104.80	0.02
493	688162	巨一科技	2,993	70,754.52	0.02
494	688606	奥泰生物	1,716	70,493.28	0.02
495	688455	科捷智能	3,745	69,881.70	0.02
496	688096	京源环保	5,203	69,512.08	0.02

497	688129	东来技术	2,652	69,455.88	0.02
498	688071	华依科技	1,882	68,580.08	0.02
499	688338	赛科希德	2,313	68,256.63	0.02
500	688579	地纬智能	8,969	68,074.71	0.02
501	688156	路德科技	2,227	67,366.75	0.02
502	688255	凯尔达	2,413	67,081.40	0.02
503	688292	浩瀚深度	3,602	66,997.20	0.02
504	688619	罗普特	4,124	66,932.52	0.02
505	688077	大地熊	2,524	66,860.76	0.02
506	688373	盟科药业	14,673	66,468.69	0.02
507	688367	工大高科	1,976	65,800.80	0.02
508	688370	丛麟科技	3,137	65,626.04	0.02
509	688317	之江生物	4,313	65,557.60	0.02
510	688030	山石网科	4,138	65,339.02	0.02
511	688357	建龙微纳	2,192	64,598.24	0.02
512	688687	凯因科技	3,875	63,201.25	0.02
513	688246	嘉和美康	3,051	62,698.05	0.02
514	688152	麒麟信安	2,272	62,434.56	0.02
515	688576	西山科技	1,559	62,126.15	0.02
516	688671	碧兴物联	1,738	61,820.66	0.02
517	688015	交控科技	4,011	61,689.18	0.02
518	688285	高铁电气	8,490	60,873.30	0.02
519	688178	万德斯	1,783	60,283.23	0.02
520	688314	康拓医疗	1,775	60,137.00	0.02
521	688316	青云科技	1,113	60,102.00	0.02
522	688435	英方软件	1,834	58,688.00	0.02
523	688265	南模生物	1,688	58,387.92	0.02
524	688529	豪森智能	3,664	57,634.72	0.02
525	688137	近岸蛋白	1,589	57,204.00	0.02
526	688251	井松智能	2,214	56,744.82	0.02
527	688310	迈得医疗	3,675	56,484.75	0.02
528	688560	明冠新材	4,582	54,296.70	0.02
529	688517	金冠电气	2,998	52,405.04	0.02
530	688501	青达环保	2,724	52,300.80	0.02
531	688369	致远互联	2,483	52,167.83	0.02
532	688355	明志科技	2,662	51,243.50	0.01
533	688113	联测科技	1,449	50,859.90	0.01
534	688737	中自科技	2,648	50,682.72	0.01
535	688468	科美诊断	8,883	50,544.27	0.01
536	688597	煜邦电力	7,705	50,082.50	0.01
537	688651	盛邦安全	1,545	49,779.90	0.01
538	688244	永信至诚	3,469	49,467.94	0.01
539	688026	洁特生物	3,079	48,371.09	0.01

540	688193	仁度生物	870	48,111.00	0.01
541	688670	金迪克	2,784	47,160.96	0.01
542	688426	康为世纪	2,568	47,097.12	0.01
543	688203	海正生材	4,664	46,546.72	0.01
544	688038	中科通达	2,717	45,699.94	0.01
545	688132	邦彦技术	3,389	44,565.35	0.01
546	688013	天臣医疗	1,792	44,208.64	0.01
547	688060	云涌科技	1,316	43,283.24	0.01
548	688613	奥精医疗	3,059	43,162.49	0.01
549	688395	正弦电气	1,942	42,918.20	0.01
550	688118	普元信息	2,130	42,855.60	0.01
551	688616	西力科技	4,053	40,935.30	0.01
552	688089	嘉必优	3,788	40,190.68	0.01
553	688573	信宇人	2,244	39,763.68	0.01
554	688420	美腾科技	1,886	39,738.02	0.01
555	688393	安必平	2,212	39,329.36	0.01
556	688288	鸿泉技术	2,192	38,951.84	0.01
557	688092	爱科科技	1,775	37,701.00	0.01
558	688051	佳华科技	1,640	37,687.20	0.01
559	688189	南新制药	6,282	37,566.36	0.01
560	688121	卓然股份	5,762	37,337.76	0.01
561	688659	元琛科技	3,543	36,988.92	0.01
562	688638	誉辰智能	1,160	36,157.20	0.01
563	688528	秦川物联	3,869	35,362.66	0.01
564	688021	奥福科技	1,803	34,906.08	0.01
565	688078	龙软科技	1,657	34,879.85	0.01
566	688695	中创股份	1,862	34,819.40	0.01
567	688058	宝兰德	1,644	34,392.48	0.01
568	688466	金科环境	2,654	34,050.82	0.01
569	688329	艾隆科技	1,678	33,912.38	0.01
570	688004	博汇科技	1,790	32,578.00	0.01
571	688681	科汇股份	2,329	32,559.42	0.01
572	688793	倍轻松	1,911	30,786.21	0.01
573	688565	力源科技	3,255	30,759.75	0.01
574	688067	爱威科技	1,505	30,325.75	0.01
575	688296	和达科技	2,565	29,343.60	0.01
576	688217	睿昂基因	1,319	27,250.54	0.01
577	688701	卓锦股份	2,908	21,897.24	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

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	688808	联讯仪器	75	118,824.75	0.03
2	688818	电科蓝天	1,012	70,981.68	0.02
3	688809	强一股份	101	62,923.00	0.02
4	688820	盛合晶微	434	61,406.66	0.02
5	688797	臻宝科技	121	56,709.07	0.02
6	688712	北芯生命	1,392	50,000.64	0.01
7	688785	恒运昌	90	41,683.50	0.01
8	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
9	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
10	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
11	603459	红板科技	198	16,695.36	0.00
12	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
13	688816	易思维	139	7,936.90	0.00
14	601112	振石股份	332	5,839.88	0.00
15	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
16	688781	视涯科技	102	4,856.22	0.00
17	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
18	603293	埃泰克	53	1,798.29	0.00
19	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例 (%)
1	688795	摩尔线程	8,086,106.89	2.38
2	688802	沐曦股份	6,771,883.60	2.00
3	688411	海博思创	1,387,652.34	0.41
4	688256	寒武纪	1,014,979.50	0.30
5	688200	华峰测控	612,017.34	0.18
6	688545	兴福电子	611,375.21	0.18
7	688041	海光信息	579,204.96	0.17
8	688766	普冉股份	573,753.59	0.17
9	688630	芯碁微装	534,212.72	0.16
10	688195	腾景科技	468,355.37	0.14
11	688617	惠泰医疗	466,750.45	0.14
12	688536	思瑞浦	466,036.59	0.14
13	688668	鼎通科技	412,465.65	0.12
14	688019	安集科技	404,454.57	0.12
15	688048	长光华芯	399,643.64	0.12

16	688615	合合信息	391,253.77	0.12
17	688052	纳芯微	387,273.32	0.11
18	688017	绿的谐波	379,144.73	0.11
19	688205	德科立	367,576.50	0.11
20	688372	伟测科技	350,858.78	0.10

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	688498	源杰科技	1,540,450.38	0.45
2	688256	寒武纪	1,206,338.15	0.36
3	688041	海光信息	1,048,074.17	0.31
4	688027	国盾量子	835,651.47	0.25
5	688270	臻镭科技	824,397.93	0.24
6	600930	华电新能	714,989.38	0.21
7	688635	长进光子	640,091.43	0.19
8	688818	电科蓝天	586,404.08	0.17
9	688808	联讯仪器	492,137.64	0.15
10	688797	臻宝科技	453,846.71	0.13
11	688012	中微公司	418,571.00	0.12
12	688235	百济神州	416,453.14	0.12
13	688627	精智达	412,781.47	0.12
14	688692	达梦数据	385,278.70	0.11
15	688981	中芯国际	370,442.22	0.11
16	688506	百利天恒	354,311.99	0.10
17	688111	金山办公	336,719.24	0.10
18	688167	炬光科技	329,253.00	0.10
19	688521	芯原股份	302,718.18	0.09
20	688795	摩尔线程	295,457.19	0.09

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	49,078,370.54
卖出股票收入（成交）总额	43,456,391.90

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	38,000.81	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,000.81	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	118072	鼎通转债	210	21,000.55	0.01
2	118071	华峰转债	170	17,000.26	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

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

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	5,181,696.00	1.51	重大事项停牌

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688808	联讯仪器	118,824.75	0.03	新股流通受限
2	688818	电科蓝天	70,981.68	0.02	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	61,406.66	0.02	新股流通受限
4	688797	臻宝科技	56,709.07	0.02	新股流通受限

§ 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		招商上证科创板综合 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
864	195,103.20	148,246,366.00	87.94%	20,322,800.00	12.06%	116,471,700.00	69.09%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	48,200.00	0.0286%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025 年 2 月 26 日)基金份额总额	1,288,569,166.00
本报告期期初基金份额总额	258,569,166.00
本报告期基金总申购份额	50,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	140,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	168,569,166.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

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，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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	
国泰海通证券	5	91,652,442.65	100.00%	9,158.24	100.00%	-

注：（一）选择标准

1、证券公司应财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强，并通过基金管理人的尽职调查。

2、被动股票型基金选择佣金费率相对较低，能够提供优质证券交易服务的证券公司。

3、被动股票型基金以外类型基金选择能够提供优质研究服务的证券公司。

（二）选择程序

1、基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

2、基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰海通证券	166,428.50	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-01-21

2	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-21
3	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书(二零二六年第一号)	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
4	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
5	招商基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-03-31
6	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
7	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-01
8	招商基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报及基金管理人网站	2026-04-22
9	招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
10	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息信息的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-14
11	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-19
12	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加华鑫证券有限责任公司为场内申购赎回代办券商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

招商上证科创板综合ETF联接	1	20260101-20260630	188,413,200.00	18,223,200.00	90,164,700.00	116,471,700.00	69.09%
----------------	---	-------------------	----------------	---------------	---------------	----------------	--------

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，可能会出现集中赎回甚至巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：1、报告期末持有份额占比按照四舍五入方法保留至小数点后第 2 位；

2、申购份额包含申购、定期定额投资、转换转入、红利再投资或者买入等业务增加的份额，赎回份额包含赎回、转换转出或者卖出等业务减少的份额。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

12.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日