

中欧上证科创板综合指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行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	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	10
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	11
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	12
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	12
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	12
§ 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所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52

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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	56
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧上证科创板综合指数证券投资基金	
基金简称	中欧上证科创板综合指数	
基金主代码	023905	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 9 月 9 日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	202,716,653.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
下属分级基金的交易代码	023905	023906
报告期末下属分级基金的份额总额	104,427,425.88 份	98,289,227.61 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%，投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票资产的 10%；每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金如果投资港股通标的股票，还可能面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)	
	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
本期已实现收益	40,316,216.47	24,408,700.08
本期利润	112,334,157.55	63,792,866.68
加权平均基金份 额本期利润	0.4596	0.4472
本期加权平均净 值利润率	42.27%	40.61%
本期基金份额净 值增长率	51.08%	50.88%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	19,244,273.46	17,873,232.47
期末可供分配基金份额利润	0.1843	0.1818
期末基金资产净值	153,635,370.48	144,311,044.95
期末基金份额净值	1.4712	1.4682
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	47.12%	46.82%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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

中欧上证科创板综合指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	52.73%	2.24%	52.44%	2.24%	0.29%	0.00%
过去六个月	51.08%	2.12%	50.92%	2.11%	0.16%	0.01%
自基金合同生效起至今	47.12%	1.87%	58.46%	1.92%	-11.34%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧上证科创板综合指数 C

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

	率①	准差②		④		
过去三个月	52.62%	2.24%	52.44%	2.24%	0.18%	0.00%
过去六个月	50.88%	2.12%	50.92%	2.11%	-0.04%	0.01%
自基金合同生效起 至今	46.82%	1.87%	58.46%	1.92%	-11.64 %	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧上证科创板综合指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 9 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

中欧上证科创板综合指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日期为 2025 年 9 月 9 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例已经符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

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		
宋巍巍	量化投决会委员 / 基金经理	2025-09-09	-	9 年	2016-07-21 加入中欧基金管理有限公司，历任研究员、投资经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；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》等相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 9 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

上半年，上证科创板综合指数上涨 53.99%，在主要宽基指数中涨幅居前，走出“一季度倒 V 型（-1.11%）→二季度大幅上行（+55.71%）”的强势曲线。

一季度，指数 1 月大涨 11.97%、2 月微涨 0.94%、3 月大幅回调 12.5%。科创板内部呈现“各赛道定价逻辑本质不同、对宏观敏感度各异”的大分化特征：1 月流动性宽松环境下高弹性成长资产领涨；2 月半导体进入预期消化期，创新药凭借授权出海交易走出独立行情——一季度国内创新药对外授权交易总额创同期新高，中国成为全球授权交易第一大国；3 月份地缘政治风险升温，美伊冲突加剧及霍尔木兹海峡封锁预期推升国际油价快速上行，美联储鹰派表态致使降息预期回

落，高估值成长股杀估值幅度最大，但创新药与上游光电子环节逆势走强，充分体现指数“高弹性、大分化”的结构特征。

二季度，指数大幅上涨 55.71%：4 月上涨 20.50%——前期跌幅较深带来高修复弹性，全球风险偏好回暖后资金率先回流硬科技板块，叠加 AI 算力产业链一季报业绩拐点确认与政治局会议“人工智能+”定调；5 月上涨 6.16%——流动性宽松预期推动成长风格延续强势，科创板一季报盈利大幅改善提供数据验证；6 月大涨 21.72%——美伊正式停战推动风险偏好急剧回升，陆家嘴论坛明确科创板第五套上市标准适用范围扩大至人工智能领域、明确优质大模型企业上市通道，制度层面的重大突破为科创板 AI 生态打开新的想象空间；月末半导体全链条涨价信号与 AI 算力订单饱满形成基本面支撑，指数在消化美联储鹰派冲击后强势回补、以上半年最高点收官。

在投资策略方面，本基金作为跟踪上证科创板综合指数的被动指数产品，基金管理人运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 51.08%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%；基金 C 类份额净值增长率为 50.88%，同期业绩比较基准收益率为 50.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从周期定位看，科创综指的走势主要挂钩三条产业周期：其一，全球半导体存储周期——供给端产能持续向高带宽存储倾斜、通用产能被动收缩，是驱动指数上半年强势的核心力量，下半年存储价格斜率与产业链盈利在中报的兑现程度，是判断该周期所处位置的核心观测变量；其二，国内 AI 产业化周期——国产算力芯片进入互联网大厂规模商用的进度、先进制程晶圆产能与先进封装的扩产节奏，是该周期能否延伸的关键观测点；其三，创新药提供了一条与宏观流动性关联度较低的支撑线，授权出海交易节奏与临床数据读出是其独立的跟踪变量。作为覆盖科创板全部标的的综合指数，科创综指同时承载上述三条主线，业绩弹性与波动均较大。需要提示的是，海外加息预期升温、实际利率维持高位，是对高估值成长资产估值中枢的持续外部约束项。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席

指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧上证科创板综合指数证券投资基金

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	10,101,868.36	11,433,881.08
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	288,908,722.40	797,037,194.01
其中：股票投资		282,934,232.07	765,118,146.56
基金投资		-	-
债券投资		5,974,490.33	31,919,047.45
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		1,221,785.69	106,886.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		300,232,376.45	808,577,962.01
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		2,040,247.39	2,513,679.37

应付管理人报酬		114,834.32	340,199.28
应付托管费		22,966.91	68,039.86
应付销售服务费		26,830.55	47,983.21
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	81,081.85	31,000.00
负债合计		2,285,961.02	3,000,901.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	202,716,653.49	827,415,961.45
未分配利润	6.4.7.8	95,229,761.94	-21,838,901.16
净资产合计		297,946,415.43	805,577,060.29
负债和净资产总计		300,232,376.45	808,577,962.01

注：1. 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 202,716,653.49 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.4712 元，基金份额总额 104,427,425.88 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.4682 元，基金份额总额 98,289,227.61 份。

2. 本基金基金合同于 2025 年 09 月 09 日生效，合同生效当期的相关数据按实际存续期计算，下同。

6.2 利润表

会计主体：中欧上证科创板综合指数证券投资基金

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
一、营业总收入		177,689,598.49
1. 利息收入		2,801.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,801.65
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）		66,264,084.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	65,650,894.51
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.11	116,088.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.13	—
股利收益	6.4.7.14	497,101.20

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）	6.4.7.15	111,402,107.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	20,604.60
减：二、营业总支出		1,562,574.26
1. 管理人报酬		1,061,213.26
2. 托管费		212,242.67
3. 销售服务费		196,159.84
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.18	92,958.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		176,127,024.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		176,127,024.23
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		176,127,024.23

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧上证科创板综合指数证券投资基金

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	827,415,961.45	-	-21,838,901.16	805,577,060.29
二、本期期初净资产	827,415,961.45	-	-21,838,901.16	805,577,060.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-624,699,307.96	-	117,068,663.10	-507,630,644.86
（一）、综合收益总额	-	-	176,127,024.23	176,127,024.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-624,699,307.96	-	-59,058,361.13	-683,757,669.09

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	100,183,836.29	-	13,854,749.40	114,038,585.69
2. 基金赎回款	-724,883,144.25	-	-72,913,110.53	-797,796,254.78
(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	202,716,653.49	-	95,229,761.94	297,946,415.43

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：

刘建平

王音然

李宝林

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

中欧上证科创板综合指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]572号《关于准予中欧上证科创板综合指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧上证科创板综合指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,061,320,659.68元,经向中国证监会备案,《中欧上证科创板综合指数证券投资基金基金合同》于2025年9月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,061,878,883.19份基金份额,其中包含认购资金利息折合558,223.51份基金份额。本基金最新情况见2.基金简介。

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》(财会[2022]14号)和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继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[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[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率缴纳增值税。

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, 恢复缴纳增值税; 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, 暂不计缴企业所得税。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入, 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。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

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。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	845, 204. 78

等于：本金	845,194.85
加：应计利息	9.93
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	9,256,663.58
等于：本金	9,256,524.40
加：应计利息	139.18
减：坏账准备	-
合计	10,101,868.36

注：本基金持有的其他存款均为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		190,640,731.39	-	282,934,232.07	92,293,500.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,901,751.56	73,310.33	5,974,490.33	-571.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,901,751.56	73,310.33	5,974,490.33	-571.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		196,542,482.95	73,310.33	288,908,722.40	92,292,929.12

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

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 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-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	14,876.39
其他应付	6,698.09
合计	81,081.85

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧上证科创板综合指数 A

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	602,628,288.72	602,628,288.72
本期申购	25,168,578.58	25,168,578.58
本期赎回（以“-”号填列）	-523,369,441.42	-523,369,441.42
本期末	104,427,425.88	104,427,425.88

中欧上证科创板综合指数 C

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	224,787,672.73	224,787,672.73
本期申购	75,015,257.71	75,015,257.71
本期赎回（以“-”号填列）	-201,513,702.83	-201,513,702.83
本期末	98,289,227.61	98,289,227.61

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧上证科创板综合指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,899,779.07	-13,882,226.39	-15,782,005.46

本期期初	-1,899,779.07	-13,882,226.39	-15,782,005.46
本期利润	40,316,216.47	72,017,941.08	112,334,157.55
本期基金份额交易产生的变动数	-19,172,163.94	-28,172,043.55	-47,344,207.49
其中：基金申购款	1,752,768.27	1,693,251.50	3,446,019.77
基金赎回款	-20,924,932.21	-29,865,295.05	-50,790,227.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,244,273.46	29,963,671.14	49,207,944.60

中欧上证科创板综合指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-877,512.10	-5,179,383.60	-6,056,895.70
本期期初	-877,512.10	-5,179,383.60	-6,056,895.70
本期利润	24,408,700.08	39,384,166.60	63,792,866.68
本期基金份额交易产生的变动数	-5,657,955.51	-6,056,198.13	-11,714,153.64
其中：基金申购款	5,555,509.68	4,853,219.95	10,408,729.63
基金赎回款	-11,213,465.19	-10,909,418.08	-22,122,883.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,873,232.47	28,148,584.87	46,021,817.34

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	54.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,747.19
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,801.65

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	688,235,392.98
减：卖出股票成本总额	622,061,451.56
减：交易费用	523,046.91
买卖股票差价收入	65,650,894.51

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	114,796.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,292.56
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	116,088.85

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	34,104,969.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,704,524.44
减：应计利息总额	399,152.05
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	1,292.56

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.14 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	497,101.20
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	497,101.20

6.4.7.15 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	111,402,107.68
股票投资	111,408,258.24
债券投资	-6,150.56
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	111,402,107.68

6.4.7.16 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	20,603.09
基金转换费收入	1.51
合计	20,604.60

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,442.81
账户维护费	9,000.00
存托服务费	131.92
合计	92,958.49

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	1,061,213.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	422,709.59
应支付基金管理人的净管理费	638,503.67

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

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
当期发生的基金应支付的托管费	212,242.67

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧上证科创板综合 指数 A	中欧上证科创板综合 指数 C	合计
国都证券	—	61.91	61.91
中国工商银行股份有限公司	—	36,008.04	36,008.04
中欧财富	—	222.32	222.32
合计	—	36,292.27	36,292.27

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.25%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期，基金管理人均未运用固有资金投资本基金各类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金各类基金份额。

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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	845,204.78	54.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

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	610	6,819.80	10,729.90	-
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	72	2,411.28	2,442.96	-
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	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	845	19,164.60	40,230.45	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-

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	103	8,433.64	163,185.99	-
688811	有研新材	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	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,659	15,710.73	116,362.26	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	622	12,240.96	88,006.78	-

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	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	5,096	1,241,841.71	4,482,084.88	-
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	2,277	68,417.20	327,888.00	-
688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	6,799	86,158.45	44,057.52	-

		日			日					
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--	--

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

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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

本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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，有效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制的投资品种比例等。本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款

主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,101,868.36	-	-	-	10,101,868.36
交易性金融资产	5,974,490.33	-	-	-282,934,232.07	288,908,722.40
应收申购款	-	-	-	1,221,785.69	1,221,785.69
资产总计	16,076,358.69	-	-	-284,156,017.76	300,232,376.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,040,247.39	2,040,247.39
应付管理人报酬	-	-	-	114,834.32	114,834.32
应付托管费	-	-	-	22,966.91	22,966.91
应付销售服务费	-	-	-	26,830.55	26,830.55
其他负债	-	-	-	81,081.85	81,081.85
负债总计	-	-	-	2,285,961.02	2,285,961.02
利率敏感度缺口	16,076,358.69	-	-	-281,870,056.74	297,946,415.43
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	11,433,881.08	-	-	-	11,433,881.08
交易性金融资产	31,919,047.45	-	-	-765,118,146.56	797,037,194.01
应收申购款	-	-	-	106,886.92	106,886.92
资产总计	43,352,928.53	-	-	-765,225,033.48	808,577,962.01

负债					
应付赎回款	-	-	-	2,513,679.37	2,513,679.37
应付管理人报酬	-	-	-	340,199.28	340,199.28
应付托管费	-	-	-	68,039.86	68,039.86
应付销售服务费	-	-	-	47,983.21	47,983.21
其他负债	-	-	-	31,000.00	31,000.00
负债总计	-	-	-	3,000,901.72	3,000,901.72
利率敏感度缺口	43,352,928.53	-	-	-762,224,131.76	805,577,060.29

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 2.01%（2025 年 12 月 31 日：3.96%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		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	282,934,232.07	94.96	765,118,146.56	94.98
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	282,934,232.07	94.96	765,118,146.56	94.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	14,914,744.94	32,425,751.96
	业绩比较基准下降 5%	-14,914,744.94	-32,425,751.96

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	277,461,753.63	749,675,910.14
第二层次	10,828,520.73	46,637,111.13
第三层次	618,448.04	724,172.74

合计	288,908,722.40	797,037,194.01
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以报告期初为确认金融工具公允价值层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	282,934,232.07	94.24
	其中：股票	282,934,232.07	94.24
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,974,490.33	1.99
	其中：债券	5,974,490.33	1.99
	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	10,101,868.36	3.36
8	其他各项资产	1,221,785.69	0.41
9	合计	300,232,376.45	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	229,131,618.93	76.90
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	48,261,699.48	16.20
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	4,104,250.63	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	817,181.58	0.27
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	282,314,750.62	94.75

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	619,481.45	0.21
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	619,481.45	0.21

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所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	11,553	18,433,389.15	6.19
2	688041	海光信息	43,155	15,980,296.50	5.36
3	688012	中微公司	17,394	8,149,089.00	2.74
4	688008	澜起科技	21,208	6,572,359.20	2.21
5	688802	沐曦股份	7,518	6,227,159.40	2.09
6	688795	摩尔线程	8,684	6,221,999.16	2.09
7	688981	中芯国际	37,116	5,894,763.12	1.98
8	688498	源杰科技	2,399	4,524,514.00	1.52
9	688072	拓荆科技	5,096	4,482,084.88	1.50
10	688525	佰维存储	8,563	4,236,372.99	1.42
11	688082	盛美上海	8,958	3,869,856.00	1.30
12	688521	芯原股份	9,767	3,624,924.38	1.22
13	688146	中船特气	10,173	3,560,448.27	1.19
14	688702	盛科通信	7,676	2,993,563.24	1.00
15	688120	华海清科	9,182	2,958,256.76	0.99
16	688361	中科飞测	6,498	2,794,140.00	0.94
17	688347	华虹宏力	7,571	2,546,127.30	0.85

18	688126	沪硅产业	62,331	2,486,383.59	0.83
19	688396	华润微	24,672	2,406,753.60	0.81
20	688506	百利天恒	7,626	2,242,272.78	0.75
21	688172	燕东微	26,518	2,218,495.88	0.74
22	688249	晶合集成	37,257	2,199,280.71	0.74
23	688766	普冉股份	2,786	2,135,747.60	0.72
24	688183	生益电子	15,435	2,043,594.00	0.69
25	688200	华峰测控	3,677	1,930,792.70	0.65
26	688111	金山办公	8,614	1,835,212.70	0.62
27	688777	中控技术	14,868	1,746,990.00	0.59
28	688409	富创精密	5,690	1,742,562.50	0.58
29	688048	长光华芯	3,316	1,664,632.00	0.56
30	688037	芯源微	3,743	1,643,364.15	0.55
31	688110	东芯股份	8,063	1,642,433.10	0.55
32	688469	芯联集成	152,976	1,623,075.36	0.54
33	688629	华丰科技	8,555	1,604,148.05	0.54
34	688519	南亚新材	4,182	1,589,327.28	0.53
35	688271	联影医疗	15,474	1,566,433.02	0.53
36	688313	仕佳光子	8,397	1,550,506.05	0.52
37	688147	微导纳米	8,627	1,396,538.76	0.47
38	688019	安集科技	4,088	1,387,712.48	0.47
39	688234	天岳先进	7,984	1,385,303.84	0.46
40	688017	绿的谐波	3,288	1,373,923.68	0.46
41	688002	睿创微纳	8,754	1,354,156.26	0.45
42	688548	广钢气体	24,886	1,296,560.60	0.44
43	688036	传音控股	21,692	1,278,743.40	0.43
44	688630	芯碁微装	2,296	1,261,399.44	0.42
45	688141	杰华特	8,172	1,254,402.00	0.42
46	688387	信科移动	62,758	1,245,118.72	0.42
47	688585	上纬新材	7,453	1,235,707.40	0.41
48	688375	国博电子	11,053	1,152,827.90	0.39
49	688047	龙芯中科	7,441	1,150,899.47	0.39
50	688627	精智达	1,570	1,122,550.00	0.38
51	688187	时代电气	16,304	1,119,432.64	0.38
52	688300	联瑞新材	4,510	1,102,244.00	0.37
53	688775	影石创新	7,616	1,055,958.40	0.35
54	688728	格科微	48,240	1,014,969.60	0.34
55	688295	中复神鹰	16,710	1,011,623.40	0.34
56	688549	中巨芯	27,410	1,008,962.10	0.34
57	688322	奥比中光	7,438	971,030.90	0.33
58	688220	翱捷科技	7,730	960,993.60	0.32
59	688411	海博思创	3,273	953,097.60	0.32
60	688432	有研硅	23,615	943,891.55	0.32

61	688668	鼎通科技	2,495	931,383.50	0.31
62	688027	国盾量子	1,842	928,386.42	0.31
63	688223	晶科能源	193,900	921,025.00	0.31
64	688536	思瑞浦	2,476	901,486.84	0.30
65	688336	三生国健	16,868	895,690.80	0.30
66	688545	兴福电子	6,690	890,171.40	0.30
67	688578	艾力斯	8,134	888,232.80	0.30
68	688331	荣昌生物	6,558	854,245.08	0.29
69	688025	杰普特	1,810	850,700.00	0.29
70	688099	晶晨股份	7,867	809,514.30	0.27
71	688362	甬矽电子	8,397	809,470.80	0.27
72	688167	炬光科技	2,271	804,410.91	0.27
73	688368	晶丰明源	3,694	799,824.88	0.27
74	688213	思特威	7,438	796,386.66	0.27
75	688052	纳芯微	2,710	781,320.10	0.26
76	688009	中国通号	162,887	775,342.12	0.26
77	688188	柏楚电子	7,258	774,428.60	0.26
78	688122	西部超导	12,174	764,648.94	0.26
79	688001	华兴源创	8,706	746,104.20	0.25
80	688472	阿特斯	68,841	744,859.62	0.25
81	688502	茂莱光学	1,067	740,071.20	0.25
82	688127	蓝特光学	7,494	731,414.40	0.25
83	688248	南网科技	10,286	711,585.48	0.24
84	688385	复旦微电	9,946	709,050.34	0.24
85	688403	汇成股份	17,853	708,764.10	0.24
86	688449	联芸科技	8,191	706,965.21	0.24
87	688303	大全能源	40,376	703,753.68	0.24
88	688676	金盘科技	8,251	698,364.64	0.23
89	688102	斯瑞新材	14,652	691,281.36	0.23
90	688233	神工股份	3,164	678,424.88	0.23
91	688538	和辉光电	260,436	677,133.60	0.23
92	688257	新锐股份	6,555	667,954.50	0.22
93	688301	奕瑞科技	5,301	657,324.00	0.22
94	688065	凯赛生物	13,570	649,324.50	0.22
95	688268	华特气体	2,418	646,815.00	0.22
96	688123	聚辰股份	3,029	643,965.40	0.22
97	688433	华曙高科	7,425	635,580.00	0.21
98	688205	德科立	3,030	630,815.70	0.21
99	688568	中科星图	15,160	628,685.20	0.21
100	688599	天合光能	44,213	624,287.56	0.21
101	688195	腾景科技	3,239	623,766.62	0.21
102	688652	京仪装备	3,076	615,722.92	0.21
103	688400	凌云光	9,009	596,395.80	0.20

104	688503	聚和材料	4,348	576,979.60	0.19
105	688266	泽璟制药	4,923	574,317.18	0.19
106	688372	伟测科技	3,020	561,720.00	0.19
107	688235	百济神州	2,195	558,868.95	0.19
108	688308	欧科亿	3,017	548,520.77	0.18
109	688531	日联科技	3,081	547,925.04	0.18
110	688343	云天励飞	6,590	538,139.40	0.18
111	688018	乐鑫科技	4,194	536,496.48	0.18
112	688352	顾中科技	22,095	534,257.10	0.18
113	688692	达梦数据	2,182	533,040.78	0.18
114	689009	九号公司	13,755	524,753.25	0.18
115	688297	中无人机	12,587	522,989.85	0.18
116	688333	铂力特	5,092	521,420.80	0.18
117	688388	嘉元科技	11,837	520,828.00	0.17
118	688097	博众精工	8,242	519,658.10	0.17
119	688778	厦钨新能	9,391	510,870.40	0.17
120	688150	莱特光电	7,441	510,601.42	0.17
121	688608	恒玄科技	3,020	504,913.80	0.17
122	688332	中科蓝讯	3,197	503,527.50	0.17
123	688392	骄成超声	2,204	500,704.72	0.17
124	688757	胜科纳米	7,471	498,315.70	0.17
125	688390	固德威	4,577	496,650.27	0.17
126	688800	瑞可达	5,141	493,381.77	0.17
127	688617	惠泰医疗	2,693	488,941.08	0.16
128	688380	中微半导	7,416	488,788.56	0.16
129	688180	君实生物	14,388	486,602.16	0.16
130	688582	芯动联科	7,476	485,940.00	0.16
131	688535	华海诚科	2,562	479,094.00	0.16
132	688700	东威科技	5,335	476,949.00	0.16
133	688318	财富趋势	6,615	471,715.65	0.16
134	688603	天承科技	2,232	464,144.40	0.16
135	688003	天准科技	3,625	461,462.50	0.15
136	688349	三一重能	29,956	454,732.08	0.15
137	688709	成都华微	11,813	449,957.17	0.15
138	688484	南芯科技	7,957	449,490.93	0.15
139	688584	上海合晶	12,499	449,339.05	0.15
140	688028	沃尔德	2,865	446,567.55	0.15
141	688661	和林微纳	2,789	443,395.22	0.15
142	688169	石头科技	4,642	440,850.74	0.15
143	688507	索辰科技	1,600	431,488.00	0.14
144	688563	航材股份	8,305	425,465.15	0.14
145	688596	正帆科技	5,282	417,594.92	0.14
146	688106	金宏气体	10,009	415,173.32	0.14

147	688278	特宝生物	7,574	412,025.60	0.14
148	688005	容百科技	13,421	410,682.60	0.14
149	688772	珠海冠宇	20,898	410,227.74	0.14
150	688819	天能股份	18,323	406,770.60	0.14
151	688143	长盈通	2,312	406,634.56	0.14
152	688475	萤石网络	14,790	404,506.50	0.14
153	688425	铁建重工	100,433	403,740.66	0.14
154	688006	杭可科技	11,004	402,196.20	0.13
155	688615	合合信息	3,519	397,998.90	0.13
156	688625	呈和科技	4,714	397,908.74	0.13
157	688523	航天环宇	7,565	396,406.00	0.13
158	688726	拉普拉斯	7,495	396,110.75	0.13
159	688114	华大智造	7,754	396,074.32	0.13
160	688686	奥普特	2,335	393,190.65	0.13
161	688359	三孚新科	1,962	389,339.28	0.13
162	688605	先锋精科	3,742	389,242.84	0.13
163	688131	皓元医药	4,008	379,156.80	0.13
164	688279	峰昭科技	1,673	375,488.12	0.13
165	688559	海目星	4,431	371,849.52	0.12
166	688020	方邦股份	1,487	371,155.20	0.12
167	688515	裕太微	1,487	369,906.12	0.12
168	688708	佳驰科技	7,182	364,845.60	0.12
169	688055	龙腾光电	63,034	363,075.84	0.12
170	688281	华秦科技	7,116	357,436.68	0.12
171	688059	华锐精密	1,789	357,281.19	0.12
172	688610	埃科光电	1,355	356,907.00	0.12
173	688662	富信科技	2,068	347,424.00	0.12
174	688192	迪哲医药	8,653	345,514.29	0.12
175	688206	概伦电子	7,770	344,754.90	0.12
176	688516	奥特维	6,002	344,454.78	0.12
177	688383	新益昌	1,817	341,668.68	0.11
178	688107	安路科技	7,385	336,756.00	0.11
179	688353	华盛锂电	2,861	332,076.27	0.11
180	688319	欧林生物	7,485	329,190.30	0.11
181	688593	新相微	8,456	329,107.52	0.11
182	688260	昀冢科技	2,277	327,888.00	0.11
183	688690	纳微科技	7,379	325,413.90	0.11
184	688363	华熙生物	8,981	321,250.37	0.11
185	688401	路维光电	3,340	320,573.20	0.11
186	688182	灿勤科技	7,426	319,837.82	0.11
187	688208	道通科技	12,560	316,386.40	0.11
188	688798	艾为电子	4,186	306,917.52	0.10
189	688561	奇安信	12,781	306,488.38	0.10

190	688378	奥来德	4,925	305,350.00	0.10
191	688158	优刻得	8,238	302,828.88	0.10
192	688376	美埃科技	2,594	301,682.20	0.10
193	688520	神州细胞	8,785	300,534.85	0.10
194	688779	五矿新能	36,240	293,906.40	0.10
195	688275	万润新能	2,268	289,283.40	0.10
196	688090	瑞松科技	2,683	285,605.35	0.10
197	688100	威胜信息	9,154	280,020.86	0.09
198	688166	博瑞医药	7,970	279,029.70	0.09
199	688530	欧莱新材	2,854	276,552.60	0.09
200	688456	有研粉材	1,973	275,430.80	0.09
201	688416	恒烁股份	1,906	266,840.00	0.09
202	688088	虹软科技	7,450	264,847.50	0.09
203	688691	灿芯股份	2,284	264,784.12	0.09
204	688138	清溢光电	5,632	264,704.00	0.09
205	688262	国芯科技	6,110	264,135.30	0.09
206	688337	普源精电	3,470	260,007.10	0.09
207	688116	天奈科技	6,782	259,072.40	0.09
208	688258	卓易信息	2,177	258,061.58	0.09
209	688153	唯捷创芯	7,984	256,446.08	0.09
210	688717	艾罗能源	3,056	252,333.92	0.08
211	688031	星环科技	2,181	251,207.58	0.08
212	688035	德邦科技	2,714	249,145.20	0.08
213	688063	派能科技	4,624	246,320.48	0.08
214	688327	云从科技	19,640	244,714.40	0.08
215	688029	南微医学	3,370	241,966.00	0.08
216	688567	孚能科技	23,035	241,867.50	0.08
217	688125	安达智能	1,473	240,835.50	0.08
218	688371	菲沃泰	6,156	240,022.44	0.08
219	688381	帝奥微	4,464	238,824.00	0.08
220	688222	成都先导	7,386	237,164.46	0.08
221	688663	新风光	2,680	237,072.80	0.08
222	688720	艾森股份	2,343	236,643.00	0.08
223	688209	英集芯	8,066	234,559.28	0.08
224	688306	均普智能	23,162	233,936.20	0.08
225	688079	美迪凯	7,588	233,331.00	0.08
226	688198	佰仁医疗	2,611	233,005.64	0.08
227	688669	聚石化学	2,165	231,655.00	0.08
228	688261	东微半导	2,194	230,216.42	0.08
229	688612	威迈斯	7,758	229,559.22	0.08
230	688231	隆达股份	6,161	226,293.53	0.08
231	688312	燕麦科技	2,688	225,765.12	0.08
232	688112	鼎阳科技	3,053	224,273.38	0.08

233	688227	品高股份	2,147	220,475.43	0.07
234	688508	芯朋微	2,360	219,385.60	0.07
235	688677	海泰新光	2,140	216,418.20	0.07
236	688321	微芯生物	8,204	216,011.32	0.07
237	688660	电气风电	24,906	214,689.72	0.07
238	688486	龙迅股份	3,366	214,010.28	0.07
239	688325	赛微微电	1,635	213,220.35	0.07
240	688698	伟创电气	4,053	212,579.85	0.07
241	688628	优利德	2,148	212,523.12	0.07
242	688478	晶升股份	2,398	212,342.90	0.07
243	688239	航宇科技	3,542	211,917.86	0.07
244	688191	智洋创新	5,881	209,951.70	0.07
245	688611	杭州柯林	2,929	209,277.05	0.07
246	688062	迈威生物	7,390	208,767.50	0.07
247	688556	高测股份	15,392	204,405.76	0.07
248	688032	禾迈股份	2,354	198,960.08	0.07
249	688165	埃夫特	9,740	198,696.00	0.07
250	688351	微电生理	8,722	197,640.52	0.07
251	688160	步科股份	1,815	197,417.55	0.07
252	688083	中望软件	3,048	197,358.00	0.07
253	688016	心脉医疗	2,218	196,603.52	0.07
254	688382	益方生物	10,883	195,894.00	0.07
255	688202	美迪西	2,416	194,995.36	0.07
256	688190	云路股份	2,146	194,663.66	0.07
257	688598	金博股份	3,857	190,728.65	0.06
258	688583	思看科技	2,208	189,380.16	0.06
259	688518	联赢激光	6,120	189,108.00	0.06
260	688170	德龙激光	1,956	187,795.56	0.06
261	688179	阿拉丁	6,673	184,908.83	0.06
262	688093	世华科技	5,005	184,684.50	0.06
263	688155	先惠技术	2,266	183,296.74	0.06
264	688252	天德钰	7,610	182,640.00	0.06
265	688046	药康生物	7,546	182,613.20	0.06
266	688678	福立旺	7,459	180,284.03	0.06
267	688550	瑞联新材	3,110	179,913.50	0.06
268	688323	瑞华泰	3,183	179,839.50	0.06
269	688543	国科军工	4,522	178,392.90	0.06
270	688128	中国电研	7,510	178,287.40	0.06
271	688689	银河微电	2,751	178,044.72	0.06
272	688485	九州一轨	2,761	176,869.66	0.06
273	688788	科思科技	3,908	175,781.84	0.06
274	688710	益诺思	2,614	175,660.80	0.06
275	688699	明微电子	2,142	175,536.90	0.06

276	688135	利扬芯片	4,151	174,674.08	0.06
277	688439	振华风光	3,780	174,636.00	0.06
278	688711	宏微科技	3,833	174,209.85	0.06
279	688586	江航装备	14,707	171,924.83	0.06
280	688386	泛亚微透	1,904	171,055.36	0.06
281	688552	航天南湖	6,054	170,299.02	0.06
282	688758	赛分科技	7,733	170,203.33	0.06
283	688789	宏华数科	3,146	167,272.82	0.06
284	688328	深科达	1,745	166,996.50	0.06
285	688307	中润光学	2,085	166,695.75	0.06
286	688230	芯导科技	2,101	165,579.81	0.06
287	688418	震有科技	3,442	165,491.36	0.06
288	688091	上海谊众	4,105	165,021.00	0.06
289	688697	纽威数控	12,015	163,283.85	0.05
290	688068	热景生物	1,868	161,768.80	0.05
291	688787	海天瑞声	1,203	161,743.35	0.05
292	688419	耐科装备	2,041	160,524.65	0.05
293	688499	利元亨	3,051	160,330.05	0.05
294	688719	爱科赛博	2,081	160,237.00	0.05
295	688181	八亿时空	2,556	160,005.60	0.05
296	688105	诺唯赞	9,190	159,446.50	0.05
297	688443	智翔金泰	6,824	158,658.00	0.05
298	688289	圣湘生物	10,841	156,110.40	0.05
299	688161	威高骨科	7,433	155,944.34	0.05
300	688305	科德数控	2,379	155,277.33	0.05
301	688226	威腾电气	3,622	155,130.26	0.05
302	688522	纳睿雷达	7,655	153,253.10	0.05
303	688221	前沿生物	6,838	153,171.20	0.05
304	688326	经纬恒润	2,147	152,179.36	0.05
305	688739	成大生物	7,746	150,969.54	0.05
306	688693	锆威特	1,448	150,519.60	0.05
307	688591	泰凌微	4,365	150,068.70	0.05
308	688139	海尔生物	5,671	149,827.82	0.05
309	688253	英诺特	2,473	149,072.44	0.05
310	688480	赛恩斯	1,701	148,990.59	0.05
311	688733	壹石通	3,582	148,115.70	0.05
312	688049	炬芯科技	3,113	146,030.83	0.05
313	688667	菱电电控	1,089	145,544.85	0.05
314	688277	天智航	8,494	145,247.40	0.05
315	688479	友车科技	3,810	144,665.70	0.05
316	688601	力芯微	2,386	144,472.30	0.05
317	688108	赛诺医疗	7,754	143,681.62	0.05
318	688379	华光新材	1,706	143,355.18	0.05

319	688173	希荻微	7,483	143,224.62	0.05
320	688786	悦安新材	3,081	141,972.48	0.05
321	688750	金天钛业	8,526	141,787.38	0.05
322	688721	龙图光罩	2,415	140,987.70	0.05
323	688010	福光股份	2,891	140,589.33	0.05
324	688168	安博通	2,029	139,493.75	0.05
325	688513	苑东生物	3,167	139,221.32	0.05
326	688512	慧智微	8,661	138,316.17	0.05
327	688428	诺诚健华	4,839	137,766.33	0.05
328	688631	莱斯信息	2,935	137,680.85	0.05
329	688653	康希通信	7,876	136,884.88	0.05
330	688685	迈信林	2,467	135,438.30	0.05
331	688103	国力电子	1,802	134,086.82	0.05
332	688219	会通股份	10,272	132,919.68	0.04
333	688177	百奥泰	7,859	132,188.38	0.04
334	688011	新光光电	1,886	131,774.82	0.04
335	688286	敏芯股份	1,135	130,604.45	0.04
336	688551	科威尔	1,838	129,156.26	0.04
337	688577	浙海德曼	2,799	128,278.17	0.04
338	688626	翔宇医疗	2,877	127,336.02	0.04
339	688655	迅捷兴	2,377	127,312.12	0.04
340	688290	景业智能	1,905	126,415.80	0.04
341	688050	爱博医疗	3,458	126,044.10	0.04
342	688656	浩欧博	1,298	125,607.46	0.04
343	688408	中信博	3,871	124,452.65	0.04
344	688553	汇宇制药	11,673	124,083.99	0.04
345	688365	光云科技	7,851	123,810.27	0.04
346	688218	江苏北人	2,227	122,395.92	0.04
347	688707	振华新材	9,418	121,021.30	0.04
348	688776	国光电气	1,951	119,674.34	0.04
349	688595	芯海科技	2,713	118,992.18	0.04
350	688623	双元科技	1,176	118,140.96	0.04
351	688620	安凯微	7,287	118,049.40	0.04
352	688665	四方光电	1,796	117,997.20	0.04
353	688210	统联精密	2,890	117,073.90	0.04
354	688683	莱尔科技	3,071	116,452.32	0.04
355	688087	英科再生	3,465	115,800.30	0.04
356	688320	禾川科技	2,784	115,396.80	0.04
357	688570	天玛智控	8,096	115,206.08	0.04
358	688562	航天软件	7,595	114,380.70	0.04
359	688448	磁谷科技	1,798	114,280.88	0.04
360	688799	华纳药厂	2,540	113,969.80	0.04
361	688345	博力威	1,960	113,836.80	0.04

362	688007	光峰科技	8,559	113,834.70	0.04
363	688109	品茗科技	1,503	113,777.10	0.04
364	688636	智明达	3,117	112,928.91	0.04
365	688539	高华科技	3,517	112,121.96	0.04
366	688621	阳光诺和	2,022	111,028.02	0.04
367	688510	航亚科技	4,634	110,659.92	0.04
368	688293	奥浦迈	2,640	110,061.60	0.04
369	688658	悦康药业	8,424	108,332.64	0.04
370	688061	灿瑞科技	2,168	107,684.56	0.04
371	688609	九联科技	9,718	106,995.18	0.04
372	688334	西高院	5,894	106,917.16	0.04
373	688291	金橙子	1,822	106,550.56	0.04
374	688176	亚虹医药	10,717	106,312.64	0.04
375	688117	圣诺生物	3,927	106,146.81	0.04
376	688069	德林海	2,810	104,981.60	0.04
377	688526	科前生物	8,627	104,386.70	0.04
378	688095	福昕软件	1,751	104,061.93	0.03
379	688276	百克生物	7,440	103,713.60	0.03
380	688185	康希诺	2,032	103,611.68	0.03
381	688115	思林杰	1,257	103,388.25	0.03
382	688199	久日新材	2,992	103,313.76	0.03
383	688282	理工导航	1,764	102,664.80	0.03
384	688232	新点软件	5,758	102,377.24	0.03
385	688045	必易微	1,265	102,186.70	0.03
386	688101	三达膜	6,148	101,626.44	0.03
387	688073	毕得医药	1,876	100,966.32	0.03
388	688197	首药控股	2,999	100,196.59	0.03
389	688163	赛伦生物	2,052	100,158.12	0.03
390	688488	艾迪药业	7,789	100,088.65	0.03
391	688119	中钢洛耐	21,051	99,992.25	0.03
392	688366	昊海生科	3,460	99,890.20	0.03
393	688679	通源环境	2,343	98,616.87	0.03
394	688315	诺禾致源	7,839	98,065.89	0.03
395	688348	昱能科技	2,819	98,044.82	0.03
396	688377	迪威尔	4,154	97,951.32	0.03
397	688767	博拓生物	3,011	97,887.61	0.03
398	688566	吉贝尔	3,804	97,344.36	0.03
399	688505	复旦张江	13,141	96,980.58	0.03
400	688309	恒誉环保	1,580	96,190.40	0.03
401	688151	华强科技	6,415	95,391.05	0.03
402	688356	键凯科技	1,227	94,577.16	0.03
403	688207	格灵深瞳	4,683	94,128.30	0.03
404	688575	亚辉龙	10,717	93,880.92	0.03

405	688228	开普云	1,213	93,813.42	0.03
406	688633	星球石墨	3,149	93,619.77	0.03
407	688237	超卓航科	1,715	91,615.30	0.03
408	688225	亚信安全	7,357	91,373.94	0.03
409	688607	康众医疗	1,782	90,882.00	0.03
410	688458	美芯晟	2,174	90,786.24	0.03
411	688216	气派科技	2,160	90,741.60	0.03
412	688580	伟思医疗	1,695	90,292.65	0.03
413	688450	光格科技	1,332	89,230.68	0.03
414	688350	富淼科技	2,571	88,776.63	0.03
415	688648	中邮科技	2,423	88,560.65	0.03
416	688196	卓越新能	2,443	87,703.70	0.03
417	688299	长阳科技	5,224	87,293.04	0.03
418	688768	容知日新	1,689	87,051.06	0.03
419	688056	莱伯泰科	1,346	86,884.30	0.03
420	688259	创耀科技	2,185	85,477.20	0.03
421	688360	德马科技	4,754	85,096.60	0.03
422	688330	宏力达	2,495	84,405.85	0.03
423	688581	安杰思	1,604	82,942.84	0.03
424	688159	有方科技	1,859	82,521.01	0.03
425	688410	山外山	5,708	81,966.88	0.03
426	688398	赛特新材	3,155	81,746.05	0.03
427	688696	极米科技	1,266	81,707.64	0.03
428	688267	中触媒	4,136	81,479.20	0.03
429	688085	三友医疗	6,786	81,228.42	0.03
430	688081	兴图新科	1,985	81,146.80	0.03
431	688148	芳源股份	9,427	80,883.66	0.03
432	688639	华恒生物	5,011	80,877.54	0.03
433	688311	盟升电子	3,070	80,403.30	0.03
434	688211	中科微至	2,331	80,233.02	0.03
435	688600	皖仪科技	2,386	79,406.08	0.03
436	688269	凯立新材	2,496	79,148.16	0.03
437	688136	科兴制药	3,762	77,911.02	0.03
438	688680	海优新材	1,840	77,280.00	0.03
439	688212	澳华内镜	2,625	77,175.00	0.03
440	688558	国盛智科	2,331	76,596.66	0.03
441	688283	坤恒顺维	2,311	76,517.21	0.03
442	688175	高凌信息	3,016	75,852.40	0.03
443	688602	康鹏科技	9,625	75,845.00	0.03
444	688399	硕世生物	1,670	75,801.30	0.03
445	688057	金达莱	4,885	75,277.85	0.03
446	688682	霍莱沃	1,934	75,232.60	0.03
447	688389	普门科技	7,682	75,206.78	0.03

448	688186	广大特材	4,948	74,962.20	0.03
449	688459	哈铁科技	8,958	74,620.14	0.03
450	688157	松井股份	2,823	74,498.97	0.03
451	688511	天微电子	2,465	74,467.65	0.02
452	688273	麦澜德	1,912	74,070.88	0.02
453	688429	时创能源	7,265	74,030.35	0.02
454	688236	春立医疗	5,094	73,659.24	0.02
455	688391	钜泉科技	2,049	73,497.63	0.02
456	688039	当虹科技	1,964	73,296.48	0.02
457	688075	安旭生物	2,457	73,120.32	0.02
458	688716	中研股份	2,311	72,634.73	0.02
459	688084	晶品特装	1,439	72,352.92	0.02
460	688215	瑞晟智能	1,775	71,284.00	0.02
461	688590	新致软件	5,654	70,279.22	0.02
462	688339	亿华通	3,721	69,582.70	0.02
463	688171	纬德信息	1,577	69,324.92	0.02
464	688489	三未信安	2,999	68,077.30	0.02
465	688272	富吉瑞	1,514	67,221.60	0.02
466	688588	凌志软件	7,345	66,766.05	0.02
467	688657	浩辰软件	1,866	66,746.82	0.02
468	688571	杭华股份	7,620	66,675.00	0.02
469	688023	安恒信息	1,801	66,132.72	0.02
470	688238	和元生物	12,196	66,102.32	0.02
471	688133	泰坦科技	3,105	65,608.65	0.02
472	688302	海创药业	1,861	65,451.37	0.02
473	688592	司南导航	1,577	65,350.88	0.02
474	688247	宣泰医药	8,683	65,296.16	0.02
475	688618	三旺通信	2,118	65,170.86	0.02
476	688569	铁科轨道	4,025	65,003.75	0.02
477	688500	慧辰股份	1,424	64,549.92	0.02
478	688298	东方生物	3,614	64,546.04	0.02
479	688335	复洁科技	2,683	64,499.32	0.02
480	688130	晶华微	2,293	64,479.16	0.02
481	688098	申联生物	7,487	64,313.33	0.02
482	688070	纵横股份	1,698	63,386.34	0.02
483	688080	映翰通	1,460	63,145.00	0.02
484	688533	上声电子	3,010	62,788.60	0.02
485	688557	兰剑智能	2,009	62,339.27	0.02
486	688722	同益中	4,052	61,468.84	0.02
487	688606	奥泰生物	1,490	61,209.20	0.02
488	688358	祥生医疗	1,999	61,109.43	0.02
489	688509	正元地信	14,253	61,002.84	0.02
490	688071	华依科技	1,666	60,709.04	0.02

491	688229	博睿数据	783	60,056.10	0.02
492	688280	精进电动	10,914	59,917.86	0.02
493	688755	汉邦科技	2,165	59,667.40	0.02
494	688589	力合微	2,574	59,150.52	0.02
495	688162	巨一科技	2,495	58,981.80	0.02
496	688077	大地熊	2,166	57,377.34	0.02
497	688338	赛科希德	1,944	57,367.44	0.02
498	688129	东来技术	2,176	56,989.44	0.02
499	688455	科捷智能	3,017	56,297.22	0.02
500	688373	盟科药业	12,410	56,217.30	0.02
501	688671	碧兴物联	1,572	55,916.04	0.02
502	688255	凯尔达	2,011	55,905.80	0.02
503	688370	丛麟科技	2,650	55,438.00	0.02
504	688096	京源环保	4,147	55,403.92	0.02
505	688619	罗普特	3,387	54,971.01	0.02
506	688357	建龙微纳	1,862	54,873.14	0.02
507	688156	路德科技	1,808	54,692.00	0.02
508	688015	交控科技	3,533	54,337.54	0.02
509	688579	地纬智能	7,142	54,207.78	0.02
510	688178	万德斯	1,601	54,129.81	0.02
511	688152	麒麟信安	1,945	53,448.60	0.02
512	688030	山石网科	3,381	53,385.99	0.02
513	688265	南模生物	1,530	52,922.70	0.02
514	688246	嘉和美康	2,572	52,854.60	0.02
515	688292	浩瀚深度	2,837	52,768.20	0.02
516	688314	康拓医疗	1,549	52,480.12	0.02
517	688367	工大高科	1,567	52,181.10	0.02
518	688317	之江生物	3,410	51,832.00	0.02
519	688251	井松智能	1,981	50,773.03	0.02
520	688435	英方软件	1,583	50,656.00	0.02
521	688285	高铁电气	7,000	50,190.00	0.02
522	688316	青云科技	919	49,626.00	0.02
523	688687	凯因科技	3,015	49,174.65	0.02
524	688718	唯赛勃	3,045	48,628.65	0.02
525	688576	西山科技	1,198	47,740.30	0.02
526	688529	豪森智能	3,026	47,598.98	0.02
527	688651	盛邦安全	1,473	47,460.06	0.02
528	688310	迈得医疗	3,066	47,124.42	0.02
529	688137	近岸蛋白	1,278	46,008.00	0.02
530	688369	致远互联	2,179	45,780.79	0.02
531	688737	中自科技	2,386	45,668.04	0.02
532	688355	明志科技	2,330	44,852.50	0.02
533	688121	*ST 卓然	6,799	44,057.52	0.01

534	688468	科美诊断	7,621	43,363.49	0.01
535	688560	明冠新材	3,658	43,347.30	0.01
536	688193	仁度生物	781	43,189.30	0.01
537	688517	金冠电气	2,424	42,371.52	0.01
538	688501	DR 青达环	2,190	42,048.00	0.01
539	688026	洁特生物	2,629	41,301.59	0.01
540	688244	永信至诚	2,871	40,940.46	0.01
541	688113	联测科技	1,150	40,365.00	0.01
542	688013	天臣医疗	1,630	40,212.10	0.01
543	688597	煜邦电力	6,108	39,702.00	0.01
544	688060	云涌科技	1,199	39,435.11	0.01
545	688426	康为世纪	2,108	38,660.72	0.01
546	688420	美腾科技	1,821	38,368.47	0.01
547	688613	XD 奥精医	2,667	37,631.37	0.01
548	688132	邦彦技术	2,809	36,938.35	0.01
549	688670	金迪克	2,167	36,708.98	0.01
550	688203	海正生材	3,608	36,007.84	0.01
551	688638	誉辰智能	1,145	35,689.65	0.01
552	688038	中科通达	2,117	35,607.94	0.01
553	688092	爱科科技	1,653	35,109.72	0.01
554	688616	西力科技	3,453	34,875.30	0.01
555	688573	信宇人	1,904	33,738.88	0.01
556	688395	正弦电气	1,526	33,724.60	0.01
557	688288	鸿泉技术	1,890	33,585.30	0.01
558	688118	普元信息	1,661	33,419.32	0.01
559	688329	艾隆科技	1,611	32,558.31	0.01
560	688051	佳华科技	1,370	31,482.60	0.01
561	688058	宝兰德	1,489	31,149.88	0.01
562	688089	ST 嘉必优	2,925	31,034.25	0.01
563	688466	金科环境	2,414	30,971.62	0.01
564	688659	元琛科技	2,907	30,349.08	0.01
565	688393	安必平	1,647	29,283.66	0.01
566	688695	中创股份	1,538	28,760.60	0.01
567	688078	龙软科技	1,351	28,438.55	0.01
568	688565	力源科技	2,830	26,743.50	0.01
569	688681	科汇股份	1,899	26,548.02	0.01
570	688528	秦川物联	2,902	26,524.28	0.01
571	688021	奥福科技	1,336	25,864.96	0.01
572	688004	博汇科技	1,410	25,662.00	0.01
573	688793	倍轻松	1,570	25,292.70	0.01
574	688067	爱威科技	1,197	24,119.55	0.01
575	688217	睿昂基因	1,095	22,622.70	0.01
576	688296	和达科技	1,865	21,335.60	0.01

577	688701	卓锦股份	2,286	17,213.58	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	103	163,185.99	0.05
2	688818	电科蓝天	1,659	116,362.26	0.04
3	688820	盛合晶微	622	88,006.78	0.03
4	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.02
5	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.02
6	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
7	688781	视涯科技	845	40,230.45	0.01
8	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
9	601112	振石股份	610	10,729.90	0.00
10	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
11	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
12	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
13	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
14	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
15	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
16	603248	锡华科技	49	1,033.41	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	10,537,328.57	1.31
2	688802	沐曦股份	8,488,385.27	1.05
3	688411	海博思创	1,569,118.23	0.19
4	688256	寒武纪	1,310,762.21	0.16
5	688545	兴福电子	812,247.16	0.10
6	688757	胜科纳米	526,417.11	0.07
7	688583	思看科技	495,043.40	0.06
8	688041	海光信息	391,056.12	0.05
9	688758	赛分科技	294,386.27	0.04
10	688525	佰维存储	243,320.75	0.03
11	688506	百利天恒	232,835.12	0.03
12	688981	中芯国际	192,283.63	0.02
13	688172	燕东微	163,808.83	0.02
14	688818	电科蓝天	157,069.42	0.02
15	688248	南网科技	152,835.92	0.02
16	688361	中科飞测	135,256.90	0.02
17	688082	盛美上海	125,629.92	0.02
18	688820	盛合晶微	122,291.52	0.02

19	688012	中微公司	120,089.12	0.01
20	688047	龙芯中科	119,148.12	0.01

注：买入金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。

7.4.2 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	688256	寒武纪	39,714,841.14	4.93
2	688041	海光信息	38,342,752.31	4.76
3	688981	中芯国际	15,510,241.28	1.93
4	688012	中微公司	14,462,302.19	1.80
5	688008	澜起科技	11,338,033.56	1.41
6	688111	金山办公	9,032,048.25	1.12
7	688506	百利天恒	8,109,084.96	1.01
8	688072	拓荆科技	7,084,739.13	0.88
9	688521	芯原股份	6,918,300.83	0.86
10	688795	摩尔线程	6,689,497.96	0.83
11	688271	联影医疗	6,631,496.15	0.82
12	688525	佰维存储	5,880,744.95	0.73
13	688082	盛美上海	5,844,257.57	0.73
14	688802	沐曦股份	5,785,626.41	0.72
15	688775	影石创新	5,608,302.58	0.70
16	688498	源杰科技	5,247,446.74	0.65
17	688183	生益电子	5,247,000.81	0.65
18	688396	华润微	4,914,169.72	0.61
19	688375	国博电子	4,663,707.78	0.58
20	688249	晶合集成	4,515,490.64	0.56

注：卖出金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。

7.4.3 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	28,469,278.83
卖出股票收入（成交）总额	688,235,392.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,974,490.33	2.01
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,974,490.33	2.01

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	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	59,000	5,974,490.33	2.01

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

基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

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

基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,221,785.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,221,785.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	4,482,084.88	1.50	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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688808	联讯仪器	163,185.99	0.05	新股流通受限
2	688818	电科蓝天	116,362.26	0.04	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	88,006.78	0.03	新股流通受限
4	688712	北芯生命	53,880.00	0.02	新股流通受限
5	688785	恒运昌	53,725.40	0.02	新股流通受限

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧上证科创板综合指数 A	1,648	63,366.16	99,225.79	0.10%	104,328,200.09	99.90%
中欧上证科创板综合指数 C	15,192	6,469.80	0.00	0.00%	98,289,227.61	100.00%
合计	16,840	12,037.81	99,225.79	0.05%	202,617,427.70	99.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧上证科创板综合指数 A	0.00	0.00%
	中欧上证科创板综合指数 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧上证科创板综合指数 A	0
	中欧上证科创板综合指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧上证科创板综合指数 A	0
	中欧上证科创板综合指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧上证科创板综合指数 A	中欧上证科创板综合指数 C
基金合同生效日 (2025 年 9 月 9 日) 基金份额总额	760,861,717.75	301,017,165.44
本报告期期初基金份额总额	602,628,288.72	224,787,672.73
本报告期基金总申购	25,168,578.58	75,015,257.71

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	523,369,441.42	201,513,702.83
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	104,427,425.88	98,289,227.61

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东莞证券	3	715,710,324.98	100.00	133,075.26	100.00	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

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 (%)
东莞证券	27,355,422.69	100.00	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

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	中欧上证科创板综合指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22

3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
4	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
5	中欧上证科创板综合指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
6	中欧上证科创板综合指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
8	中欧上证科创板综合指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
9	中欧基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-06
10	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长盈通”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-19

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

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、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日