

泰信上证科创板综合指数增强型证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：泰信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	56

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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	60
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	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	泰信上证科创板综合指数增强	
基金主代码	025005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 27 日	
基金管理人	泰信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	64,010,136.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	泰信上证科创板综合指数增强 A	泰信上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	025005	025006
报告期末下属分级 基金的份额总额	15,033,937.38 份	48,976,198.93 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对上证科创板综合指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型产品，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。主要投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		泰信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘小舫	王茵
	联系电话	021-20899003	010-63639180
	电子邮箱	xxpl@ftfund.com	wangyin@cebbank.com

客户服务电话	400-888-5988	95595
传真	021-20899008	010-63639132
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36-37 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	李高峰	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ftfund.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	泰信基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 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	2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
据和指标	泰信上证科创板综合指数增强 A	泰信上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	3,055,848.07	13,904,100.01
本期利润	6,350,371.28	30,857,035.81
加权平均基金份额本期利润	0.2925	0.1945
本期加权平均净值利润率	28.00%	19.16%
本期基金份额净值增长率	37.66%	37.42%
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	2,707,451.03	8,719,723.06
期末可供分配基金份额利润	0.1801	0.1780

期末基金资产净值	20,695,484.96	67,304,265.30
期末基金份额净值	1.3766	1.3742
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	37.66%	37.42%

- 注：1、本基金基金合同于 2026 年 1 月 27 日正式生效。
- 2、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人申购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 4、期末可供分配利润是指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

泰信上证科创板综合指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	47.74%	2.08%	52.44%	2.24%	-4.70%	-0.16%
自基金合同生效起至今	37.66%	1.76%	33.81%	2.17%	3.85%	-0.41%

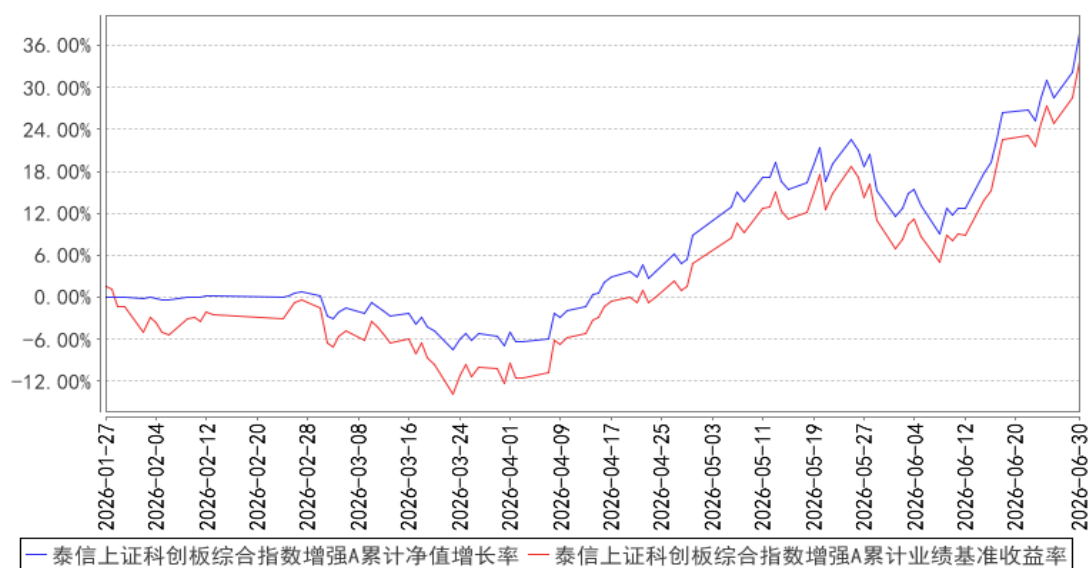
泰信上证科创板综合指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	47.57%	2.08%	52.44%	2.24%	-4.87%	-0.16%
自基金合同生效起至今	37.42%	1.76%	33.81%	2.17%	3.61%	-0.41%

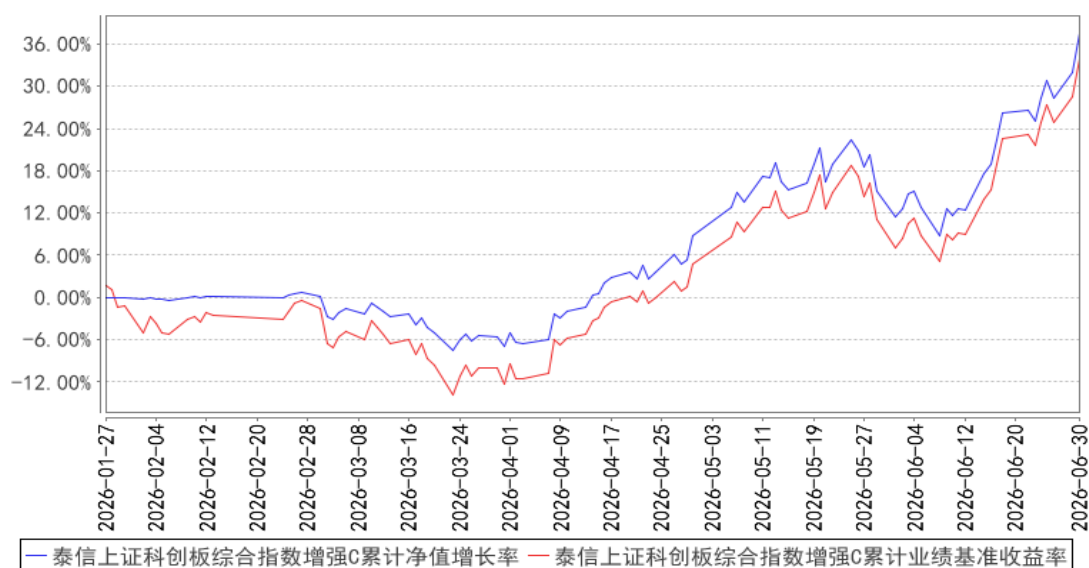
注：本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

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

泰信上证科创板综合指数增强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



泰信上证科创板综合指数增强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：1、本基金基金合同于 2026 年 1 月 27 日正式生效。截至本报告期末，本基金仍在建仓期。

2、本基金投资组合约定：本基金投资于股票、存托凭证的资产比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指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% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 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

基金管理人：泰信基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 37 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦东南路 256 号 36、37 层

成立日期：2003 年 5 月 23 日

法定代表人：李高峰

总经理：张秉麟

电话：021-20899188

传真：021-20899008

联系人：徐磊

发展沿革：

泰信基金管理有限公司（First-Trust Fund Management Co., Ltd.）是原山东省国际信托投资有限公司（现更名为山东省国际信托股份有限公司）联合江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信实业有限公司（现更名为青岛国信产融控股（集团）有限公司）共同发起设立的基金管理公司。公司于 2002 年 9 月 24 日经中国证券监督管理委员会批准正式筹建，2003 年 5 月 8 日获准开业，是“好人举手”制度下，获准筹建的第一家以信托公司为主发起人的基金管理公司。2021 年 9 月 2 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2021]2848 号文核准，山东省国际信托股份有限公司将其持有的 45%股权转让给山东省鲁信投资控股集团有限公司。目前，公司注册资本为 2 亿元人民币，股东为山东省鲁信投资控股集团有限公司、江苏省投资管理有限责任公司、青岛国信产融控股（集团）有限公司。截至 2026 年 6 月末，泰信基金管理有限公司旗下管理共计 40 只开放式基金及多个资产管理计划。

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		
张海涛	泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理、泰	2026 年 1 月 27 日	—	6 年	张海涛先生，研究生学历。曾任华夏基金管理有限公司资产配置部研究员，北京源峰私募基金管理合伙企业（有限合伙）研究部研究员。2024 年 9 月加入泰信基金管理有限公司，曾任基金经理助理兼研究

信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理、泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理、泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理、泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理、泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理、泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理、泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理				员，2025 年 1 月任泰信中证 200 指数证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信优势增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信双息双利债券型证券投资基金基金经理，2025 年 1 月任泰信鑫瑞债券型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月任泰信智选量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 10 月任泰信中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月任泰信中证全指自由现金流指数型证券投资基金基金经理，2026 年 1 月任上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，2026 年 4 月任泰信添瑞债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期分别指根据基金管理人决定确定的聘任日期和解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》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。本基金管理人在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金的投资运作符合有关法规和基金合同的规定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《泰信基金管理有限公司公平交易管理办法》以及《泰信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，基金经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易部集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现本基金与其他基金之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司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。本报告期内，本基金参与的交易所公开竞价同日反向交易，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况，亦无其他异常交易行为。

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

2026 年上半年，A 股市场呈现“指数繁荣、结构剧烈分化”的特征。主要指数震荡上行，市

场交投活跃，半年度总成交额创历史新高。收益高度集中于科技成长板块，AI 科技成为贯穿上半年的核心主线，半导体、光通信等硬件端强势领涨，相关行业指数涨幅显著领先；而大消费、商贸零售、地产链等传统板块持续承压。资金结构方面，大盘龙头股优势持续强化，中小市值品种则整体表现偏弱。总体而言，2026 年上半年 A 股市场科技成长大幅领跑，结构性牛市特征突出。这一格局深刻反映了宏观经济转型与新质生产力政策导向的叠加影响。

本基金将继续坚持系统化投资的运作思路，依托量化多因子模型开展投资决策，优选个股，同时适度保持分散和行业均衡。我们将勤勉尽责、持续打磨量化模型，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末泰信上证科创板综合指数增强 A 基金份额净值为 1.3766 元,本报告期基金份额净值增长率为 37.66%;截止本报告期末泰信上证科创板综合指数增强 C 基金份额净值为 1.3742 元,本报告期基金份额净值增长率为 37.42%;同期业绩比较基准收益率为 33.81%。

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 2026 年下半年，宏观经济有望延续平稳运行与温和修复态势，国内流动性环境整体保持充裕，市场核心驱动力将逐步由估值扩张切换至盈利兑现，行情或从明显分化走向再平衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，保证基金估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本公司建立估值委员会，负责本公司基金估值业务的决策和评价、与基金估值业务相关的信息披露规定等工作。

本公司管理的基金日常估值由公司清算会计部负责。清算会计部完成估值后，将估值结果以合同约定的形式发送基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后，由管理人按约定对外公布；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本公司在采用估值政策和程序时，应当充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过建立估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、基金收益分配原则

1、基金管理人可对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配。

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

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

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

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

二、本报告期本基金未进行利润分配。

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

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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

报告等内容进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	1,156,323.11
结算备付金		4,450,933.00
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	82,766,481.58
其中：股票投资		82,766,481.58
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
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		119,783.06
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.5	—
资产总计		88,493,520.75
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—

应付清算款		-
应付赎回款		325,566.25
应付管理人报酬		54,965.62
应付托管费		10,306.08
应付销售服务费		21,330.19
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	81,602.35
负债合计		493,770.49
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	64,010,136.31
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	23,989,613.95
净资产合计		87,999,750.26
负债和净资产总计		88,493,520.75

注：1、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间，无上年度末可比数据。

2、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 64,010,136.31 份。其中：泰信上证科创板综合指数增强 A 份额净值人民币 1.3766 元，基金份额总额 15,033,937.38 份；泰信上证科创板综合指数增强 C 份额净值人民币 1.3742 元，基金份额总额 48,976,198.93 份。

6.2 利润表

会计主体：泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		38,313,024.40
1. 利息收入		45,526.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,635.75
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		16,890.33
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,019,771.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,860,923.86
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	158,847.34
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	20,247,459.01
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	268.11
减：二、营业总支出		1,105,617.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	630,339.48
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	118,188.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	276,473.15
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		60.80
8. 其他费用	6.4.7.19	80,555.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,207,407.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,207,407.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		37,207,407.09

注：本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间，无上年度末可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	296,662,138.67	-	-	296,662,138.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 232,652,002.36	-	23,989,613.95	-208,662,388.41
(一)、综合收益总额	-	-	37,207,407.09	37,207,407.09
(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)	- 232,652,002.36	-	-13,217,793.14	-245,869,795.50
其中：1. 基金申购款	28,288,036.60	-	2,660,618.62	30,948,655.22
2. 基金赎回款	- 260,940,038.96	-	-15,878,411.76	-276,818,450.72
(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	64,010,136.31	-	23,989,613.95	87,999,750.26

注：本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间，无上年度末可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

李高峰

段晓旭

顾颖

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

泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1294号《关于准予泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金设立的批复》核准,由泰信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《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为296,662,138.67份,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(26)第00030号验资报告。《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2026年1月27日正式生效。本基金的基金管理人为泰信基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括标的指数的成份股(包括存托凭证)、备选成份股(包括存托凭证)、其他国内依法发行上市的股票(包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票和存托凭证)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款以及其他银行存款等)、货币市场工具、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相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证的资产比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(均含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指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%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为上证科创板综合指数收益率 $\times 95\%$ +同期银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

计准则、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 27 日(基金合同生效日)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

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 27 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务模式和现金流量特征要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价

值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且

保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，

不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税

费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬、基金托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 基金管理人可对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

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

3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向

管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6 号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13 号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13 号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566 号）所规定的固定收益品种，本基金根据该标准的相关规定进行估值、减值计量。

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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

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》、2008 年 9 月 18 日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财

税[2016]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》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税；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	1,156,323.11
等于：本金	1,156,205.85
加：应计利息	117.26
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,156,323.11

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期

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		62,519,022.57	-	82,766,481.58	20,247,459.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		62,519,022.57	-	82,766,481.58	20,247,459.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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	79,223.95
其他	2,378.40
合计	81,602.35

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

泰信上证科创板综合指数增强 A

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	30,743,679.66	30,743,679.66
本期申购	1,697,633.31	1,697,633.31
本期赎回（以“-”号填列）	-17,407,375.59	-17,407,375.59
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,033,937.38	15,033,937.38

泰信上证科创板综合指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	265,918,459.01	265,918,459.01
本期申购	26,590,403.29	26,590,403.29
本期赎回（以“-”号填列）	-243,532,663.37	-243,532,663.37
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	48,976,198.93	48,976,198.93

注：1、申购含红利再投、转换入及份额级别调增数，赎回含转换出及份额级别调减数。

2、本基金自 2026 年 1 月 5 日至 2026 年 1 月 23 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金

人民币 296,595,029.63 元,折合为 296,595,029.63 份基金份额(其中 A 类基金份额 30,732,993.09 份,C 类基金份额 265,862,036.54 份)。根据《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 67,109.04 元在本基金成立后,折合为 67,109.04 份基金份额(其中 A 类基金份额 10,686.57 份,C 类基金份额 56,422.47 份),划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

泰信上证科创板综合指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,055,848.07	3,294,523.21	6,350,371.28
本期基金份额交易产生的变动数	-348,397.04	-340,426.66	-688,823.70
其中：基金申购款	150,749.20	77,096.05	227,845.25
基金赎回款	-499,146.24	-417,522.71	-916,668.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,707,451.03	2,954,096.55	5,661,547.58

泰信上证科创板综合指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	13,904,100.01	16,952,935.80	30,857,035.81
本期基金份额交易产生的变动数	-5,184,376.95	-7,344,592.49	-12,528,969.44
其中：基金申购款	1,696,995.00	735,778.37	2,432,773.37
基金赎回款	-6,881,371.95	-8,080,370.86	-14,961,742.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,719,723.06	9,608,343.31	18,328,066.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,656.90

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,978.85
其他	-
合计	28,635.75

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27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,860,923.86
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	17,860,923.86

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27日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出股票成交总额	190,683,119.07
减：卖出股票成本总额	172,616,143.22
减：交易费用	206,051.99
买卖股票差价收入	17,860,923.86

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	158,847.34
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	158,847.34

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	20,247,459.01
股票投资	20,247,459.01
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	20,247,459.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	268.11
合计	268.11

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	16,355.95
信息披露费	62,868.00
证券出借违约金	-
银行费用	499.00
其他	832.22
合计	80,555.17

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期本基金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
泰信基金管理有限公司	基金管理人
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人
山东省鲁信投资控股集团有限公司（“鲁信集团”）	基金管理人的股东
江苏省投资管理有限责任公司	基金管理人的股东
青岛国信产融控股(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锐懿资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	630,339.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	314,827.96
应支付基金管理人的净管理费	315,511.52

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	118,188.71

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.15%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泰信上证科创板综合 指数增强 A	泰信上证科创板综合 指数增强 C	合计
泰信基金管理有限公司	-	0.08	0.08
中国光大银行	-	218,498.07	218,498.07

合计	-	218,498.15	218,498.15
----	---	------------	------------

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金销售服务费费率为 0.40%。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% \div \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 27 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	1,156,323.11	12,656.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配的情况。

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	成功	受	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注
	券	认购	限	受限	价格	值单价	（单	成本总额	总额	

	名称	日期	类型			位：股)				
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	40	1,339.60	1,357.20	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	112	1,552.32	8,227.52	-
603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	58	914.08	2,709.18	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	49	2,008.02	15,101.31	-
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	58	4,749.04	91,891.14	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	699	4,480.59	16,866.87	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	328	6,455.04	46,408.72	-

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07月13日	890.99	1,595	736,814.63	1,327,040.00	-

688121	*ST 卓然	2026 年 5 月 6 日	无法 在法 定期 限内 披露 2025 年年 度报 告	6.48	2026 年 07 月 07 日	5.18	1,637	19,523.71	10,607.76	-
--------	-----------	-------------------------	---	------	---------------------------	------	-------	-----------	-----------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

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的各种类型的风险，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。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

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、合规与风险控制委员会、督察长、监察稽核部(审计部)和风险管理部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货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的货币资金存放于本基金的基金托管人中国光大银行，与该货币资金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。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法对投资者赎回款或基金其它应付款按时支付的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每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。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和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。本基金所持有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。

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约定巨额赎回条款，设计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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他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%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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。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%。于

2026 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.7275%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2026 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为人民币 82,196,694.54 元，超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要是货币资金、债券投资。利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。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定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 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	1,156,323.11	-	-	-	1,156,323.11
结算备付金	4,450,933.00	-	-	-	4,450,933.00
交易性金融资产	-	-	-	82,766,481.58	82,766,481.58
应收申购款	-	-	-	119,783.06	119,783.06
资产总计	5,607,256.11	-	-	82,886,264.64	88,493,520.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	325,566.25	325,566.25
应付管理人报酬	-	-	-	54,965.62	54,965.62
应付托管费	-	-	-	10,306.08	10,306.08

应付销售服务费	-	-	-	21,330.19	21,330.19
其他负债	-	-	-	81,602.35	81,602.35
负债总计	-	-	-	493,770.49	493,770.49
利率敏感度缺口	5,607,256.11	-	-	82,392,494.15	87,999,750.26

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	82,766,481.58	94.05
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	82,766,481.58	94.05

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金业绩比较基准变化 5%，其他变量不变	
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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,595,916.26

	2. 业绩比较基准下 降 5%	-4, 595, 916. 26
--	--------------------	------------------

注：本基金采用历史数据拟合回归方法来进行其他价格风险敏感性分析。

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
第一层次	81, 246, 271. 88
第二层次	1, 337, 647. 76
第三层次	182, 561. 94
合计	82, 766, 481. 58

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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货币资金、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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,766,481.58	93.53
	其中：股票	82,766,481.58	93.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,607,256.11	6.34
8	其他各项资产	119,783.06	0.14
9	合计	88,493,520.75	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	66,661,826.92	75.75
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	14,122,599.91	16.05

	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	1,407,850.11	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	308,607.34	0.35
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	82,500,884.28	93.75

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	264,447.30	0.30
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	1,150.00	0.00
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	265,597.30	0.30

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688256	寒武纪	3,383	5,397,745.65	6.13
2	688041	海光信息	12,427	4,601,718.10	5.23
3	688012	中微公司	5,006	2,345,311.00	2.67
4	688008	澜起科技	6,435	1,994,206.50	2.27
5	688795	摩尔线程	2,730	1,956,017.70	2.22
6	688802	沐曦股份	2,308	1,911,716.40	2.17
7	688981	中芯国际	10,389	1,649,980.98	1.87
8	688072	拓荆科技	1,595	1,327,040.00	1.51
9	688498	源杰科技	670	1,263,620.00	1.44
10	688525	佰维存储	2,519	1,246,224.87	1.42
11	688521	芯原股份	3,041	1,128,636.74	1.28
12	688082	盛美上海	2,333	1,007,856.00	1.15
13	688120	华海清科	2,820	908,547.60	1.03
14	688146	中船特气	2,586	905,074.14	1.03
15	688361	中科飞测	2,024	870,320.00	0.99
16	688702	盛科通信	2,180	850,178.20	0.97
17	688396	华润微	7,396	721,479.80	0.82
18	688172	燕东微	8,324	696,385.84	0.79
19	688347	华虹宏力	2,020	679,326.00	0.77
20	688506	百利天恒	2,270	667,448.10	0.76
21	688126	沪硅产业	15,757	628,546.73	0.71
22	688249	晶合集成	10,312	608,717.36	0.69
23	688111	金山办公	2,857	608,683.85	0.69
24	688183	生益电子	4,548	602,155.20	0.68
25	688110	东芯股份	2,737	557,526.90	0.63
26	688766	普冉股份	700	536,620.00	0.61
27	688313	仕佳光子	2,838	524,036.70	0.60

28	688271	联影医疗	5,143	520,625.89	0.59
29	688409	富创精密	1,686	516,337.50	0.59
30	688147	微导纳米	2,954	478,193.52	0.54
31	688048	长光华芯	893	448,286.00	0.51
32	688002	睿创微纳	2,883	445,971.27	0.51
33	688777	中控技术	3,729	438,157.50	0.50
34	688019	安集科技	1,290	437,903.40	0.50
35	688469	芯联集成	41,267	437,842.87	0.50
36	688037	芯源微	996	437,293.80	0.50
37	688629	华丰科技	2,313	433,710.63	0.49
38	688200	华峰测控	811	425,856.10	0.48
39	688017	绿的谐波	972	406,159.92	0.46
40	688627	精智达	567	405,405.00	0.46
41	688519	南亚新材	1,059	402,462.36	0.46
42	688141	杰华特	2,593	398,025.50	0.45
43	688036	传音控股	6,727	396,556.65	0.45
44	688668	鼎通科技	1,062	396,444.60	0.45
45	688234	天岳先进	2,177	377,731.27	0.43
46	688630	芯碁微装	664	364,794.96	0.41
47	688220	翱捷科技	2,928	364,008.96	0.41
48	688027	国盾量子	700	352,807.00	0.40
49	688375	国博电子	3,372	351,699.60	0.40
50	688775	影石创新	2,465	341,772.25	0.39
51	688536	思瑞浦	900	327,681.00	0.37
52	688548	广钢气体	6,124	319,060.40	0.36
53	688585	上纬新材	1,891	313,527.80	0.36
54	688167	炬光科技	870	308,162.70	0.35
55	688047	龙芯中科	1,989	307,638.63	0.35
56	688099	晶晨股份	2,944	302,937.60	0.34
57	688387	信科移动	15,206	301,687.04	0.34
58	688223	晶科能源	62,956	299,041.00	0.34
59	688052	纳芯微	1,037	298,977.47	0.34
60	688411	海博思创	1,000	291,200.00	0.33
61	688300	联瑞新材	1,177	287,658.80	0.33
62	688336	三生国健	5,382	285,784.20	0.32
63	688385	复旦微电	3,999	285,088.71	0.32
64	688578	艾力斯	2,594	283,264.80	0.32
65	688025	杰普特	600	282,000.00	0.32
66	688213	思特威	2,585	276,775.95	0.31
67	688187	时代电气	4,002	274,777.32	0.31
68	688248	南网科技	3,896	269,525.28	0.31
69	688001	华兴源创	3,124	267,726.80	0.30
70	688127	蓝特光学	2,707	264,203.20	0.30

71	688188	柏楚电子	2,450	261,415.00	0.30
72	688372	伟测科技	1,400	260,400.00	0.30
73	688503	聚和材料	1,959	259,959.30	0.30
74	688301	奕瑞科技	2,052	254,448.00	0.29
75	688388	嘉元科技	5,623	247,412.00	0.28
76	688549	中巨芯	6,592	242,651.52	0.28
77	688123	聚辰股份	1,111	236,198.60	0.27
78	688568	中科星图	5,657	234,595.79	0.27
79	688608	恒玄科技	1,400	234,066.00	0.27
80	688728	格科微	11,116	233,880.64	0.27
81	688661	和林微纳	1,436	228,295.28	0.26
82	688018	乐鑫科技	1,760	225,139.20	0.26
83	688535	华海诚科	1,199	224,213.00	0.25
84	688343	云天励飞	2,712	221,461.92	0.25
85	688322	奥比中光	1,684	219,846.20	0.25
86	688692	达梦数据	888	216,929.52	0.25
87	688800	瑞可达	2,240	214,972.80	0.24
88	688180	君实生物	6,347	214,655.54	0.24
89	688333	铂力特	2,065	211,456.00	0.24
90	688266	泽璟制药	1,798	209,754.68	0.24
91	688009	中国通号	44,065	209,749.40	0.24
92	688502	茂莱光学	300	208,080.00	0.24
93	688778	厦钨新能	3,815	207,536.00	0.24
94	688195	腾景科技	1,060	204,134.80	0.23
95	688150	莱特光电	2,964	203,389.68	0.23
96	688295	中复神鹰	3,359	203,353.86	0.23
97	688433	华曙高科	2,371	202,957.60	0.23
98	688757	胜科纳米	3,029	202,034.30	0.23
99	688596	正帆科技	2,532	200,179.92	0.23
100	688545	兴福电子	1,490	198,259.40	0.23
101	688349	三一重能	12,954	196,641.72	0.22
102	688368	晶丰明源	907	196,383.64	0.22
103	688169	石头科技	2,055	195,163.35	0.22
104	688582	芯动联科	2,971	193,115.00	0.22
105	688392	骄成超声	847	192,421.46	0.22
106	688603	天承科技	900	187,155.00	0.21
107	688531	日联科技	1,050	186,732.00	0.21
108	688599	天合光能	13,192	186,271.04	0.21
109	688559	海目星	2,172	182,274.24	0.21
110	688617	惠泰医疗	1,000	181,560.00	0.21
111	688563	航材股份	3,520	180,329.60	0.20
112	688279	峰岬科技	800	179,552.00	0.20
113	688475	萤石网络	6,547	179,060.45	0.20

114	688662	富信科技	1,060	178,080.00	0.20
115	688268	华特气体	650	173,875.00	0.20
116	688331	荣昌生物	1,309	170,510.34	0.19
117	688122	西部超导	2,701	169,649.81	0.19
118	688235	百济神州	665	169,315.65	0.19
119	688472	阿特斯	15,511	167,829.02	0.19
120	688676	金盘科技	1,980	167,587.20	0.19
121	688359	三孚新科	833	165,300.52	0.19
122	688400	凌云光	2,495	165,169.00	0.19
123	688425	铁建重工	40,649	163,408.98	0.19
124	688303	大全能源	9,315	162,360.45	0.18
125	688432	有研硅	4,047	161,758.59	0.18
126	688449	联芸科技	1,868	161,227.08	0.18
127	688332	中科蓝讯	1,023	161,122.50	0.18
128	688319	欧林生物	3,636	159,911.28	0.18
129	688281	华秦科技	3,119	156,667.37	0.18
130	688107	安路科技	3,367	153,535.20	0.17
131	688090	瑞松科技	1,426	151,797.70	0.17
132	688516	奥特维	2,636	151,280.04	0.17
133	688383	新益昌	800	150,432.00	0.17
134	688020	方邦股份	600	149,760.00	0.17
135	688403	汇成股份	3,709	147,247.30	0.17
136	688261	东微半导	1,390	145,852.70	0.17
137	688208	道通科技	5,773	145,421.87	0.17
138	688378	奥来德	2,326	144,212.00	0.16
139	688262	国芯科技	3,307	142,961.61	0.16
140	688112	鼎阳科技	1,932	141,924.72	0.16
141	688677	海泰新光	1,397	141,278.61	0.16
142	688456	有研粉材	1,000	139,600.00	0.16
143	688416	恒烁股份	992	138,880.00	0.16
144	688231	隆达股份	3,736	137,223.28	0.16
145	688717	艾罗能源	1,655	136,653.35	0.16
146	688166	博瑞医药	3,894	136,328.94	0.15
147	688337	普源精电	1,816	136,072.88	0.15
148	688819	天能股份	6,121	135,886.20	0.15
149	688353	华盛锂电	1,166	135,337.62	0.15
150	688257	新锐股份	1,328	135,323.20	0.15
151	688561	奇安信	5,643	135,319.14	0.15
152	688209	英集芯	4,642	134,989.36	0.15
153	688239	航宇科技	2,244	134,258.52	0.15
154	688102	斯瑞新材	2,831	133,566.58	0.15
155	688155	先惠技术	1,646	133,144.94	0.15
156	688312	燕麦科技	1,574	132,200.26	0.15

157	688153	唯捷创芯	4,112	132,077.44	0.15
158	688362	甬矽电子	1,359	131,007.60	0.15
159	688125	安达智能	800	130,800.00	0.15
160	688100	威胜信息	4,229	129,365.11	0.15
161	688029	南微医学	1,800	129,240.00	0.15
162	688233	神工股份	600	128,652.00	0.15
163	688079	美迪凯	4,183	128,627.25	0.15
164	688116	天奈科技	3,324	126,976.80	0.14
165	688205	德科立	600	124,914.00	0.14
166	688230	芯导科技	1,581	124,598.61	0.14
167	688779	五矿新能	15,334	124,358.74	0.14
168	688628	优利德	1,256	124,268.64	0.14
169	688419	耐科装备	1,565	123,087.25	0.14
170	688538	和辉光电	47,296	122,969.60	0.14
171	688556	高测股份	9,114	121,033.92	0.14
172	688710	益诺思	1,800	120,960.00	0.14
173	688065	凯赛生物	2,527	120,916.95	0.14
174	688678	福立旺	4,991	120,632.47	0.14
175	688685	迈信林	2,192	120,340.80	0.14
176	688059	华锐精密	600	119,826.00	0.14
177	688307	中润光学	1,480	118,326.00	0.13
178	688652	京仪装备	590	118,100.30	0.13
179	688179	阿拉丁	4,163	115,356.73	0.13
180	688615	合合信息	1,009	114,117.90	0.13
181	688068	热景生物	1,295	112,147.00	0.13
182	688318	财富趋势	1,558	111,100.98	0.13
183	688128	中国电研	4,670	110,865.80	0.13
184	688191	智洋创新	3,080	109,956.00	0.12
185	688351	微电生理	4,781	108,337.46	0.12
186	688653	康希通信	6,218	108,068.84	0.12
187	688253	英诺特	1,785	107,599.80	0.12
188	688667	菱电电控	800	106,920.00	0.12
189	688518	联赢激光	3,439	106,265.10	0.12
190	688143	长盈通	596	104,824.48	0.12
191	688308	欧科亿	574	104,358.94	0.12
192	688693	锆威特	1,000	103,950.00	0.12
193	688045	必易微	1,284	103,721.52	0.12
194	688448	磁谷科技	1,620	102,967.20	0.12
195	688226	威腾电气	2,394	102,535.02	0.12
196	688660	电气风电	11,895	102,534.90	0.12
197	688648	中邮科技	2,764	101,024.20	0.11
198	688720	艾森股份	1,000	101,000.00	0.11
199	688218	江苏北人	1,800	98,928.00	0.11

200	688379	华光新材	1,161	97,558.83	0.11
201	688061	灿瑞科技	1,960	97,353.20	0.11
202	688088	虹软科技	2,732	97,122.60	0.11
203	688655	迅捷兴	1,800	96,408.00	0.11
204	688390	固德威	888	96,356.88	0.11
205	688418	震有科技	1,986	95,486.88	0.11
206	688007	光峰科技	7,164	95,281.20	0.11
207	688003	天准科技	747	95,093.10	0.11
208	688069	德林海	2,520	94,147.20	0.11
209	688199	久日新材	2,720	93,921.60	0.11
210	688478	晶升股份	1,054	93,331.70	0.11
211	688158	优刻得	2,525	92,819.00	0.11
212	688097	博众精工	1,467	92,494.35	0.11
213	688010	福光股份	1,881	91,473.03	0.10
214	688575	亚辉龙	10,350	90,666.00	0.10
215	688486	龙迅股份	1,423	90,474.34	0.10
216	688552	航天南湖	3,175	89,312.75	0.10
217	688522	纳睿雷达	4,453	89,149.06	0.10
218	688607	康众医疗	1,727	88,077.00	0.10
219	688161	威高骨科	4,181	87,717.38	0.10
220	688480	赛恩斯	1,000	87,590.00	0.10
221	688291	金橙子	1,495	87,427.60	0.10
222	688297	中无人机	2,098	87,171.90	0.10
223	688621	阳光诺和	1,578	86,647.98	0.10
224	688350	富淼科技	2,500	86,325.00	0.10
225	688173	希荻微	4,506	86,244.84	0.10
226	688246	嘉和美康	4,188	86,063.40	0.10
227	688177	百奥泰	5,116	86,051.12	0.10
228	688028	沃尔德	540	84,169.80	0.10
229	688499	利元亨	1,600	84,080.00	0.10
230	688311	盟升电子	3,200	83,808.00	0.10
231	688601	力芯微	1,382	83,680.10	0.10
232	688348	昱能科技	2,400	83,472.00	0.09
233	688157	松井股份	3,157	83,313.23	0.09
234	688571	杭华股份	9,423	82,451.25	0.09
235	688690	纳微科技	1,864	82,202.40	0.09
236	688299	长阳科技	4,900	81,879.00	0.09
237	688352	顾中科技	3,384	81,825.12	0.09
238	688015	交控科技	5,192	79,852.96	0.09
239	688700	东威科技	893	79,834.20	0.09
240	688238	和元生物	14,700	79,674.00	0.09
241	688050	爱博医疗	2,126	77,492.70	0.09
242	688656	浩欧博	800	77,416.00	0.09

243	688366	昊海生科	2,677	77,284.99	0.09
244	688663	新风光	865	76,517.90	0.09
245	688212	澳华内镜	2,600	76,440.00	0.09
246	688176	亚虹医药	7,621	75,600.32	0.09
247	688726	拉普拉斯	1,423	75,205.55	0.09
248	688543	国科军工	1,900	74,955.00	0.09
249	688278	特宝生物	1,373	74,691.20	0.08
250	688588	凌志软件	8,045	73,129.05	0.08
251	688398	赛特新材	2,800	72,548.00	0.08
252	688135	利扬芯片	1,685	70,904.80	0.08
253	688084	晶品特装	1,400	70,392.00	0.08
254	688523	航天环宇	1,335	69,954.00	0.08
255	688282	理工导航	1,200	69,840.00	0.08
256	688618	三旺通信	2,265	69,694.05	0.08
257	688269	凯立新材	2,185	69,286.35	0.08
258	688529	豪森智能	4,373	68,787.29	0.08
259	688380	中微半导	1,038	68,414.58	0.08
260	688049	炬芯科技	1,442	67,644.22	0.08
261	688133	泰坦科技	3,200	67,616.00	0.08
262	688306	均普智能	6,647	67,134.70	0.08
263	688376	美埃科技	577	67,105.10	0.08
264	688450	光格科技	1,000	66,990.00	0.08
265	688639	华恒生物	4,086	65,948.04	0.07
266	688517	金冠电气	3,763	65,777.24	0.07
267	688584	上海合晶	1,825	65,608.75	0.07
268	688393	安必平	3,637	64,665.86	0.07
269	688695	中创股份	3,400	63,580.00	0.07
270	688484	南芯科技	1,121	63,325.29	0.07
271	688697	纽威数控	4,654	63,247.86	0.07
272	688113	联测科技	1,800	63,180.00	0.07
273	688479	友车科技	1,660	63,030.20	0.07
274	688108	赛诺医疗	3,344	61,964.32	0.07
275	688382	益方生物	3,410	61,380.00	0.07
276	688062	迈威生物	2,157	60,935.25	0.07
277	688117	圣诺生物	2,240	60,547.20	0.07
278	688005	容百科技	1,977	60,496.20	0.07
279	688373	盟科药业	13,249	60,017.97	0.07
280	688067	爱威科技	2,975	59,946.25	0.07
281	688776	国光电气	970	59,499.80	0.07
282	688198	佰仁医疗	663	59,166.12	0.07
283	688466	金科环境	4,600	59,018.00	0.07
284	688006	杭可科技	1,535	56,104.25	0.06
285	688035	德邦科技	600	55,080.00	0.06

286	688323	瑞华泰	970	54,805.00	0.06
287	688636	智明达	1,500	54,345.00	0.06
288	688772	珠海冠宇	2,756	54,100.28	0.06
289	688709	成都华微	1,419	54,049.71	0.06
290	688330	宏力达	1,596	53,992.68	0.06
291	688507	索辰科技	200	53,936.00	0.06
292	688515	裕太微	216	53,732.16	0.06
293	688718	唯赛勃	3,359	53,643.23	0.06
294	688114	华大智造	1,037	52,969.96	0.06
295	688610	埃科光电	198	52,153.20	0.06
296	688420	美腾科技	2,469	52,021.83	0.06
297	688708	佳驰科技	1,020	51,816.00	0.06
298	688612	威迈斯	1,732	51,249.88	0.06
299	688625	呈和科技	606	51,152.46	0.06
300	688686	奥普特	298	50,180.22	0.06
301	688789	宏华数科	923	49,075.91	0.06
302	688679	通源环境	1,162	48,908.58	0.06
303	688309	恒誉环保	800	48,704.00	0.06
304	688168	安博通	703	48,331.25	0.05
305	688327	云从科技	3,845	47,908.70	0.05
306	688095	福昕软件	800	47,544.00	0.05
307	688321	微芯生物	1,782	46,920.06	0.05
308	688131	皓元医药	481	45,502.60	0.05
309	688031	星环科技	386	44,459.48	0.05
310	688595	芯海科技	993	43,552.98	0.05
311	688106	金宏气体	1,014	42,060.72	0.05
312	688293	奥浦迈	1,000	41,690.00	0.05
313	688081	兴图新科	1,000	40,880.00	0.05
314	688032	禾迈股份	479	40,485.08	0.05
315	688605	先锋精科	387	40,255.74	0.05
316	688600	皖仪科技	1,200	39,936.00	0.05
317	688428	诺诚健华	1,400	39,858.00	0.05
318	688046	药康生物	1,645	39,809.00	0.05
319	688206	概伦电子	884	39,223.08	0.04
320	688055	龙腾光电	6,778	39,041.28	0.04
321	688513	苑东生物	887	38,992.52	0.04
322	688182	灿勤科技	876	37,729.32	0.04
323	688401	路维光电	381	36,568.38	0.04
324	688798	艾为电子	486	35,633.52	0.04
325	688658	悦康药业	2,768	35,596.48	0.04
326	688508	芯朋微	369	34,302.24	0.04
327	688244	永信至诚	2,400	34,224.00	0.04
328	688202	美迪西	416	33,575.36	0.04

329	688192	迪哲医药	813	32,463.09	0.04
330	688251	井松智能	1,229	31,499.27	0.04
331	688030	山石网科	1,980	31,264.20	0.04
332	688611	杭州柯林	414	29,580.30	0.03
333	688510	航亚科技	1,220	29,133.60	0.03
334	688286	敏芯股份	252	28,997.64	0.03
335	688227	品高股份	278	28,547.82	0.03
336	688500	慧辰股份	600	27,198.00	0.03
337	688285	高铁电气	3,685	26,421.45	0.03
338	688593	新相微	677	26,348.84	0.03
339	688696	极米科技	400	25,816.00	0.03
340	688689	银河微电	395	25,564.40	0.03
341	688589	力合微	1,095	25,163.10	0.03
342	688190	云路股份	273	24,763.83	0.03
343	688016	心脉医疗	279	24,730.56	0.03
344	688058	宝兰德	1,163	24,329.96	0.03
345	688681	科汇股份	1,672	23,374.56	0.03
346	688613	奥精医疗	1,641	23,154.51	0.03
347	688152	麒麟信安	815	22,396.20	0.03
348	688659	元琛科技	2,127	22,205.88	0.03
349	688326	经纬恒润	300	21,264.00	0.02
350	688381	帝奥微	373	19,955.50	0.02
351	688691	灿芯股份	171	19,824.03	0.02
352	688698	伟创电气	377	19,773.65	0.02
353	688060	云涌科技	600	19,734.00	0.02
354	688530	欧莱新材	200	19,380.00	0.02
355	688567	孚能科技	1,749	18,364.50	0.02
356	688468	科美诊断	3,209	18,259.21	0.02
357	688004	博汇科技	1,000	18,200.00	0.02
358	688399	硕世生物	400	18,156.00	0.02
359	688363	华熙生物	499	17,849.23	0.02
360	688669	聚石化学	164	17,548.00	0.02
361	688080	映翰通	400	17,300.00	0.02
362	688750	金天钛业	1,037	17,245.31	0.02
363	688302	海创药业	471	16,565.07	0.02
364	688602	康鹏科技	1,972	15,539.36	0.02
365	688356	键凯科技	200	15,416.00	0.02
366	688520	神州细胞	425	14,539.25	0.02
367	688626	翔宇医疗	300	13,278.00	0.02
368	688083	中望软件	200	12,950.00	0.01
369	688063	派能科技	242	12,891.34	0.01
370	688203	海正生材	1,272	12,694.56	0.01
371	688485	九州一轨	197	12,619.82	0.01

372	688210	统联精密	300	12,153.00	0.01
373	688221	前沿生物	542	12,140.80	0.01
374	688539	高华科技	370	11,795.60	0.01
375	688138	清溢光电	247	11,609.00	0.01
376	688550	瑞联新材	200	11,570.00	0.01
377	688225	亚信安全	907	11,264.94	0.01
378	688439	*ST 卓然	241	11,134.20	0.01
379	688023	安恒信息	300	11,016.00	0.01
380	688139	海尔生物	416	10,990.72	0.01
381	688305	科德数控	165	10,769.55	0.01
382	688121	卓然股份	1,637	10,607.76	0.01
383	688129	东来技术	390	10,214.10	0.01
384	688360	德马科技	569	10,185.10	0.01
385	688265	南模生物	294	10,169.46	0.01
386	688091	上海谊众	249	10,009.80	0.01
387	688631	莱斯信息	200	9,382.00	0.01
388	688185	康希诺	180	9,178.20	0.01
389	688289	圣湘生物	632	9,100.80	0.01
390	688222	成都先导	283	9,087.13	0.01
391	688275	万润新能	71	9,056.05	0.01
392	688598	金博股份	182	8,999.90	0.01
393	688616	西力科技	890	8,989.00	0.01
394	688386	泛亚微透	100	8,984.00	0.01
395	688739	成大生物	459	8,945.91	0.01
396	688101	三达膜	512	8,463.36	0.01
397	688579	地纬智能	1,092	8,288.28	0.01
398	688699	明微电子	100	8,195.00	0.01
399	688687	凯因科技	493	8,040.83	0.01
400	688680	海优新材	186	7,812.00	0.01
401	688609	九联科技	692	7,618.92	0.01
402	688633	星球石墨	256	7,610.88	0.01
403	688207	格灵深瞳	378	7,597.80	0.01
404	688683	莱尔科技	200	7,584.00	0.01
405	688165	埃夫特	366	7,466.40	0.01
406	688070	纵横股份	200	7,466.00	0.01
407	688320	禾川科技	175	7,253.75	0.01
408	688215	瑞晟智能	180	7,228.80	0.01
409	688137	近岸蛋白	200	7,200.00	0.01
410	688788	科思科技	160	7,196.80	0.01
411	688105	诺唯赞	412	7,148.20	0.01
412	688671	碧兴物联	200	7,114.00	0.01
413	688328	深科达	72	6,890.40	0.01
414	688733	壹石通	166	6,864.10	0.01

415	688570	天玛智控	478	6,801.94	0.01
416	688367	工大高科	200	6,660.00	0.01
417	688211	中科微至	193	6,643.06	0.01
418	688458	美芯晟	158	6,598.08	0.01
419	688558	国盛智科	200	6,572.00	0.01
420	688767	博拓生物	200	6,502.00	0.01
421	688459	哈铁科技	778	6,480.74	0.01
422	688267	中触媒	328	6,461.60	0.01
423	688039	当虹科技	169	6,307.08	0.01
424	688443	智翔金泰	269	6,254.25	0.01
425	688586	江航装备	534	6,242.46	0.01
426	688553	汇宇制药	565	6,005.95	0.01
427	688707	振华新材	466	5,988.10	0.01
428	688075	安旭生物	196	5,832.96	0.01
429	688236	春立医疗	400	5,784.00	0.01
430	688716	中研股份	182	5,720.26	0.01
431	688259	创耀科技	146	5,711.52	0.01
432	688089	ST 嘉必优	529	5,612.69	0.01
433	688130	晶华微	197	5,539.64	0.01
434	688252	天德钰	225	5,400.00	0.01
435	688077	大地熊	199	5,271.51	0.01
436	688591	泰凌微	152	5,225.76	0.01
437	688334	西高院	286	5,188.04	0.01
438	688512	慧智微	324	5,174.28	0.01
439	688768	容知日新	100	5,154.00	0.01
440	688276	百克生物	361	5,032.34	0.01
441	688408	中信博	156	5,015.40	0.01
442	688013	天臣医疗	200	4,934.00	0.01
443	688711	宏微科技	107	4,863.15	0.01
444	688148	芳源股份	564	4,839.12	0.01
445	688280	精进电动	856	4,699.44	0.01
446	688098	申联生物	544	4,672.96	0.01
447	688377	迪威尔	196	4,621.68	0.01
448	688119	中钢洛耐	954	4,531.50	0.01
449	688255	凯尔达	163	4,531.40	0.01
450	688758	赛分科技	203	4,468.03	0.01
451	688505	复旦张江	605	4,464.90	0.01
452	688576	西山科技	112	4,463.20	0.01
453	688395	正弦电气	200	4,420.00	0.01
454	688365	光云科技	271	4,273.67	0.00
455	688721	龙图光罩	73	4,261.74	0.00
456	688371	菲沃泰	108	4,210.92	0.00
457	688078	龙软科技	200	4,210.00	0.00

458	688296	和达科技	367	4,198.48	0.00
459	688186	广大特材	272	4,120.80	0.00
460	688277	天智航	231	3,950.10	0.00
461	688057	金达莱	254	3,914.14	0.00
462	688087	英科再生	116	3,876.72	0.00
463	688021	奥福科技	200	3,872.00	0.00
464	688151	华强科技	260	3,866.20	0.00
465	688369	致远互联	181	3,802.81	0.00
466	688355	明志科技	193	3,715.25	0.00
467	688219	会通股份	286	3,700.84	0.00
468	688577	浙海德曼	80	3,666.40	0.00
469	688389	普门科技	372	3,641.88	0.00
470	688391	钜泉科技	100	3,587.00	0.00
471	688566	吉贝尔	140	3,582.60	0.00
472	688315	诺禾致源	285	3,565.35	0.00
473	688501	青达环保	178	3,417.60	0.00
474	688426	康为世纪	185	3,392.90	0.00
475	688455	科捷智能	180	3,358.80	0.00
476	688533	上声电子	160	3,337.60	0.00
477	688737	中自科技	172	3,292.08	0.00
478	688657	浩辰软件	92	3,290.84	0.00
479	688292	浩瀚深度	174	3,236.40	0.00
480	688793	倍轻松	200	3,222.00	0.00
481	688565	力源科技	337	3,184.65	0.00
482	688670	金迪克	186	3,150.84	0.00
483	688619	罗普特	191	3,099.93	0.00
484	688247	宣泰医药	412	3,098.24	0.00
485	688569	铁科轨道	190	3,068.50	0.00
486	688528	秦川物联	334	3,052.76	0.00
487	688526	科前生物	249	3,012.90	0.00
488	688560	明冠新材	250	2,962.50	0.00
489	688093	世华科技	79	2,915.10	0.00
490	688339	亿华通	154	2,879.80	0.00
491	688620	安凯微	175	2,835.00	0.00
492	688232	新点软件	158	2,809.24	0.00
493	688357	建龙微纳	94	2,770.18	0.00
494	688722	同益中	180	2,730.60	0.00
495	688189	ST 南新	456	2,726.88	0.00
496	688488	艾迪药业	212	2,724.20	0.00
497	688590	新致软件	218	2,709.74	0.00
498	688509	正元地信	631	2,700.68	0.00
499	688298	东方生物	150	2,679.00	0.00
500	688038	中科通达	155	2,607.10	0.00

501	688132	邦彦技术	198	2,603.70	0.00
502	688085	三友医疗	215	2,573.55	0.00
503	688115	思林杰	31	2,549.75	0.00
504	688429	时创能源	244	2,486.36	0.00
505	688562	航天软件	164	2,469.84	0.00
506	688701	卓锦股份	320	2,409.60	0.00
507	688597	煜邦电力	364	2,366.00	0.00
508	688338	赛科希德	77	2,272.27	0.00
509	688489	三未信安	96	2,179.20	0.00
510	688410	山外山	139	1,996.04	0.00
511	688317	之江生物	121	1,839.20	0.00
512	688258	卓易信息	14	1,659.56	0.00
513	688217	睿昂基因	77	1,590.82	0.00
514	688288	鸿泉技术	81	1,439.37	0.00
515	688786	悦安新材	30	1,382.40	0.00
516	688175	高凌信息	43	1,081.45	0.00
517	688335	复洁科技	36	865.44	0.00
518	688283	坤恒顺维	14	463.54	0.00
519	688310	迈得医疗	20	307.40	0.00
520	688719	爱科赛博	3	231.00	0.00
521	688109	品茗科技	1	75.70	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	688808	联讯仪器	58	91,891.14	0.10
2	688820	盛合晶微	328	46,408.72	0.05
3	605222	起帆电缆	1,700	39,644.00	0.05
4	603538	美诺华	600	19,530.00	0.02
5	688811	有研复材	699	16,866.87	0.02
6	688635	长进光子	49	15,101.31	0.02
7	688729	屹唐股份	300	12,900.00	0.01
8	603407	长裕集团	112	8,227.52	0.01
9	300069	金利华电	200	6,366.00	0.01
10	603293	埃泰克	93	3,536.56	0.00
11	603435	嘉德利	58	2,709.18	0.00
12	603668	天马科技	100	1,266.00	0.00
13	600683	京投发展	100	1,150.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	688041	海光信息	13,919,337.88	15.82
2	688256	寒武纪	10,732,148.11	12.20
3	688802	沐曦股份	5,391,662.85	6.13
4	688981	中芯国际	4,858,071.92	5.52
5	688012	中微公司	4,600,773.00	5.23
6	688008	澜起科技	4,416,151.73	5.02
7	688795	摩尔线程	4,296,742.69	4.88
8	688111	金山办公	2,900,406.46	3.30
9	688521	芯原股份	2,757,237.41	3.13
10	688506	百利天恒	2,713,147.36	3.08
11	688072	拓荆科技	2,449,934.15	2.78
12	688271	联影医疗	2,239,167.04	2.54
13	688082	盛美上海	1,885,544.52	2.14
14	688775	影石创新	1,755,585.84	1.99
15	688396	华润微	1,750,858.40	1.99
16	688702	盛科通信	1,733,935.48	1.97
17	688525	佰维存储	1,684,026.59	1.91
18	688183	生益电子	1,666,998.11	1.89
19	688375	国博电子	1,551,574.35	1.76
20	688498	源杰科技	1,525,874.72	1.73

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	12,730,722.85	14.47
2	688256	寒武纪	10,931,478.01	12.42
3	688802	沐曦股份	4,812,089.19	5.47
4	688981	中芯国际	3,872,543.10	4.40
5	688008	澜起科技	3,848,206.53	4.37
6	688012	中微公司	3,607,107.19	4.10
7	688795	摩尔线程	2,923,797.55	3.32
8	688072	拓荆科技	2,238,357.62	2.54
9	688521	芯原股份	2,138,227.62	2.43
10	688506	百利天恒	2,046,295.83	2.33
11	688525	佰维存储	2,010,274.12	2.28
12	688702	盛科通信	1,860,467.17	2.11
13	688111	金山办公	1,824,031.82	2.07
14	688183	生益电子	1,599,645.92	1.82
15	688082	盛美上海	1,523,126.17	1.73

16	688271	联影医疗	1,473,774.17	1.67
17	688396	华润微	1,332,083.23	1.51
18	688498	源杰科技	1,301,364.63	1.48
19	688126	沪硅产业	1,226,631.65	1.39
20	688120	华海清科	1,226,218.62	1.39

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	235,135,165.79
卖出股票收入（成交）总额	190,683,119.07

注：
本项“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

报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未投资贵金属。

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

报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

截至报告期末本基金未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

截至报告期末本基金未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期投资的前十名证券中发行主体未发生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、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同约定备选股票库之外的股票。

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	119,783.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,783.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本基金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	1,327,040.00	1.51	重大事项

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	91,891.14	0.10	新股流通受限
2	688820	盛合晶微	46,408.72	0.05	新股流通受限
3	688811	有研复材	16,866.87	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

本报告涉及合计数相关比例的，均以合计数除以相关数据计算，而不是对不同比例进行合计。

§ 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 (%)
泰信上证 科创板综 合指数增 强 A	205	73,336.28	0.00	0.00	15,033,937.38	100.00
泰信上证 科创板综 合指数增 强 C	482	101,610.37	0.00	0.00	48,976,198.93	100.00
合计	687	93,173.42	0.00	0.00	64,010,136.31	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：基金份额总量的数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	泰信上证科创板综合指数增强 A	泰信上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日 (2026 年 1 月 27 日) 基金份额总额	30,743,679.66	265,918,459.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,697,633.31	26,590,403.29
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	17,407,375.59	243,532,663.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	15,033,937.38	48,976,198.93

注：总申购份额含红利再投资、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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、自 2026 年 2 月 10 日起，张芸红不再担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 2 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、自 2026 年 3 月 10 日起，段晓旭担任首席财务官。具体详情参见 2026 年 3 月 10 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、自 2026 年 6 月 22 日起，刘玉成担任首席信息官，总经理张秉麟不再代任首席信息官职务。具体详情参见 2026 年 6 月 22 日刊登在中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及公司网站（www.ftfund.com）上的《泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

上述人事变动已按相关规定进行备案。

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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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

本报告期内本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	3	295,245,866.14	69.37	60,013.80	70.12	-
首创证券	3	130,357,966.42	30.63	25,578.13	29.88	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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	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 (%)		(%)		的比例 (%)
中泰证 券	-	-	434, 589, 000. 00	100. 00	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-

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	泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊及规定网站	2026 年 1 月 28 日
2	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 10 日
3	泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金开放日常申购、赎回业务公告	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 25 日
4	泰信基金管理有限公司关于泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金在部分销售机构开通定投、转换及参加费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 2 月 25 日
5	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 10 日
6	泰信基金管理有限公司关于泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金在中国光大银行股份有限公司开通定投、转换及参加费率优惠活动的公告	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 20 日
7	泰信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）	规定报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
8	泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2026 年第一季度报告	规定报刊及规定网站	2026 年 4 月 21 日
9	泰信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊及规定网站	2026 年 6 月 22 日

§ 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

报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《泰信上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

本报告分别置备于基金管理人、基金托管人的住所，供投资者免费查阅。

12.3 查阅方式

投资者可直接登录本基金管理人公司网站(www.ftfund.com)查阅上述相关文件，或拨打客户服务中心电话(400-888-5988，021-38784566)，和本基金管理人直接联系。

泰信基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日