

嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证
券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 30 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 24 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。

本报告期自 2025 年 04 月 09 日（基金合同生效日）起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19

§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 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	64
8.7 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	64
8.8 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	64
8.9 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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.4 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	67
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1 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	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实上证科创板综合 ETF
场内简称	科综嘉实（扩位证券简称：科创综指 ETF 嘉实）
基金主代码	589300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 4 月 9 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	77,582,547.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 17 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95511-3
传真	(010)65215588	0755-82080387
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆	广东省深圳市罗湖区深南东路

	家嘴环路 1318 号 1806A 单元	5047 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	100020	518001
法定代表人	经雷	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	36,256,564.48
本期利润	50,687,417.49
加权平均基金份额本期利润	0.4626
本期加权平均净值利润率	39.58%
本期基金份额净值增长率	42.44%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	30,485,325.17
期末可供分配基金份额利润	0.3929
期末基金资产净值	110,510,228.48
期末基金份额净值	1.4244
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	42.44%

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

（3）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。

(4) 本基金合同生效日为2025年04月09日,本报告期自2025年04月09日起至2025年12月31日止。

3.2 基金净值表现

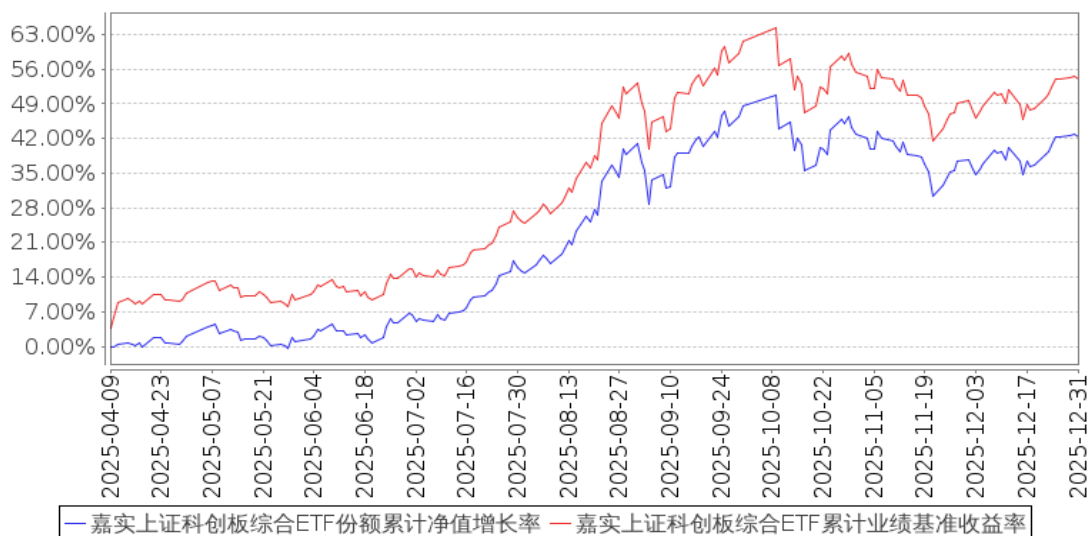
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.12%	1.61%	-4.68%	1.63%	0.56%	-0.02%
过去六个月	33.53%	1.67%	33.08%	1.68%	0.45%	-0.01%
自基金合同生效起至今	42.44%	1.48%	54.12%	1.54%	-11.68%	-0.06%

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

嘉实上证科创板综合ETF份额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

(2025年04月09日至2025年12月31日)

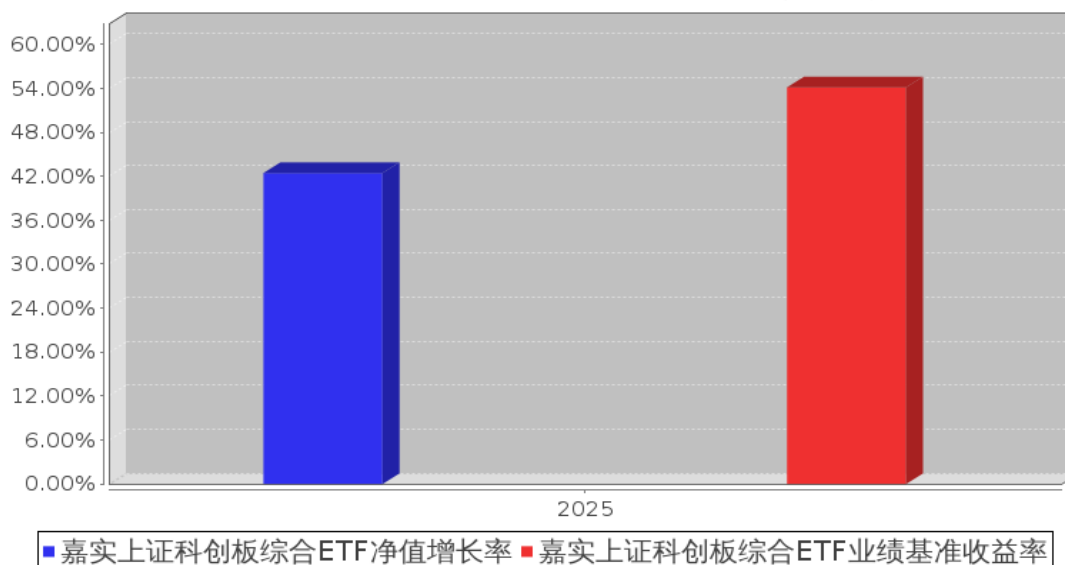


注：(1) 本基金合同生效日2025年04月09日至报告期末未满1年。

(2) 按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实上证科创板综合ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2025年12月31日，基金管理人共管理380只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、不动产基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

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		
尚可	本基金、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实创业板增强策略 ETF、嘉实中证 A50ETF、嘉实中证 A50ETF 联接、嘉实上证综合增强策略 ETF、嘉实国证自由现金流 ETF、嘉实中证诚通国企数字经济 ETF、嘉实上证科创板综合 ETF 联接、嘉实上证科创板综合增强策略 ETF、嘉实国证自由现金流 ETF 联接、嘉实上证科创板人	2025 年 4 月 9 日	-	5 年	2020 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部任研究员。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	工智能指数发起式基金经理				
--	--------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统

和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 8 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

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

本基金跟踪上证科创板综合指数，上证科创板综合指数由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，反映科创板上市公司证券包括分红收益的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2025 年国内宏观经济在“破立并举”中呈现出前低后稳、结构优化的运行特征。尽管上半年“抢出口”效应消退及房地产市场的深度调整使经济基本面承压，但随着下半年“反内卷”政策的全面深化与落实，供给侧恶性竞争得到有效遏制，物价水平逐步回升，企业盈利预期改善。外贸方面，尽管“关税战 2.0”带来了显著的外部扰动，但得益于对非美市场的成功拓展，出口展现出极强韧性。随着年底重要会议对“十五五”规划方向的定调以及中美元首会晤带来的外部环境阶段性缓和，经济基本面在政策托底与结构转型的双轮驱动下，确立了企稳向好的长期趋势。2025 年美国在加息周期的尾声中展现出超预期的韧性，但整体增速呈现边际放缓态势，且内部结构性分化特征显著。制造业及房地产市场持续承压，但服务业消费在劳动力市场支撑下保持了相对稳健，避免了经济陷入深度衰退。然而，就业数据的反复波动以及市场对“软着陆”与“二次通胀”风险的博弈贯穿全年，导致美债收益率曲线经历了剧烈的形态调整。年末随着贸易政策不确定性的落地及降息路径的进一步明晰，市场对美国经济的预期逐渐从“衰退恐慌”转向“温和放缓”，但财政赤字与债务问题仍是制约其长期增长中枢的潜在隐忧。

本报告期内，剔除建仓期，本基金日均跟踪偏离为 0.02%，年化跟踪误差为 0.54%，符合基金合同约定的年化跟踪误差不超过 2.00%的限制。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4244 元；本报告期基金份额净值增长率为 42.44%，业

绩比较基准收益率为 54.12%。

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，国内权益市场在“十五五”开局之年有望在多重积极因素共振下延续结构性行情，核心驱动力将从估值修复转向盈利改善。宏观政策有望维持宽松，为市场提供支撑。全球货币政策趋向宽松、美元预期走弱，有望改善新兴市场流动性，吸引全球资金加大对中国资产的配置。同时，国内居民资产向权益市场迁移、险资等长期资金入市，将提供重要的增量流动性。

本基金作为一只投资于上证科创板综合指数的被动投资管理产品，我们继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的上证科创板综合指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，合规风控设置，建立禁限投库，合规培训，合规承诺书签署等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、提供处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化 监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应合规检查报告及其后续改进跟踪。同时聘请并配合外部审计机构完成公司及基金的审计、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等项目。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动发现并解决各项法律文件以及实务运作中存在的潜在法律风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，持续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关

指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]100Z0690 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“嘉实上证科创板综合 ETF 基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实上证科创板综合 ETF 基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于嘉实上证科创板综合 ETF 基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实上证科创板综合 ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实上证科创板综合 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实上证科创板综合 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实上证科创板综合 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导

任	<p>致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实上证科创板综合 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实上证科创板综合 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔡晓慧 柴瀚英
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2026年3月26日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

		2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,088,786.93
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	109,565,927.96
其中：股票投资		109,534,343.77
基金投资		-
债券投资		31,584.19
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		110,654,714.89
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		12,570.32
应付托管费		4,190.09
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	127,726.00

负债合计		144,486.41
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	77,582,547.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	32,927,681.48
净资产合计		110,510,228.48
负债和净资产总计		110,654,714.89

注：本基金合同生效日为 2025 年 04 月 09 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 04 月 09 日起至 2025 年 12 月 31 日止。报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4244 元，基金份额总额 77,582,547.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		50,998,765.03
1. 利息收入		43,246.17
其中：存款利息收入	7.4.7.13	43,246.17
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）		36,513,026.73
其中：股票投资收益	7.4.7.14	36,009,890.94
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	29,968.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	473,167.16
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	14,430,853.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	11,639.12
减：二、营业总支出		311,347.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	137,356.27
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	45,785.40

3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	128,205.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		50,687,417.49
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,687,417.49
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		50,687,417.49

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	445,582,547.00	-	-	445,582,547.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-368,000,000.0 0	-	32,927,681.48	-335,072,318.52
（一）、综合收益总额	-	-	50,687,417.49	50,687,417.49
（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）	-368,000,000.0 0	-	-17,759,736.01	-385,759,736.01
其中：1. 基金申购款	228,000,000.00	-	29,241,494.77	257,241,494.77
2. 基金赎回款	-596,000,000.0 0	-	-47,001,230.78	-643,001,230.78
（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	77,582,547.00	-	32,927,681.48	110,510,228.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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]218号《关于准予嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实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《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2025年4月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为445,582,547.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

7.4.2 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。

7.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025

年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,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) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金,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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应

取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每份基金份额享有同等分配权；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；本基金收益分配采取现金方式；基金管理人有权根据实际情况决定是否进行收益分配，但满足以下条件，本基金每季度至少进行一次收益分配：每季度最后一个交易日对基金相对标的指数的超额收益率进行评价：当超额收益率大于 0 时，本基金将进行收益分配，收益分配比例不低于超额收益率的 60%，基金管理人将在次季度起的 15 个工作日内拟定收益分配方案；当超额收益率小于或等于 0 时，本基金将不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据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，基金确定以下类别股票投资和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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对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。

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

(5) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	383,527.19
等于：本金	383,490.23
加：应计利息	36.96
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	705,259.74
等于：本金	705,234.11
加：应计利息	25.63
减：坏账准备	-
合计	1,088,786.93

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	95,108,073.96	-	109,534,343.77	14,426,269.81

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	27,000.00	0.99	31,584.19	4,583.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	27,000.00	0.99	31,584.19	4,583.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	95,135,073.96	0.99	109,565,927.96	14,430,853.01	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	127,726.00
合计	127,726.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	445,582,547.00	445,582,547.00
本期申购	228,000,000.00	228,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-596,000,000.00	-596,000,000.00
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	77,582,547.00	77,582,547.00

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2025 年 04 月 09 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 445,582,547.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,547.00 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	36,256,564.48	14,430,853.01	50,687,417.49
本期基金份额交易产生的变动数	-5,771,239.31	-11,988,496.70	-17,759,736.01
其中：基金申购款	27,330,131.70	1,911,363.07	29,241,494.77
基金赎回款	-33,101,371.01	-13,899,859.77	-47,001,230.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,485,325.17	2,442,356.31	32,927,681.48

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	7,569.00
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,387.15
结算备付金利息收入	-
其他	31,290.02
合计	43,246.17

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,552,745.18
股票投资收益——赎回差价收入	29,457,145.76
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	36,009,890.94

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	121,364,909.73
减：卖出股票成本总额	114,579,582.51

减：交易费用	232,582.04
买卖股票差价收入	6,552,745.18

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
赎回基金份额对价总额	643,001,230.78
减：现金支付赎回款总额	1,128,670.33
减：赎回股票成本总额	612,415,414.69
减：交易费用	-
赎回差价收入	29,457,145.76

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	6.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,962.57
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	29,968.63

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	75,970.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	46,000.00
减：应计利息总额	5.08
减：交易费用	3.04
买卖债券差价收入	29,962.57

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
----	--------------------------------------

股票投资产生的股利收益	473,167.16
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	473,167.16

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1. 交易性金融资产	14,430,853.01
股票投资	14,426,269.81
债券投资	4,583.20
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	14,430,853.01

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,639.12
合计	11,639.12

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	18,000.00
信息披露费	109,726.00
证券出借违约金	-

其他	400.00
存托服务费	79.87
合计	128,205.87

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2026 年 1 月 16 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0190 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司
嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“嘉实上证科创板综合 ETF 联接”）	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	137,356.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	21,836.72
应支付基金管理人的净管理费	115,519.55

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	45,785.40

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例(%)
嘉实上证科创板综合ETF联接	49,990,700.00	64.44

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

7.4.10.6 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 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司_活期	383,527.19	7,569.00

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日), 本基金未实施利润分配。根据相关法律法规以及本基金收益分配政策, 本基金向截至2026年1月16日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配, 每10份基金份额派发红利0.0190元。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股锁定	46.68	55.66	27	1,260.36	1,502.82	-
603175	超	2025	6个月	新股	17.08	48.56	62	1,058.96	3,010.72	-

	颖电子	2025年10月17日		锁定						
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股锁定	10.10	16.30	88	888.80	1,434.40	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股锁定	10.88	28.10	114	1,240.32	3,203.40	-
603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股锁定	24.49	32.82	41	1,004.09	1,345.62	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股锁定	18.60	46.35	50	930.00	2,317.50	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股锁定	12.55	26.21	78	978.90	2,044.38	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股锁定	23.60	40.16	48	1,132.80	1,927.68	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股锁定	46.36	59.06	29	1,344.44	1,712.74	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股锁定	14.99	34.87	159	2,383.41	5,544.33	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股锁定	8.45	24.28	257	2,171.65	6,239.96	-
688790	昂瑞微	2025年12月9日	9个月	新股锁定	83.06	117.07	290	24,087.40	33,950.30	-
688795	摩	2025	9个月	新股	114.28	416.02	345	39,426.60	143,526.90	-

	尔 线 程	年 11 月 26 日		锁定						
688796	百 奥 赛 图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股 锁定	26.68	42.25	88	2,347.84	3,718.00	-
688805	健 信 超 导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股 锁定	18.58	32.37	109	2,025.22	3,528.33	-
688807	优 迅 股 份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股 锁定	51.66	135.56	41	2,118.06	5,557.96	-
688809	强 一 股 份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股 锁定	85.09	203.31	29	2,467.61	5,895.99	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位 ： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
118063	金 05 转 债	2025 年 12 月 26 日	1 个月 内（含）	新 债 未 上 市	100.00	100.00	190	19,000.00	19,000.29	-

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，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

7.4.12.2 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
688012	中 微 公 司	2025 年 12 月 19 日	重 大 事 项 停 牌	272.72	2026 年 1 月 5 日	278.00	7,233	1,646,814.86	1,972,583.76	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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。

7.4.13.2 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	-
AAA 以下	31,584.19
未评级	-
合计	31,584.19

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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上述比例限制)。

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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,088,786.93	-	-	-	1,088,786.93
结算备付金	-	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	31,584.19	109,534,343.77	109,565,927.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,088,786.93	-	31,584.19	109,534,343.77	110,654,714.89
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	12,570.32	12,570.32
应付托管费	-	-	-	4,190.09	4,190.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	127,726.00	127,726.00
负债总计	-	-	-	144,486.41	144,486.41
利率敏感度缺口	1,088,786.93	-	31,584.19	109,389,857.36	110,510,228.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2025年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-467.24
	市场利率下降25个基点	475.51

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2025年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-

7.4.13.4.3 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。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、债券及基金，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	109,534,343.77	99.12
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	109,534,343.77	99.12

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	5,169,818.63
	业绩比较基准下降5%	-5,169,818.63

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025年12月31日
第一层次	107,347,882.88
第二层次	1,991,584.05
第三层次	226,461.03
合计	109,565,927.96

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公

允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月9日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	86,866.46	86,866.46
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	139,594.57	139,594.57
其中：计入损益的利得或损失	-	139,594.57	139,594.57
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	226,461.03	226,461.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	139,594.57	139,594.57

注：1. 本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	226,461.03	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	18.00%-295.88%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

7.4.14.4 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告**8.1 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	109,534,343.77	98.99
	其中：股票	109,534,343.77	98.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,584.19	0.03
	其中：债券	31,584.19	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,088,786.93	0.98
8	其他各项资产	-	-
9	合计	110,654,714.89	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**8.2.1 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	86,554,621.00	78.32
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	20,733,066.66	18.76
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	1,714,444.03	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	305,751.05	0.28
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	109,307,882.74	98.91

8.2.2 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	222,743.03	0.20
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	3,718.00	0.00
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	226,461.03	0.20

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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	4,900	6,642,195.00	6.01
2	688041	海光信息	27,138	6,090,038.58	5.51
3	688981	中芯国际	23,347	2,867,712.01	2.59
4	688012	中微公司	7,233	1,972,583.76	1.78
5	688111	金山办公	5,375	1,650,501.25	1.49
6	688008	澜起科技	13,253	1,561,203.40	1.41
7	688506	百利天恒	4,797	1,549,910.70	1.40
8	688271	联影医疗	9,662	1,212,581.00	1.10
9	688775	影石创新	4,707	1,105,674.30	1.00
10	688072	拓荆科技	3,268	1,078,440.00	0.98
11	688082	盛美上海	5,592	984,471.60	0.89
12	688183	生益电子	9,627	921,207.63	0.83
13	688036	传音控股	13,288	879,134.08	0.80
14	688521	芯原股份	6,064	830,586.08	0.75
15	688396	华润微	15,370	812,458.20	0.74
16	688126	沪硅产业	37,284	806,825.76	0.73
17	688249	晶合集成	23,458	778,571.02	0.70
18	688702	盛科通信	4,871	690,171.99	0.62
19	688110	东芯股份	5,224	686,172.40	0.62
20	688303	大全能源	25,039	671,545.98	0.61
21	688223	晶科能源	116,747	658,453.08	0.60
22	688469	芯联集成	97,923	655,104.87	0.59
23	688375	国博电子	6,944	646,555.84	0.59
24	688472	阿特斯	43,058	641,994.78	0.58
25	688498	源杰科技	998	640,706.02	0.58
26	688047	龙芯中科	4,781	631,617.91	0.57
27	688120	华海清科	4,183	627,784.64	0.57
28	688361	中科飞测	4,034	617,161.66	0.56

29	688525	佰维存储	5,360	615,274.40	0.56
30	688585	上纬新材	4,739	603,606.43	0.55
31	688027	国盾量子	1,146	577,343.34	0.52
32	688122	西部超导	7,519	560,767.02	0.51
33	688568	中科星图	9,483	559,497.00	0.51
34	688009	中国通号	100,665	550,637.55	0.50
35	688629	华丰科技	5,489	549,229.34	0.50
36	688578	艾力斯	5,224	544,079.60	0.49
37	688002	睿创微纳	5,263	530,510.40	0.48
38	688347	华虹公司	4,860	524,248.20	0.47
39	688187	时代电气	10,181	522,183.49	0.47
40	688387	信科移动	39,855	514,129.50	0.47
41	688676	金盘科技	5,437	491,178.58	0.44
42	688608	恒玄科技	2,160	490,190.40	0.44
43	688313	仕佳光子	5,443	483,229.54	0.44
44	688188	柏楚电子	3,521	478,468.69	0.43
45	688172	燕东微	16,515	477,944.10	0.43
46	688169	石头科技	3,122	474,731.32	0.43
47	688019	安集科技	2,161	470,925.12	0.43
48	688385	复旦微电	6,365	469,100.50	0.42
49	689009	九号公司	8,278	460,174.02	0.42
50	688777	中控技术	9,218	454,816.12	0.41
51	688778	厦钨新能	5,874	454,471.38	0.41
52	688728	格科微	30,369	453,712.86	0.41
53	688017	绿的谐波	2,337	448,937.70	0.41
54	688234	天岳先进	5,013	445,555.44	0.40
55	688213	思特威	4,598	437,223.82	0.40
56	688099	晶晨股份	4,958	432,486.34	0.39
57	688336	三生国健	7,237	431,108.09	0.39
58	688322	奥比中光	4,784	428,981.28	0.39
59	688617	惠泰医疗	1,762	428,641.74	0.39
60	688538	和辉光电	161,118	428,573.88	0.39
61	688599	天合光能	25,466	421,462.30	0.38
62	688065	凯赛生物	8,298	413,240.40	0.37
63	688318	财富趋势	3,076	407,016.32	0.37
64	688278	特宝生物	4,795	401,245.60	0.36
65	688615	合合信息	1,751	398,492.58	0.36
66	688220	翱捷科技	4,754	392,727.94	0.36
67	688297	中无人机	7,884	378,589.68	0.34
68	688037	芯源微	2,541	377,363.91	0.34
69	688819	天能股份	11,214	372,529.08	0.34
70	688333	铂力特	3,235	360,734.85	0.33
71	688349	三一重能	14,209	359,203.52	0.33

72	688018	乐鑫科技	2,043	347,310.00	0.31
73	688295	中复神鹰	10,539	345,784.59	0.31
74	688102	斯瑞新材	8,915	345,367.10	0.31
75	688709	成都华微	7,464	343,269.36	0.31
76	688147	微导纳米	5,451	342,268.29	0.31
77	688692	达梦数据	1,302	340,173.54	0.31
78	688343	云天励飞	4,264	324,405.12	0.29
79	688200	华峰测控	1,702	323,720.40	0.29
80	688270	臻镭科技	2,637	321,898.59	0.29
81	688433	华曙高科	4,855	321,255.35	0.29
82	688582	芯动联科	4,783	316,204.13	0.29
83	688425	铁建重工	62,306	315,891.42	0.29
84	688331	荣昌生物	4,055	315,438.45	0.29
85	688192	迪哲医药	5,464	314,726.40	0.28
86	688563	航材股份	5,201	303,998.45	0.28
87	688180	君实生物	8,883	303,443.28	0.27
88	688235	百济神州	1,128	302,980.80	0.27
89	688114	华大智造	4,892	297,237.92	0.27
90	688536	思瑞浦	1,855	296,577.40	0.27
91	688005	容百科技	8,365	296,121.00	0.27
92	688248	南网科技	6,533	292,286.42	0.26
93	688708	佳驰科技	4,676	291,081.00	0.26
94	688208	道通科技	7,864	289,395.20	0.26
95	688266	泽璟制药	3,112	288,482.40	0.26
96	688561	奇安信	8,005	284,817.90	0.26
97	688048	长光华芯	2,259	283,165.65	0.26
98	688772	珠海冠宇	13,107	282,193.71	0.26
99	688205	德科立	2,045	281,146.60	0.25
100	688052	纳芯微	1,775	280,769.50	0.25
101	688475	萤石网络	9,219	277,584.09	0.25
102	688301	奕瑞科技	2,661	269,053.71	0.24
103	688523	航天环宇	4,707	263,403.72	0.24
104	688698	伟创电气	2,661	263,119.68	0.24
105	688660	电气风电	15,402	261,988.02	0.24
106	688123	聚辰股份	2,057	258,318.06	0.23
107	688363	华熙生物	5,743	250,854.24	0.23
108	688146	中船特气	6,169	249,227.60	0.23
109	688766	普冉股份	1,948	247,805.08	0.22
110	688166	博瑞医药	4,985	244,564.10	0.22
111	688449	联芸科技	5,360	242,164.80	0.22
112	688281	华秦科技	3,272	241,473.60	0.22
113	688409	富创精密	3,558	239,809.20	0.22
114	688353	华盛锂电	2,068	235,131.60	0.21

115	688088	虹软科技	4,743	234,778.50	0.21
116	688630	芯碁微装	1,738	233,813.14	0.21
117	688400	凌云光	5,465	231,606.70	0.21
118	688519	南亚新材	2,799	226,327.14	0.20
119	688141	杰华特	5,206	226,096.58	0.20
120	688627	精智达	1,011	226,049.49	0.20
121	688195	腾景科技	1,312	222,449.60	0.20
122	688100	威胜信息	5,643	221,769.90	0.20
123	688548	广钢气体	15,235	221,516.90	0.20
124	688567	孚能科技	14,132	221,165.80	0.20
125	688520	神州细胞	5,101	220,924.31	0.20
126	688798	艾为电子	2,892	220,110.12	0.20
127	688668	鼎通科技	1,745	216,380.00	0.20
128	688800	瑞可达	2,591	215,053.00	0.19
129	688652	京仪装备	2,163	212,644.53	0.19
130	688006	杭可科技	7,157	209,628.53	0.19
131	688484	南芯科技	5,085	206,756.10	0.19
132	688116	天奈科技	4,282	201,896.30	0.18
133	688388	嘉元科技	4,902	200,883.96	0.18
134	688097	博众精工	5,314	200,603.50	0.18
135	688279	峰昭科技	970	197,385.30	0.18
136	688029	南微医学	2,387	194,683.72	0.18
137	688502	茂莱光学	487	194,337.35	0.18
138	688372	伟测科技	1,765	192,543.85	0.17
139	688131	皓元医药	2,610	188,128.80	0.17
140	688789	宏华数科	2,286	186,469.02	0.17
141	688153	唯捷创芯	4,946	186,167.44	0.17
142	688503	聚和材料	3,020	184,220.00	0.17
143	688127	蓝特光学	4,776	183,828.24	0.17
144	688062	迈威生物	4,763	183,232.61	0.17
145	688382	益方生物	6,719	183,025.56	0.17
146	688390	固德威	2,921	181,481.73	0.16
147	688432	有研硅	14,412	178,852.92	0.16
148	688206	概伦电子	5,107	177,876.81	0.16
149	688300	联瑞新材	2,863	177,763.67	0.16
150	688352	颀中科技	13,768	173,614.48	0.16
151	688327	云从科技	11,964	171,922.68	0.16
152	688726	拉普拉斯	4,737	170,532.00	0.15
153	688779	五矿新能	22,594	169,229.06	0.15
154	688584	上海合晶	7,635	167,511.90	0.15
155	688516	奥特维	3,697	167,326.22	0.15
156	688167	炬光科技	947	165,791.29	0.15
157	688306	均普智能	14,187	164,569.20	0.15

158	688239	航宇科技	2,428	164,302.76	0.15
159	688612	威迈斯	4,965	163,696.05	0.15
160	688063	派能科技	2,869	163,016.58	0.15
161	688198	佰仁医疗	1,523	162,976.23	0.15
162	688403	汇成股份	9,947	162,931.86	0.15
163	688543	国科军工	2,599	161,319.93	0.15
164	688068	热景生物	994	161,028.00	0.15
165	688001	华兴源创	5,311	160,285.98	0.15
166	688439	振华风光	2,449	158,205.40	0.14
167	688549	中巨芯	17,326	158,013.12	0.14
168	688332	中科蓝讯	1,195	156,915.45	0.14
169	688362	甬矽电子	4,726	153,169.66	0.14
170	688605	先锋精科	2,375	152,617.50	0.14
171	688380	中微半导	4,738	152,326.70	0.14
172	688686	奥普特	1,224	151,935.12	0.14
173	688050	爱博医疗	2,452	148,738.32	0.13
174	688158	优刻得	5,272	148,090.48	0.13
175	688233	神工股份	2,092	146,502.76	0.13
176	688025	杰普特	1,031	145,958.67	0.13
177	688160	步科股份	953	145,332.50	0.13
178	688003	天准科技	2,454	144,540.60	0.13
179	688552	航天南湖	3,976	144,408.32	0.13
180	688631	莱斯信息	2,118	144,193.44	0.13
181	688559	海目星	2,979	143,170.74	0.13
182	688165	埃夫特	6,000	142,560.00	0.13
183	688083	中望软件	2,090	142,349.90	0.13
184	688522	纳睿雷达	3,539	141,312.27	0.13
185	688326	经纬恒润	1,199	140,882.50	0.13
186	688531	日联科技	2,133	140,841.99	0.13
187	688055	龙腾光电	38,777	139,597.20	0.13
188	688128	中国电研	4,799	139,554.92	0.13
189	688513	苑东生物	2,266	139,472.30	0.13
190	688321	微芯生物	4,746	138,678.12	0.13
191	688788	科思科技	2,052	138,181.68	0.13
192	688182	灿勤科技	4,594	135,614.88	0.12
193	688161	威高骨科	4,797	133,932.24	0.12
194	688107	安路科技	4,797	130,382.46	0.12
195	688031	星环科技	1,201	129,936.19	0.12
196	688028	沃尔德	2,002	129,209.08	0.12
197	688289	圣湘生物	6,830	129,155.30	0.12
198	688351	微电生理	5,570	128,945.50	0.12
199	688150	莱特光电	4,756	128,554.68	0.12
200	688228	开普云	660	128,442.60	0.12

201	688717	艾罗能源	2,073	127,696.80	0.12
202	688392	骄成超声	1,135	127,347.00	0.12
203	688700	东威科技	3,580	126,302.40	0.11
204	688626	翔宇医疗	2,077	125,658.50	0.11
205	688499	利元亨	2,176	125,598.72	0.11
206	688739	成大生物	4,873	125,528.48	0.11
207	688032	禾迈股份	1,240	124,979.60	0.11
208	688690	纳微科技	4,817	124,326.77	0.11
209	688776	国光电气	1,227	123,607.98	0.11
210	688577	浙海德曼	1,272	123,205.92	0.11
211	688319	欧林生物	4,833	122,564.88	0.11
212	688093	世华科技	3,310	121,973.50	0.11
213	688691	灿芯股份	1,194	121,764.12	0.11
214	688125	安达智能	899	121,409.95	0.11
215	688591	泰凌微	2,846	121,125.76	0.11
216	688262	国芯科技	3,970	120,489.50	0.11
217	688586	江航装备	9,213	120,137.52	0.11
218	688658	悦康药业	5,297	119,765.17	0.11
219	688091	上海谊众	2,533	119,051.00	0.11
220	688139	海尔生物	3,737	118,761.86	0.11
221	688443	智翔金泰	4,327	117,867.48	0.11
222	688049	炬芯科技	2,238	117,718.80	0.11
223	688190	云路股份	1,201	116,977.40	0.11
224	688539	高华科技	2,354	116,546.54	0.11
225	688210	统联精密	2,087	115,452.84	0.10
226	688408	中信博	2,711	114,160.21	0.10
227	688656	浩欧博	742	114,119.60	0.10
228	688401	路维光电	2,338	114,117.78	0.10
229	688562	航天软件	4,756	113,573.28	0.10
230	688016	心脉医疗	1,238	113,475.08	0.10
231	688177	百奥泰	4,854	112,321.56	0.10
232	688106	金宏气体	5,720	112,054.80	0.10
233	688222	成都先导	4,778	112,044.10	0.10
234	688368	晶丰明源	961	110,928.23	0.10
235	688593	新相微	5,445	109,880.10	0.10
236	688556	高测股份	9,621	109,871.82	0.10
237	688109	品茗科技	855	108,670.50	0.10
238	688750	金天钛业	5,422	108,277.34	0.10
239	688596	正帆科技	3,400	107,542.00	0.10
240	688257	新锐股份	3,034	104,005.52	0.09
241	688661	和林微纳	1,997	103,364.72	0.09
242	688209	英集芯	5,161	102,910.34	0.09
243	688366	昊海生科	2,342	102,813.80	0.09

244	688348	昱能科技	2,039	102,745.21	0.09
245	688138	清溢光电	3,644	102,615.04	0.09
246	688007	光峰科技	5,452	101,243.64	0.09
247	688418	震有科技	2,328	101,221.44	0.09
248	688685	迈信林	1,822	101,084.56	0.09
249	688252	天德钰	4,746	100,472.82	0.09
250	688261	东微半导	1,223	100,298.23	0.09
251	688486	龙迅股份	1,348	100,169.88	0.09
252	688066	航天宏图	3,056	99,503.36	0.09
253	688625	呈和科技	2,387	98,344.40	0.09
254	688311	盟升电子	2,148	97,948.80	0.09
255	688535	华海诚科	871	97,621.68	0.09
256	688518	联赢激光	4,012	97,451.48	0.09
257	688275	万润新能	1,278	96,361.20	0.09
258	688550	瑞联新材	2,114	95,785.34	0.09
259	688611	杭州柯林	1,862	94,682.70	0.09
260	688575	亚辉龙	6,665	94,643.00	0.09
261	688570	天玛智控	5,097	93,886.74	0.08
262	688603	天承科技	1,251	93,774.96	0.08
263	688105	诺唯赞	4,682	93,733.64	0.08
264	688108	赛诺医疗	4,858	93,467.92	0.08
265	688507	索辰科技	930	93,269.70	0.08
266	688258	卓易信息	1,216	93,109.12	0.08
267	688191	智洋创新	2,889	92,968.02	0.08
268	688648	中邮科技	1,502	92,312.92	0.08
269	688232	新点软件	3,719	92,305.58	0.08
270	688225	亚信安全	4,758	92,305.20	0.08
271	688276	百克生物	4,858	91,621.88	0.08
272	688305	科德数控	1,464	90,475.20	0.08
273	688639	华恒生物	2,748	89,529.84	0.08
274	688456	有研粉材	1,149	89,277.30	0.08
275	688553	汇宇制药	5,014	89,199.06	0.08
276	688383	新益昌	1,137	88,992.99	0.08
277	688636	智明达	2,059	88,207.56	0.08
278	688515	裕太微	858	87,987.90	0.08
279	688337	普源精电	2,354	86,839.06	0.08
280	688377	迪威尔	2,360	86,612.00	0.08
281	688095	福昕软件	959	85,609.93	0.08
282	688035	德邦科技	1,764	85,113.00	0.08
283	688227	品高股份	1,303	84,708.03	0.08
284	688226	威腾电气	2,280	84,588.00	0.08
285	688365	光云科技	5,013	84,569.31	0.08
286	688711	宏微科技	2,661	84,433.53	0.08

287	688230	芯导科技	1,163	84,294.24	0.08
288	688510	航亚科技	3,116	83,820.40	0.08
289	688202	美迪西	1,485	83,754.00	0.08
290	688196	卓越新能	1,404	82,695.60	0.07
291	688707	振华新材	5,939	82,255.15	0.07
292	688526	科前生物	5,360	81,793.60	0.07
293	688151	华强科技	3,951	81,469.62	0.07
294	688378	奥来德	2,984	81,463.20	0.07
295	688221	前沿生物	4,495	81,134.75	0.07
296	688508	芯朋微	1,328	80,875.20	0.07
297	688697	纽威数控	5,230	80,437.40	0.07
298	688488	艾迪药业	4,923	80,392.59	0.07
299	688219	会通股份	6,436	79,935.12	0.07
300	688277	天智航	5,260	79,899.40	0.07
301	688621	阳光诺和	1,284	79,800.60	0.07
302	688696	极米科技	711	79,262.28	0.07
303	688325	赛微微电	899	78,689.47	0.07
304	688236	春立医疗	3,434	78,569.92	0.07
305	688710	益诺思	1,766	77,968.90	0.07
306	688787	海天瑞声	672	77,945.28	0.07
307	688136	科兴制药	2,454	77,718.18	0.07
308	688117	圣诺生物	2,047	77,356.13	0.07
309	688112	鼎阳科技	2,063	77,259.35	0.07
310	688186	广大特材	3,384	76,749.12	0.07
311	688176	亚虹医药	6,646	76,495.46	0.07
312	688231	隆达股份	2,942	76,492.00	0.07
313	688155	先惠技术	1,258	76,046.10	0.07
314	688601	力芯微	1,775	75,597.25	0.07
315	688386	泛亚微透	862	75,511.20	0.07
316	688566	吉贝尔	2,519	75,192.15	0.07
317	688046	药康生物	4,872	74,833.92	0.07
318	688376	美埃科技	1,288	74,472.16	0.07
319	688320	禾川科技	1,990	74,266.80	0.07
320	688767	博拓生物	1,956	73,897.68	0.07
321	688119	中钢洛耐	13,188	73,720.92	0.07
322	688157	松井股份	2,031	73,583.13	0.07
323	688598	金博股份	2,506	73,576.16	0.07
324	688087	英科再生	2,386	73,536.52	0.07
325	688733	壹石通	2,531	73,348.38	0.07
326	688334	西高院	3,787	73,316.32	0.07
327	688371	菲沃泰	3,960	73,141.20	0.07
328	688143	长盈通	1,430	71,800.30	0.06
329	688085	三友医疗	3,978	71,683.56	0.06

330	688173	希荻微	4,875	71,662.50	0.06
331	688011	新光光电	1,118	71,373.12	0.06
332	688678	福立旺	2,944	71,185.92	0.06
333	688622	禾信仪器	702	70,993.26	0.06
334	688059	华锐精密	901	70,908.70	0.06
335	688185	康希诺	1,128	70,894.80	0.06
336	688359	三孚新科	1,062	70,761.06	0.06
337	688381	帝奥微	3,082	70,300.42	0.06
338	688135	利扬芯片	2,529	70,205.04	0.06
339	688721	龙图光罩	1,483	69,003.99	0.06
340	688268	华特气体	1,202	68,982.78	0.06
341	688663	新风光	1,773	68,739.21	0.06
342	688588	凌志软件	4,797	68,645.07	0.06
343	688505	复旦张江	8,240	68,392.00	0.06
344	688290	景业智能	1,135	67,464.40	0.06
345	688339	亿华通	2,487	67,049.52	0.06
346	688084	晶品特装	804	66,571.20	0.06
347	688389	普门科技	5,121	66,470.58	0.06
348	688360	德马科技	3,099	65,884.74	0.06
349	688308	欧科亿	2,081	65,842.84	0.06
350	688720	艾森股份	930	65,453.40	0.06
351	688212	澳华内镜	1,497	65,433.87	0.06
352	688010	福光股份	2,096	65,227.52	0.06
353	688197	首药控股	1,873	65,068.02	0.06
354	688101	三达膜	3,948	64,905.12	0.06
355	688315	诺禾致源	4,871	64,686.88	0.06
356	688428	诺诚健华	3,140	64,432.80	0.06
357	688293	奥浦迈	1,312	64,288.00	0.06
358	688683	莱尔科技	2,015	63,875.50	0.06
359	688267	中触媒	2,262	63,720.54	0.06
360	688399	硕世生物	930	63,705.00	0.06
361	688330	宏力达	1,762	63,661.06	0.06
362	688799	华纳药厂	1,332	63,536.40	0.06
363	688103	国力电子	1,033	62,589.47	0.06
364	688168	安博通	825	62,007.00	0.06
365	688429	时创能源	4,718	61,758.62	0.06
366	688533	上声电子	2,105	61,550.20	0.06
367	688512	慧智微	5,493	61,301.88	0.06
368	688653	康希通信	5,044	61,284.60	0.06
369	688489	三未信安	1,327	60,657.17	0.05
370	688312	燕麦科技	1,809	60,022.62	0.05
371	688020	方邦股份	880	59,857.60	0.05
372	688682	霍莱沃	1,126	59,576.66	0.05

373	688716	中研股份	1,405	59,501.75	0.05
374	688280	精进电动	6,817	59,307.90	0.05
375	688292	浩瀚深度	2,045	59,305.00	0.05
376	688298	东方生物	2,530	59,277.90	0.05
377	688299	长阳科技	3,499	59,203.08	0.05
378	688595	芯海科技	1,803	59,138.40	0.05
379	688609	九联科技	5,782	59,034.22	0.05
380	688073	毕得医药	959	58,546.95	0.05
381	688023	安恒信息	1,138	58,504.58	0.05
382	688569	铁科轨道	2,646	58,132.62	0.05
383	688282	理工导航	914	58,039.00	0.05
384	688590	新致软件	3,072	57,323.52	0.05
385	688478	晶升股份	1,518	56,788.38	0.05
386	688356	键凯科技	689	56,635.80	0.05
387	688201	信安世纪	3,800	55,594.00	0.05
388	688687	凯因科技	2,204	54,923.68	0.05
389	688090	瑞松科技	1,234	54,888.32	0.05
390	688606	奥泰生物	857	54,753.73	0.05
391	688410	山外山	3,653	54,685.41	0.05
392	688079	美迪凯	4,814	54,494.48	0.05
393	688015	交控科技	2,389	54,421.42	0.05
394	688623	二元科技	579	54,368.10	0.05
395	688480	赛恩斯	1,055	54,321.95	0.05
396	688722	同益中	2,769	54,133.95	0.05
397	688620	安凯微	4,483	53,975.32	0.05
398	688665	四方光电	1,106	53,939.62	0.05
399	688302	海创药业	1,090	53,595.30	0.05
400	688459	哈铁科技	5,544	53,499.60	0.05
401	688335	复洁科技	1,966	53,003.36	0.05
402	688699	明微电子	1,246	52,967.46	0.05
403	688269	凯立新材	1,322	52,893.22	0.05
404	688379	华光新材	954	52,527.24	0.05
405	688602	康鹏科技	6,008	52,149.44	0.05
406	688581	安杰思	881	51,653.03	0.05
407	688253	英诺特	1,711	51,637.98	0.05
408	688148	芳源股份	5,881	51,576.37	0.05
409	688677	海泰新光	1,191	51,403.56	0.05
410	688579	山大地纬	4,756	51,269.68	0.05
411	688247	宣泰医药	5,262	51,041.40	0.05
412	688323	瑞华泰	2,267	51,030.17	0.05
413	688580	伟思医疗	1,047	50,674.80	0.05
414	688458	美芯晟	1,277	50,620.28	0.05
415	688070	纵横股份	909	50,358.60	0.05

416	688786	悦安新材	1,783	50,298.43	0.05
417	688416	恒烁股份	911	50,223.43	0.05
418	688089	嘉必优	2,156	50,191.68	0.05
419	688238	和元生物	7,521	50,089.86	0.05
420	688719	爱科赛博	1,130	49,889.50	0.05
421	688033	天宜新材	6,455	49,703.50	0.04
422	688283	坤恒顺维	1,233	49,689.90	0.04
423	688075	安旭生物	1,273	49,226.91	0.04
424	688199	久日新材	2,087	49,190.59	0.04
425	688039	当虹科技	1,098	49,135.50	0.04
426	688179	阿拉丁	3,933	49,123.17	0.04
427	688317	之江生物	2,429	48,992.93	0.04
428	688291	金橙子	1,146	48,957.12	0.04
429	688509	正元地信	8,898	48,850.02	0.04
430	688500	慧辰股份	789	48,728.64	0.04
431	688244	永信至诚	1,981	48,415.64	0.04
432	688181	八亿时空	1,491	48,189.12	0.04
433	688159	有方科技	988	47,759.92	0.04
434	688662	富信科技	923	47,303.75	0.04
435	688133	泰坦科技	2,127	47,091.78	0.04
436	688273	麦澜德	1,106	47,027.12	0.04
437	688207	格灵深瞳	3,087	46,922.40	0.04
438	688162	巨一科技	1,503	46,292.40	0.04
439	688373	盟科药业	7,599	45,897.96	0.04
440	688152	麒麟信安	1,130	45,595.50	0.04
441	688255	凯尔达	1,244	45,567.72	0.04
442	688237	超卓航科	934	45,532.50	0.04
443	688171	纬德信息	974	45,446.84	0.04
444	688259	创耀科技	1,081	45,185.80	0.04
445	688215	瑞晟智能	618	44,811.18	0.04
446	688286	敏芯股份	546	43,106.70	0.04
447	688435	英方软件	916	42,841.32	0.04
448	688633	星球石墨	1,802	42,671.36	0.04
449	688175	高凌信息	1,322	42,581.62	0.04
450	688098	申联生物	4,740	42,091.20	0.04
451	688013	天臣医疗	873	41,973.84	0.04
452	688115	思林杰	636	41,708.88	0.04
453	688455	科捷智能	2,075	41,686.75	0.04
454	688557	兰剑智能	1,138	41,457.34	0.04
455	688030	山石网科	2,274	41,318.58	0.04
456	688589	力合微	1,816	41,314.00	0.04
457	688081	兴图新科	1,140	41,131.20	0.04
458	688610	埃科光电	664	41,041.84	0.04

459	688057	金达莱	3,335	40,753.70	0.04
460	688628	优利德	1,279	40,723.36	0.04
461	688211	中科微至	1,321	40,686.80	0.04
462	688657	浩辰软件	764	40,652.44	0.04
463	688077	大地熊	1,313	40,112.15	0.04
464	688246	嘉和美康	1,724	40,083.00	0.04
465	688768	容知日新	921	40,008.24	0.04
466	688080	映翰通	782	39,491.00	0.04
467	688307	中润光学	911	39,364.31	0.04
468	688607	康众医疗	918	39,290.40	0.04
469	688529	豪森智能	2,114	38,982.16	0.04
470	688679	通源环境	1,460	38,836.00	0.04
471	688558	国盛智科	1,327	38,390.11	0.03
472	688285	高铁电气	4,321	37,506.28	0.03
473	688600	皖仪科技	1,487	37,249.35	0.03
474	688689	银河微电	1,309	37,149.42	0.03
475	688419	耐科装备	1,320	36,946.80	0.03
476	688357	建龙微纳	1,116	36,883.80	0.03
477	688132	邦彦技术	1,999	36,821.58	0.03
478	688061	灿瑞科技	1,122	36,588.42	0.03
479	688398	赛特新材	2,148	36,516.00	0.03
480	688551	科威尔	986	36,314.38	0.03
481	688170	德龙激光	1,146	36,053.16	0.03
482	688571	杭华股份	4,839	36,050.55	0.03
483	688448	磁谷科技	741	35,916.27	0.03
484	688576	西山科技	567	35,698.32	0.03
485	688485	九州一轨	1,974	35,216.16	0.03
486	688560	明冠新材	2,447	34,967.63	0.03
487	688260	昀冢科技	1,211	34,876.80	0.03
488	688345	博力威	1,117	34,850.40	0.03
489	688613	奥精医疗	1,709	34,709.79	0.03
490	688651	盛邦安全	785	34,555.70	0.03
491	688370	丛麟科技	1,407	34,288.59	0.03
492	688265	南模生物	832	34,120.32	0.03
493	688479	友车科技	1,812	34,119.96	0.03
494	688468	科美诊断	4,605	33,800.70	0.03
495	688530	欧莱新材	2,052	33,734.88	0.03
496	688310	迈得医疗	2,176	33,358.08	0.03
497	688051	佳华科技	836	33,113.96	0.03
498	688358	祥生医疗	1,096	32,989.60	0.03
499	688618	三旺通信	1,236	32,951.76	0.03
500	688667	菱电电控	466	32,815.72	0.03
501	688251	井松智能	1,108	32,575.20	0.03

502	688501	青达环保	1,232	32,561.76	0.03
503	688669	聚石化学	1,396	32,443.04	0.03
504	688391	钜泉科技	1,141	32,324.53	0.03
505	688619	罗普特	2,376	32,313.60	0.03
506	688203	海正生材	2,527	32,295.06	0.03
507	688022	瀚川智能	2,098	32,099.40	0.03
508	688121	卓然股份	2,883	31,482.36	0.03
509	688597	煜邦电力	3,825	31,403.25	0.03
510	688350	富淼科技	1,199	30,850.27	0.03
511	688592	司南导航	749	30,783.90	0.03
512	688338	赛科希德	1,179	30,512.52	0.03
513	688496	清越科技	5,130	30,472.20	0.03
514	688426	康为世纪	1,272	30,311.76	0.03
515	688680	海优新材	785	30,026.25	0.03
516	688288	鸿泉技术	1,119	30,000.39	0.03
517	688113	联测科技	753	29,766.09	0.03
518	688328	深科达	1,017	29,676.06	0.03
519	688693	锆威特	789	29,540.16	0.03
520	688314	康拓医疗	891	29,456.46	0.03
521	688137	近岸蛋白	730	29,236.50	0.03
522	688069	德林海	1,297	29,091.71	0.03
523	688060	云涌科技	685	28,996.05	0.03
524	688718	唯赛勃	2,210	28,906.80	0.03
525	688369	致远互联	1,136	28,888.48	0.03
526	688670	金迪克	1,425	28,827.75	0.03
527	688026	洁特生物	1,751	28,208.61	0.03
528	688616	西力科技	2,295	28,067.85	0.03
529	688367	工大高科	899	27,833.04	0.03
530	688229	博睿数据	442	27,704.56	0.03
531	688045	必易微	714	27,624.66	0.02
532	688517	金冠电气	1,744	27,188.96	0.02
533	688695	中创股份	991	27,183.13	0.02
534	688163	赛伦生物	1,238	26,951.26	0.02
535	688737	中自科技	1,195	26,815.80	0.02
536	688218	江苏北人	1,167	26,630.94	0.02
537	688216	气派科技	1,192	26,557.76	0.02
538	688056	莱伯泰科	790	26,551.90	0.02
539	688071	华依科技	789	26,171.13	0.02
540	688189	南新制药	3,273	26,085.81	0.02
541	688316	青云科技	431	25,933.27	0.02
542	688272	富吉瑞	791	25,834.06	0.02
543	688655	迅捷兴	1,476	25,283.88	0.02
544	688130	晶华微	1,206	25,253.64	0.02

545	688118	普元信息	973	24,830.96	0.02
546	688129	东来技术	1,214	24,559.22	0.02
547	688573	信宇人	1,069	24,362.51	0.02
548	688395	正弦电气	999	24,295.68	0.02
549	688393	安必平	1,009	23,903.21	0.02
550	688178	万德斯	974	23,405.22	0.02
551	688528	秦川物联	2,146	23,112.42	0.02
552	688092	爱科科技	901	22,651.14	0.02
553	688355	明志科技	1,269	22,588.20	0.02
554	688096	京源环保	2,855	22,554.50	0.02
555	688193	仁度生物	466	22,540.42	0.02
556	688058	宝兰德	817	22,246.91	0.02
557	688420	美腾科技	918	21,912.66	0.02
558	688565	力源科技	1,953	21,854.07	0.02
559	688450	光格科技	768	21,181.44	0.02
560	688078	龙软科技	759	20,872.50	0.02
561	688671	碧兴物联	841	20,831.57	0.02
562	688681	科汇股份	1,166	20,498.28	0.02
563	688466	金科环境	1,255	20,418.85	0.02
564	688038	中科通达	1,153	20,373.51	0.02
565	688309	恒誉环保	842	20,317.46	0.02
566	688004	博汇科技	852	19,706.76	0.02
567	688638	誉辰智能	537	19,509.21	0.02
568	688659	元琛科技	2,056	19,429.20	0.02
569	688793	倍轻松	890	19,402.00	0.02
570	688329	艾隆科技	821	17,479.09	0.02
571	688156	路德科技	1,077	17,242.77	0.02
572	688067	爱威科技	682	16,749.92	0.02
573	688021	奥福科技	790	14,496.50	0.01
574	688217	睿昂基因	528	13,912.80	0.01
575	688296	和达科技	1,033	13,687.25	0.01
576	688701	卓锦股份	1,494	12,176.10	0.01

8.3.2 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	688795	摩尔线程	345	143,526.90	0.13
2	688790	昂瑞微	290	33,950.30	0.03
3	688729	屹唐股份	257	6,239.96	0.01
4	688809	强一股份	29	5,895.99	0.01
5	688807	优迅股份	41	5,557.96	0.01
6	688727	恒坤新材	159	5,544.33	0.01
7	688796	百奥赛图	88	3,718.00	0.00
8	688805	健信超导	109	3,528.33	0.00

9	603262	技源集团	114	3,203.40	0.00
10	603175	超颖电子	62	3,010.72	0.00
11	603370	华新精科	50	2,317.50	0.00
12	603376	大明电子	78	2,044.38	0.00
13	603406	天富龙	48	1,927.68	0.00
14	603418	友升股份	29	1,712.74	0.00
15	603092	德力佳	27	1,502.82	0.00
16	603248	锡华科技	88	1,434.40	0.00
17	603334	丰倍生物	41	1,345.62	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	25,360,628.32	22.95
2	688256	寒武纪	21,305,448.16	19.28
3	688981	中芯国际	12,831,162.13	11.61
4	688111	金山办公	10,109,016.30	9.15
5	688012	中微公司	8,549,729.40	7.74
6	688506	百利天恒	8,240,623.63	7.46
7	688271	联影医疗	7,657,629.18	6.93
8	688036	传音控股	6,841,041.50	6.19
9	688008	澜起科技	5,900,327.63	5.34
10	688052	纳芯微	5,118,841.71	4.63
11	688047	龙芯中科	4,621,864.15	4.18
12	688617	惠泰医疗	4,303,655.42	3.89
13	688608	恒玄科技	4,300,789.62	3.89
14	688169	石头科技	4,276,877.93	3.87
15	688396	华润微	4,262,753.39	3.86
16	688223	晶科能源	4,259,108.37	3.85
17	688188	柏楚电子	3,861,031.57	3.49
18	688120	华海清科	3,760,094.48	3.40
19	688126	沪硅产业	3,683,007.32	3.33
20	688072	拓荆科技	3,593,727.49	3.25
21	688200	华峰测控	3,479,026.86	3.15
22	688082	盛美上海	3,478,306.73	3.15
23	688521	芯原股份	3,430,324.41	3.10
24	688017	绿的谐波	3,381,694.02	3.06
25	688009	中国通号	3,303,747.34	2.99
26	688301	奕瑞科技	3,177,653.50	2.88
27	688249	晶合集成	3,145,979.37	2.85
28	689009	九号公司	3,126,358.56	2.83
29	688213	思特威	3,077,736.74	2.79
30	688318	财富趋势	3,055,904.22	2.77

31	688220	翱捷科技	2,957,055.94	2.68
32	688065	凯赛生物	2,912,722.46	2.64
33	688578	艾力斯	2,899,343.55	2.62
34	688303	大全能源	2,825,945.83	2.56
35	688187	时代电气	2,716,373.96	2.46
36	688777	中控技术	2,685,323.59	2.43
37	688114	华大智造	2,610,708.99	2.36
38	688728	格科微	2,608,439.08	2.36
39	688198	佰仁医疗	2,600,846.18	2.35
40	688278	特宝生物	2,542,745.75	2.30
41	688235	百济神州	2,519,213.87	2.28
42	688027	国盾量子	2,514,579.69	2.28
43	688469	芯联集成	2,430,139.97	2.20
44	688472	阿特斯	2,425,905.27	2.20
45	688037	芯源微	2,417,271.99	2.19
46	688266	泽璟制药	2,375,640.08	2.15
47	688375	国博电子	2,352,009.05	2.13
48	688050	爱博医疗	2,326,548.45	2.11
49	688702	盛科通信	2,300,667.83	2.08
50	688099	晶晨股份	2,296,434.85	2.08
51	688599	天合光能	2,267,173.37	2.05

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	3,775,727.89	3.42
2	688608	恒玄科技	3,077,241.46	2.78
3	688617	惠泰医疗	2,990,771.96	2.71
4	688235	百济神州	2,323,890.31	2.10
5	688027	国盾量子	2,229,711.25	2.02
6	688018	乐鑫科技	1,931,972.69	1.75
7	688019	安集科技	1,818,672.60	1.65
8	688279	峰昭科技	1,576,749.03	1.43
9	688332	中科蓝讯	1,385,924.80	1.25
10	688190	云路股份	1,290,667.88	1.17
11	688536	思瑞浦	1,275,478.20	1.15
12	688498	源杰科技	1,239,694.30	1.12
13	688326	经纬恒润	1,185,231.61	1.07
14	688502	茂莱光学	1,178,420.41	1.07
15	688068	热景生物	951,287.78	0.86
16	688032	禾迈股份	913,173.63	0.83
17	688256	寒武纪	910,270.04	0.82
18	688686	奥普特	833,065.17	0.75
19	688083	中望软件	827,785.98	0.75

20	688016	心脉医疗	818,928.61	0.74
----	--------	------	------------	------

8.4.3 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	566,478,861.96
卖出股票收入（成交）总额	121,364,909.73

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
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）	31,584.19	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,584.19	0.03

8.6 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	118063	金 05 转债	190	19,000.29	0.02
2	118062	天准转债	80	12,583.90	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 只债券。

8.7 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

无。

8.8 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

无。

8.9 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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

无。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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	688012	中微公司	1,972,583.76	1.78	重大事项停牌

8.12.5.2 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	688795	摩尔线程	143,526.90	0.13	新股锁定
2	688790	昂瑞微	33,950.30	0.03	新股锁定
3	688729	屹唐股份	6,239.96	0.01	新股锁定
4	688809	强一股份	5,895.99	0.01	新股锁定
5	688807	优迅股份	5,557.96	0.01	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
985	78,764.01	52,129,147.00	67.19	25,453,400.00	32.81

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实上证科创板综合交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金	49,990,700.00	64.44

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	孙香	1,284,800.00	1.66
2	中信证券股份有限公司	1,251,600.00	1.61
3	尹丽萍	1,000,000.00	1.29
4	黄政权	958,000.00	1.23
5	中国国际金融股份有 限公司	867,347.00	1.12
6	薛志强	825,900.00	1.06
7	潘彰	800,000.00	1.03
8	霍超	557,400.00	0.72
9	林颂华	500,000.00	0.64
10	李晓明	355,500.00	0.46
11	嘉实上证科创板综合 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	49,990,700.00	64.44

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 4 月 9 日）基 金份额总额	445,582,547.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	228,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	596,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金 拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	77,582,547.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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）基金管理人的重大人事变动情况

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

2025 年 7 月 5 日本基金管理人发布公告，李明先生离任财务负责人，经雷先生任财务负责人（兼）。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2025 年 11 月 5 日，根据工作安排，黄伟先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）职务，聘任宋菁女士为平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为 2025 年 4 月 9 日。报告年度应支付容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 18,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 3 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、公司治理
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司子公司管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面完成整改，并向北京证监局提交了整改完成情况报告。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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 (%)	
方正证券股份有限公司	3	687,488,304.06	100.00	127,867.41	100.00	新增

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 合规风控能力较强；
- (4) 交易服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

11.7.2 基金租用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(%)
方正证券股份有限公司	75,970.69	100.00	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加中信建投等为嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金网下现金认购销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025年3月24日
2	关于嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金延长募集期的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025年3月28日
3	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025年4月10日
4	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025年4月14日
5	嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025年4月14日
6	嘉实上证科创板综合交易型开放式指	证券时报、基金管理人	2025年4月17日

	数证券投资基金上市交易提示性公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员 变更公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
8	嘉实基金管理有限公司高级管理人员 变更公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2025 年 7 月 5 日
9	嘉实上证科创板综合交易型开放式指 数证券投资基金溢价风险提示及停牌 公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2025 年 7 月 28 日
10	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分 上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的 公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2025 年 11 月 17 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时 间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份 额 占 比 (%)
机构	1	2025-04-09 至 2025-04-29	-	100,007, 611.00	100,007,6 11.00	-	-
联接基 金	1	2025-06-13 至 2025-12-31	-	380,517, 600.00	330,526,9 00.00	49,990,700.00	64.44
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司, 咨询电话 400-600-8800, 或发 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 3 月 30 日