

# 汇添富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：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 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。

本报告期自 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）起至 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 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	16
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 .....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	20
4.9 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 .....	21
§ 5 托管人报告 .....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	21
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 .....	21
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 .....	21
§ 6 审计报告 .....	21
6.1 审计报告的基本信息 .....	21
6.2 审计报告的基本内容 .....	22
§ 7 年度财务报表 .....	23
7.1 资产负债表 .....	24
7.2 利润表 .....	25
7.3 净资产变动表 .....	26
7.4 报表附注 .....	27
§ 8 投资组合报告 .....	54
8.1 期末基金资产组合情况 .....	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	55

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	86
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.....	86
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.....	87
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.....	87
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.....	87
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	87
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	87
8.12 投资组合报告附注.....	87
§ 9 基金份额持有人信息.....	88
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	88
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	88
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	89
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.....	89
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	89
§ 10 开放式基金份额变动 .....	89
§ 11 重大事件揭示 .....	90
11.1 基金份额持有人大会决议.....	90
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.....	90
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	90
11.4 基金投资策略的改变.....	90
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	90
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	90
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	92
11.8 其他重大事件 .....	93
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	95
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	96
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	97
§ 13 备查文件目录 .....	97
13.1 备查文件目录 .....	97
13.2 存放地点 .....	98
13.3 查阅方式 .....	98

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富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	汇添富上证科创板综合 ETF
场内简称	科创综 E
基金主代码	589080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 02 月 26 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	213,061,000.00
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 03 月 05 日

注：扩位证券简称：科创综指 ETF 汇添富。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。</p> <p>在特殊情形下，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。</p> <p>本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。</p>
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，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，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	汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9918	400-61-95555
传真		021-28932998	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		鲁伟铭	缪建民

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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 02 月 26 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	97,415,285.11
本期利润	134,502,989.58
加权平均基金份额本期利润	0.2689
本期加权平均净值利润率	25.85%
本期基金份额净值增长率	30.25%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	64,454,132.10
期末可供分配基金份额利润	0.3025
期末基金资产净值	277,515,132.10
期末基金份额净值	1.3025
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	30.25%

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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），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、本基金的《基金合同》生效日为 2025 年 02 月 26 日，至本报告期末未满一年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2025 年 12 月 31 日数据，特此说明。

### 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	-4.69%	1.62%	-4.68%	1.63%	-0.01%	-0.01%
过去六个月	32.68%	1.67%	33.08%	1.68%	-0.40%	-0.01%
自基金合同生效起至今	30.25%	1.72%	29.24%	1.77%	1.01%	-0.05%

#### 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

汇添富上证科创板综合ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

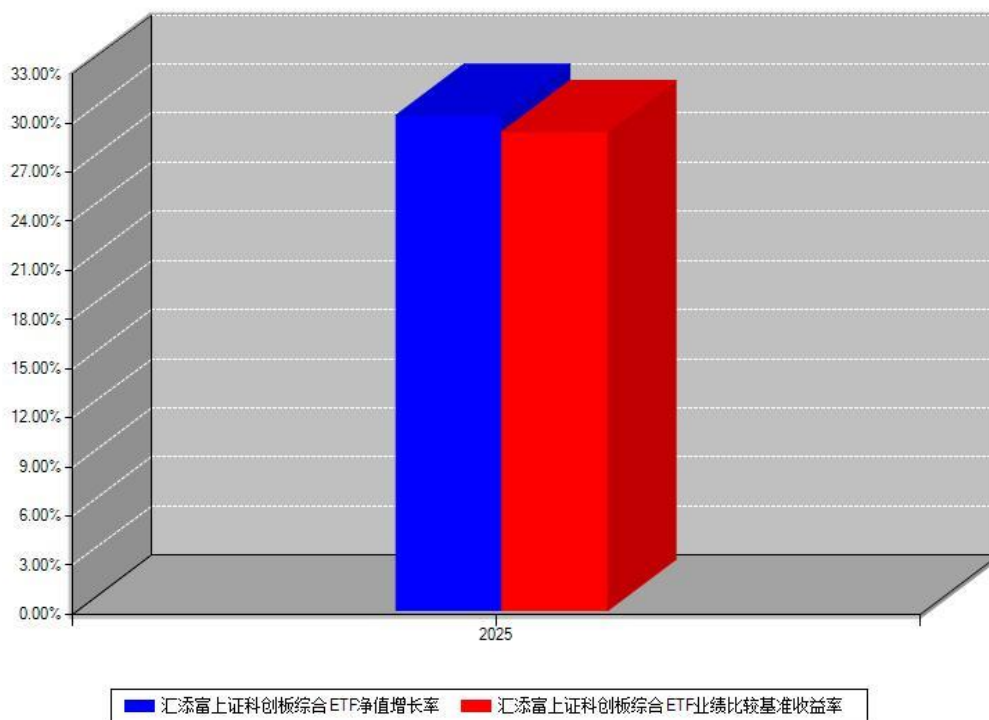


注：本《基金合同》生效之日为2025年02月26日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起6个月，截至本报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

### 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

汇添富上证科创板综合ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 02 月 26 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 02 月 26 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

## § 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国、新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司、汇添富资产管理(新加坡)有限公司、汇添富基金销售(上海)有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基

金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问、公募证券投资基金销售等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2025 年，汇添富基金新成立 54 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 12 月 31 日，汇添富基金共管理 395 只公募基金，涵盖股票型基金、指数型基金、QDII 基金、混合型基金、债券型基金、REITs 基金及货币市场基金等各类产品。

2025 年，汇添富基金持续坚持以客户为中心，以提升投资者长期回报为核心导向，持续完善投顾式服务体系，强化全流程投资陪伴与资产配置能力。公司互联网金融业务围绕数字化转型，依托大数据与 AI 等技术，持续优化平台功能与服务流程，提升客户触达效率与服务精准度。同时，汇添富基金持续深耕互联网平台合作，丰富投教内容与工具供给，通过线上线下融合、内容创新与场景化运营，打造更开放、协同的服务生态，更好满足客户多元化、个性化的投资需求，持续提升客户体验与满意度。

2025 年，汇添富基金坚持金融服务实体经济本源，秉持“一切从长期出发”和“客户第一”的经营理念，以高质量发展为核心，持续提升投资者的获得感。在客户服务方面，公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略。公司深化组织变革，通过团队专业化分工，持续提升客户服务及产品运营能力。公司坚定推进与核心机构客户的合作战略，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位，同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。在产品策略上，公司优化产品布局并夯实底层资产布局，构建多元化、多层次的产品矩阵，满足匹配各类机构投资者的差异化配置需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合规模持续增加。在数字化建设方面，强化科技赋能，加速数字化转型，深化人工智能（AI）技术在业务全流程的应用，在运营效能与服务质量上取得突破，持续为客户及团队赋能。

2025 年，汇添富渠道业务坚持“一切从长期出发、客户第一”原则，围绕提升“客户获得感”开展各项业务合作和产品布局。顺应行业净值化转型与居民稳健理财需求，以固收

+产品为核心，深化银行渠道融合与科技赋能，实现高质量增长。将基金产品精准匹配银行客户多元资产配置需求，助力客户优化风险收益结构。银行渠道深化国有行、股份行战略合作，围绕客户全生命周期理财需求，打造专属资产配置方案。全年线下投教活动 7786 场，覆盖超 50 万人次；线上升级 AI 工具与数字化内容矩阵，全流程赋能银行渠道，获合作伙伴高度认可。

2025 年，汇添富基金持续深化券商专业化服务。全年紧扣机构客户核心需求，打造“添富投资月度策略会”、“云调研固收+基金专题”等系列调研活动；同时面向渠道客户，在全国范围内开展多场投顾赋能培训，助力券商夯实资产配置能力、优化客户服务体系。为拓宽投资者交流渠道，部门全年落地超 300 场线下活动，涵盖“指能添富”、“渠道赋能千场行”及“走进汇添富”等特色活动。秉持“客户第一”的理念，汇添富基金通过为券商提供全流程专业支持，推动优质服务触达更广泛的投资者群体。

2025 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，进一步完善服务体系建设，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2025 年，汇添富香港子公司持续深化与母公司的两地一体化运营及垂直化管理模式，核心业务实现跨越式增长，客户覆盖范围进一步拓宽，客群基础进一步夯实。在产品线维度，公司立足权益投资的核心专长，新增多个主动管理权益专户，同时固定收益与权益类资产规模同步攀升，核心产品竞争力持续凸显。至此，公司境外产品线已形成境外权益、固定收益、货币市场的多元布局，为投资者全球资产分散配置提供了坚实支撑。下一步香港子公司将继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2025 年以来，汇添富基金积极开展公益慈善工作，充分发挥公募基金优势，践行社会责任，为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十七年开展“河流·孩子”公益助学项目，举办第十八期乡村优秀青年教师培训和第八届乡村教育管理研习班，助力乡村教育高质量发展；参与中国慈善联合会《慈善组织投资管理指南》团体标准起草，启动“基业上善”慈善资产管理研修营第二期项目，发布《基金会慈善资产管理委员会指南（试行）》，用专业力量推动公益慈善事业可持续发展；发起第三期“致敬城市建设者”公益项目、汇爱社区支持计划一期，助力上海的社区发展，为人民城市增添温度；通过捐赠驰援香港火灾救援工作，与香港同胞共渡难关；参加云南、青海、内蒙古等地产业和教育帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2026 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
罗昊	本基金的基金经理	2025 年 02 月 26 日	-	9	国籍：中国。学历：上海交通大学工学学士、美国东北大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 6 月至 2019 年 3 月就职于上海游马地投资中心（有限合伙），2019 年 6 月至 2023 年 11 月就职于威廉欧奈尔投资管理（上海）有限公司。2023 年 12 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月 11 日至 2025 年 10 月 24 日任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）的基金

					<p>经理。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月 11 日至 2025 年 10 月 24 日任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 1 月 20 日至今任汇添富上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 2 月 21 日至今任汇添富中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 2 月 26 日至今任汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月 19 日至 2025 年 5 月 12 日任汇添富上证科创板 100 指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 25 日至今任汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接</p>
--	--	--	--	--	--

					<p>基金的基金经 理。2025 年 4 月 25 日至今任 汇添富上证科创 板 100 交易型开 放式指数证券投 资基金的基金经 理。2025 年 4 月 29 日至今任 汇添富中证光伏 产业交易型开放 式指数证券投资 基金发起式联接 基金的基金经 理。2025 年 5 月 13 日至今任 汇添富上证科创 板 100 交易型开 放式指数证券投资 基金联接基金 的基金经理。 2025 年 6 月 5 日至今任汇添富 上证科创板新材 料交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2025 年 7 月 16 日至今任汇添富 国证通用航空产 业交易型开放式 指数证券投资基 金的基金经理。 2025 年 8 月 5 日至今任汇添富 上证科创板 50 成份交易型开放 式指数证券投资 基金发起式联接 基金的基金经 理。2025 年 8 月 18 日至今任 汇添富中证信息 技术应用创新产</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 8 月 19 日至今任汇添富创业板指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 9 月 10 日至今任汇添富上证科创板创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月 21 日至今任汇添富国证通用航空产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 12 月 16 日至今任汇添富上证科创板 200 指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

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

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,

力争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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标

的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2025 年，A 股市场表现优异。上半年，市场在存量博弈中反复探底，经历了短暂

的流动性冲击与预期修正；随着三季度政策组合拳的重磅出击，市场信心迎来根本性逆转，宽基指数实现修复性普涨。进入四季度，市场在理性回归中完成了由情绪驱动向基本面驱动的平稳切换。全年来看，流动性拐点与政策发力点形成共振，资金面由守转攻。风格上，以人工智能、高端制造、创新药为代表的“新质生产力”成为贯穿全年的核心主线，在此背景下，市场不仅完成了估值的系统性抬升，更确立了科技成长占优的中期逻辑。

宏观经济方面，2025 年是中国经济在新旧动能转换中的关键之年。全年经济运行呈现“前低后高、由稳向好”的态势，顺利完成既定增长目标。上半年，面对复杂的外部环境与内需不足的挑战，经济保持了极强的韧性；下半年，随着财政发力与货币宽松的协同效应释放，政策托底向政策引领转变。消费市场在“以旧换新”等扩内需政策刺激下逐步走出低谷，服务消费与实物消费双轮驱动；制造业投资持续领跑，尤其是高技术制造业和装备制造业增加值增速显著快于大盘，彰显了产业链升级的成效。房地产市场在经历深度调整后，于 2025 年年末初现止跌企稳曙光，经济发展的质量与效益显著提升。

放眼全球，2025 年是全球货币政策的关键之年。随着通胀压力的实质性缓解，美联储领衔开启降息周期，全球流动性环境由紧缩转向宽松，显著缓解了新兴市场的估值压力。尽管地缘政治冲突与贸易摩擦仍带来间歇性扰动，但并未改变全球经济温和复苏的大趋势。人工智能技术的产业化落地成为驱动全球增长的新引擎。欧洲与亚太地区虽复苏节奏不一，但在全球供应链重构与技术革新的浪潮中，各自寻找到了新的平衡点。全球资产配置逻辑也随之重塑，风险偏好显著回升，权益类资产重新成为配置重心。

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，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 30.25%，同期业绩比较基准收益率为 29.24%。

#### 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，随着宏观经济复苏的基础更加牢固，企业盈利周期的上行将接力估值修复，成为驱动市场的核心力量。流动性方面，在美联储降息周期与国内稳健货币政策的共振下，市场流动性将保持充裕，且资金性质将更加长线化、机构化，为权益资产提供持续的增量资金。

产业层面，“新质生产力”的演绎将从概念导入迈向产业落地深水区，科技成长仍是贯穿全年的最强音。随着人工智能从云端向端侧加速渗透，算力基础设施与应用场景将迎来新一轮爆发；商业航天与卫星互联网作为高端制造的新名片，有望在政策护航下开启商业化元年；生物医药与创新药板块在经历漫长的调整后，将在国际化突破与投融资环境改善的双重利好下迎来价值回归。与此同时，新能源等前期赛道在完成产能出清与格局优化后，亦存在显著的困境反转机会。2026年的产业投资将更加注重技术落地的确定性与供需格局的改善。

全球视野下，2026年将是人民币资产在全球资产配置中地位显著提升的一年。在全球经济增速放缓与地缘政治复杂化的背景下，中国经济的稳定性与产业链的完整性将成为稀缺的避险属性。随着美元指数的趋势性回落，新兴市场货币压力缓解，外资回流趋势将更加明确。尽管外部环境仍存变数，但在国内内需扩容与产业升级的确定性趋势下，中国资产有望继续延续较好的表现。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规管理

公司以党的二十届四中全会精神为指导，全面响应公募基金高质量发展行动方案，持续完善合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

##### 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有

效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

### 3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 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、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

## 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；基金管理人可对基金相对标的指数的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金

收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

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	安永华明（2026）审字第 70015647_B343 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	汇添富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>我们审计了汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 2 月 26 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，后附的汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 2 月 26 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值变动情况。</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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券</p>

	<p>投资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	<p>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，就可能导致对汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资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汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	戴唯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2026 年 03 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：汇添富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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	1,909,105.25
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	275,769,686.86
其中：股票投资		275,530,180.35
基金投资		-
债券投资		239,506.51
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		-
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	7.4.7.6	-
资产总计		277,678,792.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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		36,494.52
应付托管费		12,164.83
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-

应交税费		0.66
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.7	115,000.00
负债合计		163,660.01
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.8	213,061,000.00
未分配利润	7.4.7.9	64,454,132.10
净资产合计		277,515,132.10
负债和净资产总计		277,678,792.11

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3025 元，基金份额总额 213,061,000.00 份。

2、本基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2025 年 12 月 31 日数据，特此说明。

## 7.2 利润表

会计主体：汇添富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 02 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合 同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>135,483,673.62</b>
1. 利息收入		137,723.88
其中：存款利息收入	7.4.7.10	137,723.88
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）		98,126,385.60
其中：股票投资收益	7.4.7.11	95,193,263.69
基金投资收益	7.4.7.12	-
债券投资收益	7.4.7.13	93.41
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	2,933,028.50
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）	7.4.7.18	37,087,704.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	131,859.67
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>980,684.04</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	647,969.12
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	215,989.71
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	7.4.7.20	-
7. 税金及附加		0.43
8. 其他费用	7.4.7.21	116,724.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>134,502,989.58</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>134,502,989.58</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>134,502,989.58</b>

注：本基金合同于2025年02月26日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富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02月26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02月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,493,061,000.00	-	1,493,061,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,280,000,000.00	64,454,132.10	-1,215,545,867.90
（一）、综合收益总额	-	134,502,989.58	134,502,989.58
（二）、本期基金	-1,280,000,000.00	-70,048,857.48	-1,350,048,857.48

份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	590,000,000.00	33,715,420.04	623,715,420.04
2. 基金赎回款	-1,870,000,000.00	-103,764,277.52	-1,973,764,277.52
(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	213,061,000.00	64,454,132.10	277,515,132.10

注：本基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

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>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</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

汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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〕126 号文《关于准予汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2025 年 2 月 17 日起至 2025 年 2 月 21 日，首次募集扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,493,061,000.00 元，在募集期间产生的利息为人民币 82,767.72 元，全部归入基金财产，以上有效认购资金合计为人民币 1,493,143,767.72 元，折合 1,493,061,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015647\_B05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

### 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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于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。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;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的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 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。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本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和金融负债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，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 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，且该种法定权利现在是可执行的，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的基金份额总额所对应的金额。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。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期

间计入当期损益。

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

1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配采用现金分红;

3、每一基金份额享有同等分配权;

4、基金管理人可对基金相对标的指数的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价,当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时,基金管理人可进行收益分配;

5、当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时,基于本基金的特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时,本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

6、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让

方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

## 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、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》，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，继续免征增值税直至债券到期。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都

应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

#### 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	112,163.39
等于：本金	112,160.73
加：应计利息	2.66

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	1,796,941.86
等于：本金	1,796,913.05
加：应计利息	28.81
减：坏账准备	-
合计	1,909,105.25

注：其他存款余额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	238,513,885.48	-	275,530,180.35	37,016,294.87	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	168,000.00	96.91	239,506.51	71,409.60
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	168,000.00	96.91	239,506.51	71,409.60
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	238,681,885.48	96.91	275,769,686.86	37,087,704.47	

#### 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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 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	-
应付审计费	45,000.00
应付信息披露费	70,000.00
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	115,000.00

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 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	1,493,061,000.00	1,493,061,000.00
本期申购	590,000,000.00	590,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,870,000,000.00	-1,870,000,000.00
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	213,061,000.00	213,061,000.00

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 02 月 26 日生效，募集期间净认购人民币金额为 1,493,061,000.00 元，基金合同生效日的人民币基金份额总额为 1,493,061,000.00 份，其中认购资金利息折合 0.00 份人民币基金份额。

#### 7.4.7.9 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	-	-	-
本期利润	97,415,285.11	37,087,704.47	134,502,989.58
本期基金份额交易产生的变动数	-31,733,412.14	-38,315,445.34	-70,048,857.48
其中：基金申购款	33,425,154.44	290,265.60	33,715,420.04
基金赎回款	-65,158,566.58	-38,605,710.94	-103,764,277.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,681,872.97	-1,227,740.87	64,454,132.10

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	135,157.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,566.28
结算备付金利息收入	-

其他	-
合计	137,723.88

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	11,595,315.93
股票投资收益——赎回差价收入	83,597,947.76
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	95,193,263.69

##### 7.4.7.11.2 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02月26日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
卖出股票成交总额	282,863,826.39
减：卖出股票成本总额	270,630,976.36
减：交易费用	637,534.10
买卖股票差价收入	11,595,315.93

##### 7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	1,973,764,277.52
减：现金支付赎回款总额	-4,861,821.53
减：赎回股票成本总额	1,895,028,151.29
减：交易费用	-
赎回差价收入	83,597,947.76

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	93.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及 债券到期兑付）差价收入	-
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	93.41

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金无赎回差价收入。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	2,933,028.50
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	2,933,028.50

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1. 交易性金融资产	37,087,704.47
——股票投资	37,016,294.87
——债券投资	71,409.60
——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	-
——期货投资	-
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	37,087,704.47

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年02月26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	131,859.67
其他	-
合计	131,859.67

#### 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	915.63
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	400.00
上市费	-
或有管理费	-
其他	409.15
合计	116,724.78

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司

汇添富基金销售（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富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	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	2,066,756,986.34	100.00

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	363,717.53	100.00	-	-

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金

支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 02 月 26 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	647,969.12
其中：应支付销售机构的客户维护费	203,189.42
应支付基金管理人的净管理费	444,779.70

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 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	215,989.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核

对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

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

##### 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

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

#### 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

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 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 (%)
东方证券股份有限公司	1,055,100.00	0.50
汇添富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	67,976,400.00	31.90

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 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 02 月 26 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

招商银行	112,163.39	135,157.60
东方证券	1,796,941.86	2,566.28

注：东方证券受托作为本基金的证券经纪商。上述存放于东方证券基金专用证券账户中的款项为证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 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
					-	-	-	-	-	
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	11 个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	520	52,000.00	52,000.80	

#### 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	中微半导体设备	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年01月05日	278.00	18,507	4,039,388.22	5,047,229.04	

#### 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

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于

具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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

利率风险是指基金的财务状况和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 个月以内	1- 3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,909,105.25	-	-	-	-	-	1,909,105.25
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	187,505.71	-	52,000.80	-	-	275,530,180.35	275,769,686.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,096,610.96	-	52,000.80	-	-	275,530,180.35	277,678,792.11
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	-	-	-	-	-	36,494.52	36,494.52

应付托管费	-	-	-	-	-	12,164.83	12,164.83
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.66	0.66
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	115,000.00	115,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	163,660.01	163,660.01
利率敏感度缺口	2,096,610.96	-	52,000.80	-	-	275,366,520.34	277,515,132.10

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金的金融资产以公允价值计量，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。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	275,530,180.35	99.28
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	239,506.51	0.09
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	275,769,686.86	99.37

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	上证科创板综合指数上涨 5%	13,377,004.36
	上证科创板综合指数下跌 5%	-13,377,004.36

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	270,670,457.02
第二层次	5,099,229.84
第三层次	-
合计	275,769,686.86

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业务等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

##### 7.4.14.3.2 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

注：本基金本报告期末不存在第三层次公允价值余额。

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	275,530,180.35	99.23
	其中：股票	275,530,180.35	99.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	239,506.51	0.09
	其中：债券	239,506.51	0.09
	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	1,909,105.25	0.69
8	其他各项资产	-	-
9	合计	277,678,792.11	100.00

### 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	217,911,649.41	78.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,528,692.47	18.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,298,918.31	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	790,920.16	0.29
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	275,530,180.35	99.28

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 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	寒武纪科技	12,386	16,789,842.30	6.05
2	688041	海光信息	68,293	15,325,632.13	5.52
3	688981	中芯国际	58,773	7,219,087.59	2.60
4	688012	中微半导体设备	18,507	5,047,229.04	1.82
5	688111	金山办公	13,599	4,175,844.93	1.50
6	688008	澜起科	33,656	3,964,676.80	1.43

		技			
7	688506	百利天恒药业	12,131	3,919,526.10	1.41
8	688271	联影医疗	24,159	3,031,954.50	1.09
9	688775	影石创新	11,820	2,776,518.00	1.00
10	688072	拓荆科技	8,305	2,740,650.00	0.99
11	688082	盛美上海半导体	14,199	2,499,733.95	0.90
12	688183	生益电子	24,496	2,344,022.24	0.84
13	688036	传音控股	33,838	2,238,722.08	0.81
14	688521	芯原微电子	15,464	2,118,104.08	0.76
15	688396	华润微电子	39,115	2,067,618.90	0.75
16	688126	上海硅产业集团	93,830	2,030,481.20	0.73
17	688249	晶合集成	59,095	1,961,363.05	0.71
18	688702	盛科通信	12,140	1,720,116.60	0.62
19	688110	东芯股份	13,073	1,717,138.55	0.62
20	688303	大全能源	62,986	1,689,284.52	0.61
21	688223	晶科能源	293,937	1,657,804.68	0.60
22	688469	芯联集成	246,518	1,649,205.42	0.59
23	688375	国博电子	17,494	1,628,866.34	0.59
24	688472	阿特斯阳光电力	108,361	1,615,662.51	0.58
25	688361	中科飞测	10,326	1,579,774.74	0.57
26	688498	源杰科技	2,454	1,575,443.46	0.57

27	688525	佰维存储	13,721	1,575,033.59	0.57
28	688120	华海清科	10,424	1,564,433.92	0.56
29	688047	龙芯中科	11,757	1,553,217.27	0.56
30	688027	科大国盾量子	2,976	1,499,279.04	0.54
31	688585	上纬新材	11,765	1,498,508.05	0.54
32	688122	西部超导	19,038	1,419,854.04	0.51
33	688568	中科星图公司	23,625	1,393,875.00	0.50
34	688009	中国通号	253,219	1,385,107.93	0.50
35	688578	艾力斯医药科技	13,295	1,384,674.25	0.50
36	688002	睿创微纳	13,505	1,361,304.00	0.49
37	688629	四川华丰科技	13,478	1,348,608.68	0.49
38	688187	时代电气	25,518	1,308,818.22	0.47
39	688347	华虹半导体公司	12,031	1,297,783.97	0.47
40	688387	中信科移动	100,425	1,295,482.50	0.47
41	688676	海南金盘智能科技	13,622	1,230,611.48	0.44
42	688172	燕东微电子股份	41,825	1,210,415.50	0.44
43	688313	仕佳光子	13,457	1,194,712.46	0.43
44	688169	石头科技	7,704	1,171,470.24	0.42
45	689009	九号公司	20,996	1,167,167.64	0.42
46	688188	上海柏楚电子	8,535	1,159,821.15	0.42

		科技			
47	688385	复旦微电	15,690	1,156,353.00	0.42
48	688777	中控技术	23,320	1,150,608.80	0.41
49	688778	厦钨新能源	14,781	1,143,605.97	0.41
50	688728	格科微有限公司	76,425	1,141,789.50	0.41
51	688213	思特威电子科技	11,910	1,132,521.90	0.41
52	688608	恒玄科技	4,983	1,130,842.02	0.41
53	688234	天岳先进	12,680	1,126,998.40	0.41
54	688336	三生国健	18,228	1,085,841.96	0.39
55	688019	安集科技	4,981	1,085,459.52	0.39
56	688538	和辉光电	405,993	1,079,941.38	0.39
57	688099	晶晨半导体	12,321	1,074,760.83	0.39
58	688322	奥比中光	11,822	1,060,078.74	0.38
59	688599	天合光能	64,049	1,060,010.95	0.38
60	688065	凯赛生物	21,163	1,053,917.40	0.38
61	688017	绿的谐波	5,446	1,046,176.60	0.38
62	688278	特宝生物	12,094	1,012,025.92	0.36
63	688617	惠泰医疗	4,148	1,009,083.96	0.36
64	688220	翱捷科技	12,214	1,008,998.54	0.36
65	688318	财富趋势	7,579	1,002,853.28	0.36
66	688819	天能电池集团股份	28,684	952,882.48	0.34

67	688297	中航无人 机	19,812	951,372.24	0.34
68	688615	合合信 息	4,124	938,539.92	0.34
69	688333	西安铂 力特	8,164	910,367.64	0.33
70	688349	三一重 能	35,922	908,108.16	0.33
71	688235	百济神 州	3,349	899,541.40	0.32
72	688102	陕西斯 瑞新材 股份	22,749	881,296.26	0.32
73	688295	中复神 鹰碳纤 维	26,542	870,843.02	0.31
74	688037	芯源微 电子	5,861	870,417.11	0.31
75	688692	达梦数 据	3,295	860,884.65	0.31
76	688709	成都华 微	18,634	856,977.66	0.31
77	688147	微导纳 米科技	13,508	848,167.32	0.31
78	688018	乐鑫科 技	4,960	843,200.00	0.30
79	688331	荣昌生 物	10,515	817,961.85	0.29
80	688433	华曙高 科	12,226	808,994.42	0.29
81	688343	云天励 飞股份	10,522	800,513.76	0.29
82	688425	铁建重 工	156,696	794,448.72	0.29
83	688582	芯动联 科	11,833	782,279.63	0.28
84	688192	迪哲医 药	13,451	774,777.60	0.28
85	688180	君实生 物	22,517	769,180.72	0.28
86	688563	航空材 料股份	13,113	766,454.85	0.28
87	688200	华峰测 控	3,988	758,517.60	0.27

88	688270	浙江臻镱科技股份	6,207	757,688.49	0.27
89	688114	华大智造	12,336	749,535.36	0.27
90	688005	容百科技	21,020	744,108.00	0.27
91	688248	南方电网电力科技	16,620	743,578.80	0.27
92	688708	佳驰科技	11,794	734,176.50	0.26
93	688208	道通科技	19,660	723,488.00	0.26
94	688266	泽璟制药	7,771	720,371.70	0.26
95	688772	珠海冠宇电池	33,288	716,690.64	0.26
96	688561	奇安信集团	20,056	713,592.48	0.26
97	688475	萤石网络	23,191	698,281.01	0.25
98	688660	电气风电	39,215	667,047.15	0.24
99	688523	航天环宇科技	11,915	666,763.40	0.24
100	688052	纳芯微电子	4,192	663,090.56	0.24
101	688195	腾景科技	3,885	658,701.75	0.24
102	688048	长光华芯	5,235	656,207.25	0.24
103	688536	思瑞浦股份	4,047	647,034.36	0.23
104	688205	德科立光电子	4,647	638,869.56	0.23
105	688146	中船派瑞特气	15,642	631,936.80	0.23
106	688698	伟创电气	6,317	624,624.96	0.23
107	688301	奕瑞科技股份	6,166	623,444.26	0.22
108	688363	华熙生物	14,186	619,644.48	0.22

109	688449	联芸科技	13,558	612,550.44	0.22
110	688166	博瑞生物医药	12,411	608,883.66	0.22
111	688409	富创精密	8,954	603,499.60	0.22
112	688627	精智达技术	2,694	602,351.46	0.22
113	688281	华秦科技实业	7,975	588,555.00	0.21
114	688123	聚辰半导体	4,676	587,212.08	0.21
115	688502	茂莱光学	1,471	587,002.55	0.21
116	688088	虹软科技	11,777	582,961.50	0.21
117	688141	杰华特微电子	13,170	571,973.10	0.21
118	688400	凌云光技术	13,477	571,155.26	0.21
119	688520	神州细胞集团公司	13,118	568,140.58	0.20
120	688100	威胜信息	14,454	568,042.20	0.20
121	688548	广钢气体股份	38,817	564,399.18	0.20
122	688567	孚能科技	36,018	563,681.70	0.20
123	688519	南亚新材料	6,872	555,669.92	0.20
124	688766	普冉半导体	4,358	554,381.18	0.20
125	688279	峰昭科技	2,648	538,841.52	0.19
126	688353	华盛锂电	4,724	537,118.80	0.19
127	688630	芯碁微装	3,881	522,110.93	0.19
128	688006	浙江杭可科技	17,766	520,366.14	0.19
129	688798	艾为电子	6,802	517,700.22	0.19
130	688388	嘉元科	12,522	513,151.56	0.18

		技			
131	688484	南芯科技	12,532	509,551.12	0.18
132	688668	鼎通科技	4,090	507,160.00	0.18
133	688116	天奈科技	10,672	503,184.80	0.18
134	688800	瑞可达连接系统	5,984	496,672.00	0.18
135	688097	博众精工科技	13,090	494,147.50	0.18
136	688652	京仪装备	4,984	489,977.04	0.18
137	688153	唯捷创芯	12,735	479,345.40	0.17
138	688372	伟测科技	4,393	479,232.37	0.17
139	688382	益方生物科技	17,134	466,730.16	0.17
140	688332	中科蓝讯	3,550	466,150.50	0.17
141	688127	蓝特光学	11,846	455,952.54	0.16
142	688432	有研硅	36,668	455,049.88	0.16
143	688131	皓元医药	6,306	454,536.48	0.16
144	688167	西安炬光科技	2,587	452,906.09	0.16
145	688062	迈威生物	11,743	451,753.21	0.16
146	688686	奥普特科技	3,630	450,591.90	0.16
147	688206	概伦电子	12,835	447,043.05	0.16
148	688390	固德威电源	7,188	446,590.44	0.16
149	688029	南微医学科技	5,471	446,214.76	0.16
150	688300	联瑞新材	7,140	443,322.60	0.16
151	688352	颀中科技	34,994	441,274.34	0.16

152	688503	聚和材料股份公司	7,210	439,810.00	0.16
153	688327	云从科技	30,452	437,595.24	0.16
154	688789	杭州宏华数码科技	5,351	436,481.07	0.16
155	688198	佰仁医疗科技	4,036	431,892.36	0.16
156	688726	拉普拉斯	11,968	430,848.00	0.16
157	688068	热景生物	2,654	429,948.00	0.15
158	688584	上海合晶硅材料	19,553	428,992.82	0.15
159	688779	五矿新能	56,544	423,514.56	0.15
160	688516	奥特维科技	9,323	421,958.98	0.15
161	688306	均普智能制造	36,242	420,407.20	0.15
162	688403	汇成股份	25,258	413,726.04	0.15
163	688612	威迈斯	12,401	408,860.97	0.15
164	688326	经纬恒润	3,471	407,842.50	0.15
165	688063	派能科技	7,149	406,206.18	0.15
166	688228	开普云信息科技	2,047	398,366.67	0.14
167	688160	步科自动化	2,603	396,957.50	0.14
168	688001	苏州华兴源创科技	13,104	395,478.72	0.14
169	688549	中巨芯科技	43,299	394,886.88	0.14
170	688362	甬矽电子	11,995	388,757.95	0.14
171	688025	杰普特光电	2,729	386,344.53	0.14

172	688031	星环科技	3,524	381,261.56	0.14
173	688380	中微半 导	11,826	380,205.90	0.14
174	688543	国科军 工	6,116	379,620.12	0.14
175	688158	优刻得 科技	13,506	379,383.54	0.14
176	688605	先锋精 科	5,867	377,013.42	0.14
177	688439	振华风 光	5,835	376,941.00	0.14
178	688239	贵州航 宇科技	5,530	374,215.10	0.13
179	688392	骄成超 声波	3,328	373,401.60	0.13
180	688032	禾迈股 份	3,689	371,814.31	0.13
181	688165	埃夫特 智能	15,415	366,260.40	0.13
182	688552	航天南 湖	9,917	360,185.44	0.13
183	688522	纳睿雷 达科技	8,859	353,739.87	0.13
184	688233	神工半 导体	5,045	353,301.35	0.13
185	688055	昆山龙 腾光电	98,072	353,059.20	0.13
186	688691	灿芯半 导体股 份	3,457	352,544.86	0.13
187	688559	海目星 激光	7,335	352,520.10	0.13
188	688050	爱博诺 德医疗	5,775	350,311.50	0.13
189	688321	微芯生 物	11,947	349,091.34	0.13
190	688182	灿勤科 技	11,744	346,682.88	0.12
191	688128	中国电 器研究 院	11,829	343,987.32	0.12
192	688190	云路先 进材料	3,517	342,555.80	0.12

		股份			
193	688083	中望软件	5,019	341,844.09	0.12
194	688003	天准科技	5,788	340,913.20	0.12
195	688016	心脉医疗	3,649	334,467.34	0.12
196	688631	莱斯信息	4,864	331,141.12	0.12
197	688161	威高骨科	11,745	327,920.40	0.12
198	688531	日联科技股份	4,906	323,943.18	0.12
199	688289	圣湘生物	17,115	323,644.65	0.12
200	688513	苑东生物	5,256	323,506.80	0.12
201	688150	莱特光电股份	11,931	322,494.93	0.12
202	688535	华海诚科新材料	2,870	321,669.60	0.12
203	688351	微创电生理股份	13,885	321,437.75	0.12
204	688107	安路科技	11,816	321,158.88	0.12
205	688125	安达智能	2,334	315,206.70	0.11
206	688788	科思科技	4,659	313,737.06	0.11
207	688577	海德曼装备	3,232	313,051.52	0.11
208	688739	成大生物	12,142	312,777.92	0.11
209	688700	东威科技	8,846	312,086.88	0.11
210	688776	国光电气	3,084	310,682.16	0.11
211	688690	纳微科技	11,892	306,932.52	0.11
212	688586	中航飞机装备	23,351	304,497.04	0.11
213	688319	欧林生	11,989	304,041.04	0.11

		物			
214	688591	泰凌微	7,125	303,240.00	0.11
215	688658	悦康药业	13,285	300,373.85	0.11
216	688093	世华科技	8,129	299,553.65	0.11
217	688262	苏州国芯科技	9,868	299,493.80	0.11
218	688261	东微半导体	3,627	297,450.27	0.11
219	688139	海尔生物	9,281	294,950.18	0.11
220	688717	艾罗能源	4,755	292,908.00	0.11
221	688486	龙迅股份	3,930	292,038.30	0.11
222	688443	智翔金泰	10,677	290,841.48	0.10
223	688028	沃尔德金刚石	4,504	290,688.16	0.10
224	688368	晶丰明源半导体	2,515	290,306.45	0.10
225	688091	上海谊众药业	6,175	290,225.00	0.10
226	688499	广东利元亨	5,007	289,004.04	0.10
227	688626	翔宇医疗	4,744	287,012.00	0.10
228	688109	品茗科技	2,239	284,576.90	0.10
229	688275	万润新能源	3,760	283,504.00	0.10
230	688177	百奥泰生物	12,236	283,141.04	0.10
231	688656	浩欧博生物	1,829	281,300.20	0.10
232	688562	航天软件股份	11,739	280,327.32	0.10
233	688603	天承科技	3,723	279,076.08	0.10
234	688222	成都先导	11,848	277,835.60	0.10

235	688556	高测科技股份	24,294	277,437.48	0.10
236	688401	路维光电	5,655	276,020.55	0.10
237	688539	高华科技	5,562	275,374.62	0.10
238	688106	金宏气体	14,044	275,121.96	0.10
239	688049	炬芯科技	5,188	272,888.80	0.10
240	688596	正帆科技	8,614	272,460.82	0.10
241	688258	江苏卓易信息科技	3,558	272,436.06	0.10
242	688750	湘投金天钛业	13,640	272,390.80	0.10
243	688593	新相微	13,443	271,279.74	0.10
244	688408	中信博新能源	6,411	269,967.21	0.10
245	688210	泛海统联精密制造	4,821	266,697.72	0.10
246	688138	清溢光电	9,362	263,633.92	0.09
247	688507	索辰科技	2,562	256,942.98	0.09
248	688252	天德钰科技	12,065	255,416.05	0.09
249	688366	昊海生物科技	5,810	255,059.00	0.09
250	688257	新锐股份	7,401	253,706.28	0.09
251	688007	光峰科技	13,627	253,053.39	0.09
252	688209	英集芯科技	12,634	251,921.96	0.09
253	688515	裕太微电子	2,456	251,862.80	0.09
254	688066	北京航天宏图	7,655	249,246.80	0.09
255	688418	震有科技	5,659	246,053.32	0.09
256	688518	联赢激光	10,084	244,940.36	0.09

		光股份			
257	688230	芯导科技	3,370	244,257.60	0.09
258	688305	科德数控	3,922	242,379.60	0.09
259	688648	中邮科技	3,901	239,755.46	0.09
260	688685	迈信林航空股份	4,307	238,952.36	0.09
261	688575	亚辉龙生物	16,800	238,560.00	0.09
262	688639	华恒生物	7,291	237,540.78	0.09
263	688508	芯朋微电子	3,878	236,170.20	0.09
264	688696	极米科技	2,118	236,114.64	0.09
265	688108	赛诺医疗科学	12,247	235,632.28	0.08
266	688570	天玛智控	12,743	234,726.06	0.08
267	688232	国泰新点软件	9,449	234,524.18	0.08
268	688095	福昕软件开发	2,614	233,351.78	0.08
269	688105	诺唯赞生物	11,655	233,333.10	0.08
270	688550	瑞联新材料	5,138	232,802.78	0.08
271	688456	有研粉材	2,995	232,711.50	0.08
272	688611	杭州柯林股份	4,570	232,384.50	0.08
273	688383	新益昌科技	2,965	232,070.55	0.08
274	688661	和林微纳科技	4,481	231,936.56	0.08
275	688348	昱能科技	4,602	231,894.78	0.08
276	688276	长春百克生物科技	12,253	231,091.58	0.08
277	688625	呈和科	5,607	231,008.40	0.08

		技			
278	688376	美埃科技	3,977	229,950.14	0.08
279	688386	泛亚微透	2,591	226,971.60	0.08
280	688155	先惠技术	3,738	225,962.10	0.08
281	688225	亚信安全	11,627	225,563.80	0.08
282	688311	盟升电子	4,885	222,756.00	0.08
283	688202	美迪西生物医药	3,947	222,610.80	0.08
284	688553	汇宇制药	12,452	221,521.08	0.08
285	688196	卓越新能	3,748	220,757.20	0.08
286	688636	智明达电子	5,098	218,398.32	0.08
287	688191	智洋创新科技	6,770	217,858.60	0.08
288	688622	禾信仪器	2,134	215,811.42	0.08
289	688325	赛微微电子	2,465	215,761.45	0.08
290	688227	品高股份	3,271	212,647.71	0.08
291	688526	武汉科前生物	13,827	211,000.02	0.08
292	688185	康希诺生物	3,356	210,924.60	0.08
293	688059	株洲华锐精密	2,677	210,679.90	0.08
294	688365	光云科技	12,465	210,284.55	0.08
295	688151	华强科技	10,151	209,313.62	0.08
296	688226	威腾电气集团股份	5,632	208,947.20	0.08
297	688787	海天瑞声	1,792	207,854.08	0.07
298	688697	纽威数	13,479	207,307.02	0.07

		控装备			
299	688377	迪威尔 高端制 造	5,640	206,988.00	0.07
300	688510	航亚科 技	7,691	206,887.90	0.07
301	688337	普源精 电	5,590	206,215.10	0.07
302	688707	振华新 材料	14,874	206,004.90	0.07
303	688488	艾迪药 业	12,488	203,929.04	0.07
304	688035	德邦科 技股份	4,203	202,794.75	0.07
305	688268	广东华 特气体	3,529	202,529.31	0.07
306	688277	天智航 医疗	13,326	202,421.94	0.07
307	688219	会通股 份	16,154	200,632.68	0.07
308	688221	前沿生 物	11,102	200,391.10	0.07
309	688711	江苏宏 微科技	6,301	199,930.73	0.07
310	688621	阳光诺 和	3,213	199,687.95	0.07
311	688378	奥来德 光电	7,304	199,399.20	0.07
312	688011	新光光 电科技 股份	3,026	193,179.84	0.07
313	688176	亚虹医 药科技	16,768	192,999.68	0.07
314	688143	长盈通 光电	3,841	192,856.61	0.07
315	688236	春立正 达医疗	8,422	192,695.36	0.07
316	688186	张家港 广大特 材	8,287	187,949.16	0.07
317	688231	隆达超 合金股 份	7,205	187,330.00	0.07
318	688136	科兴生	5,904	186,979.68	0.07

		物制药			
319	688359	三孚新材料科技	2,793	186,097.59	0.07
320	688046	药康生物	12,109	185,994.24	0.07
321	688799	华纳大药厂	3,893	185,696.10	0.07
322	688119	中钢洛耐	33,080	184,917.20	0.07
323	688678	福立旺精密	7,634	184,590.12	0.07
324	688721	龙图光罩	3,949	183,746.97	0.07
325	688710	益诺思生物	4,157	183,531.55	0.07
326	688371	菲沃泰纳米科技	9,794	180,895.18	0.07
327	688598	金博碳素股份	6,143	180,358.48	0.06
328	688173	希荻微电子	12,145	178,531.50	0.06
329	688334	西高院	9,218	178,460.48	0.06
330	688566	吉贝尔药业	5,972	178,264.20	0.06
331	688720	艾森股份	2,524	177,639.12	0.06
332	688087	英科再生	5,737	176,814.34	0.06
333	688112	鼎阳科技	4,715	176,576.75	0.06
334	688085	三友医疗	9,769	176,037.38	0.06
335	688117	圣诺生物	4,654	175,874.66	0.06
336	688084	晶品特装	2,124	175,867.20	0.06
337	688290	景业智能	2,955	175,645.20	0.06
338	688505	复旦张江股份	21,078	174,947.40	0.06
339	688212	澳华内镜	3,963	173,222.73	0.06

340	688103	国力电子	2,847	172,499.73	0.06
341	688733	壹石通	5,903	171,068.94	0.06
342	688020	方邦股份	2,498	169,913.96	0.06
343	688601	力芯微电子	3,947	168,102.73	0.06
344	688588	凌志软件	11,747	168,099.57	0.06
345	688320	禾川科技	4,504	168,089.28	0.06
346	688381	帝奥微电子	7,335	167,311.35	0.06
347	688135	利扬芯片	6,017	167,031.92	0.06
348	688157	松井新材料	4,610	167,020.30	0.06
349	688767	杭州博拓生物科技	4,409	166,572.02	0.06
350	688389	深圳普门科技	12,729	165,222.42	0.06
351	688399	硕世生物	2,397	164,194.50	0.06
352	688168	北京安博通	2,183	164,074.28	0.06
353	688315	诺禾致源科技	12,270	162,945.60	0.06
354	688360	德马科技	7,644	162,511.44	0.06
355	688663	新风光科技	4,190	162,446.30	0.06
356	688293	奥浦迈生物	3,308	162,092.00	0.06
357	688090	瑞松科技	3,644	162,085.12	0.06
358	688428	诺诚健华	7,862	161,328.24	0.06
359	688282	理工导航	2,514	159,639.00	0.06
360	688101	三达膜环境技术	9,710	159,632.40	0.06
361	688623	双元科	1,700	159,630.00	0.06

		技			
362	688073	毕得医药科技股份	2,593	158,302.65	0.06
363	688429	时创能源	11,894	155,692.46	0.06
364	688339	亿华通科技	5,742	154,804.32	0.06
365	688269	西安凯立新材	3,868	154,758.68	0.06
366	688023	安恒信息	2,996	154,024.36	0.06
367	688478	晶升股份	4,098	153,306.18	0.06
368	688682	霍莱沃技术	2,894	153,121.54	0.06
369	688512	慧智微电子	13,712	153,025.92	0.06
370	688606	奥泰生物	2,392	152,824.88	0.06
371	688197	首药控股	4,393	152,612.82	0.05
372	688653	康希通信	12,536	152,312.40	0.05
373	688280	精进电动	17,470	151,989.00	0.05
374	688716	中研股份	3,566	151,020.10	0.05
375	688489	三未信安	3,300	150,843.00	0.05
376	688330	宏力达信息	4,152	150,011.76	0.05
377	688070	成都纵横	2,693	149,192.20	0.05
378	688609	广东九联科技	14,607	149,137.47	0.05
379	688677	青岛海泰新光	3,451	148,945.16	0.05
380	688308	欧科亿数控刀具	4,678	148,011.92	0.05
381	688267	中触媒股份	5,254	148,005.18	0.05
382	688010	福光股	4,744	147,633.28	0.05

		份			
383	688719	爱科赛博	3,334	147,196.10	0.05
384	688665	四方光电股份	3,009	146,748.93	0.05
385	688299	长阳科技	8,612	145,715.04	0.05
386	688683	莱尔科技	4,594	145,629.80	0.05
387	688075	安旭生物	3,756	145,244.52	0.05
388	688590	新致软件	7,782	145,212.12	0.05
389	688356	键凯科技	1,753	144,096.60	0.05
390	688039	当虹科技	3,217	143,960.75	0.05
391	688312	燕麦科技	4,318	143,271.24	0.05
392	688283	坤恒顺维	3,545	142,863.50	0.05
393	688480	赛恩斯环保	2,745	141,340.05	0.05
394	688379	华光新材	2,567	141,339.02	0.05
395	688533	上声电子股份	4,828	141,170.72	0.05
396	688410	山外山血液净化	9,408	140,837.76	0.05
397	688500	慧辰资讯股份公司	2,271	140,256.96	0.05
398	688416	恒烁股份	2,540	140,030.20	0.05
399	688298	东方基因生物	5,968	139,830.24	0.05
400	688302	海创药业	2,838	139,544.46	0.05
401	688620	安凯微电子	11,586	139,495.44	0.05
402	688569	铁科轨道	6,323	138,916.31	0.05
403	688595	芯海科	4,210	138,088.00	0.05

		技			
404	688459	哈铁科技	14,150	136,547.50	0.05
405	688159	有方科技	2,824	136,512.16	0.05
406	688292	浩瀚深度信息技术	4,704	136,416.00	0.05
407	688201	信安世纪	9,262	135,503.06	0.05
408	688581	安杰思医学	2,311	135,493.93	0.05
409	688259	创耀通信科技	3,241	135,473.80	0.05
410	688699	明微电子	3,159	134,289.09	0.05
411	688079	美迪凯股份	11,814	133,734.48	0.05
412	688580	伟思医疗	2,755	133,342.00	0.05
413	688115	思林杰科技	2,030	133,127.40	0.05
414	688662	广东富信科技	2,589	132,686.25	0.05
415	688602	康鹏科技	15,221	132,118.28	0.05
416	688148	芳源股份	15,042	131,918.34	0.05
417	688722	同益中新材料	6,716	131,297.80	0.05
418	688215	瑞晟智能科技	1,803	130,735.53	0.05
419	688458	美芯晟科技	3,248	128,750.72	0.05
420	688247	宣泰医药	13,269	128,709.30	0.05
421	688237	超卓航科	2,624	127,920.00	0.05
422	688181	八亿时空液晶股份	3,956	127,857.92	0.05
423	688033	天宜新材	16,570	127,589.00	0.05
424	688687	北京凯	5,113	127,415.96	0.05

		因科技			
425	688015	交控科技	5,587	127,271.86	0.05
426	688238	和元生物	19,103	127,225.98	0.05
427	688291	金橙子科技	2,966	126,707.52	0.05
428	688579	山大地纬软件	11,688	125,996.64	0.05
429	688286	敏芯股份	1,588	125,372.60	0.05
430	688162	巨一科技	4,067	125,263.60	0.05
431	688509	正元地信	22,715	124,705.35	0.04
432	688152	麒麟信安	3,066	123,713.10	0.04
433	688273	麦澜德医疗	2,908	123,648.16	0.04
434	688610	埃科光电	1,998	123,496.38	0.04
435	688175	珠海高凌信息	3,820	123,042.20	0.04
436	688179	阿拉丁科技	9,781	122,164.69	0.04
437	688323	瑞华泰薄膜科技	5,420	122,004.20	0.04
438	688786	悦安新材	4,297	121,218.37	0.04
439	688253	英诺特生物股份	3,999	120,689.82	0.04
440	688211	中科微至	3,898	120,058.40	0.04
441	688335	复洁科技	4,404	118,731.84	0.04
442	688255	凯尔达机器人	3,212	117,655.56	0.04
443	688089	嘉必优生物	5,005	116,516.40	0.04
444	688768	容知日新	2,669	115,941.36	0.04
445	688373	盟科药	19,148	115,653.92	0.04

		业			
446	688207	格灵深瞳	7,601	115,535.20	0.04
447	688061	灿瑞科技	3,502	114,200.22	0.04
448	688558	国盛智科股份	3,925	113,550.25	0.04
449	688199	久日新材料	4,814	113,465.98	0.04
450	688081	兴图新科	3,134	113,074.72	0.04
451	688080	映翰通网络	2,231	112,665.50	0.04
452	688557	兰剑智能	3,088	112,495.84	0.04
453	688317	上海之江生物	5,555	112,044.35	0.04
454	688435	英方软件	2,389	111,733.53	0.04
455	688013	天臣国际医疗科技	2,305	110,824.40	0.04
456	688171	纬德信息	2,357	109,977.62	0.04
457	688307	中润光学	2,521	108,932.41	0.04
458	688607	康众数字医疗科技	2,541	108,754.80	0.04
459	688244	永信至诚	4,444	108,611.36	0.04
460	688098	申联生物医药	12,179	108,149.52	0.04
461	688689	常州银河微电	3,809	108,099.42	0.04
462	688133	泰坦股份	4,860	107,600.40	0.04
463	688679	通源环境	3,920	104,272.00	0.04
464	688260	昀冢科技	3,619	104,227.20	0.04
465	688628	优利德科技	3,243	103,257.12	0.04
466	688448	南京磁	2,127	103,095.69	0.04

		谷科技			
467	688667	菱电电控	1,442	101,545.64	0.04
468	688657	浩辰软件	1,906	101,418.26	0.04
469	688077	大地熊新材料	3,318	101,364.90	0.04
470	688592	司南导航	2,461	101,147.10	0.04
471	688600	皖仪科技	3,996	100,099.80	0.04
472	688370	丛麟环保科技	4,075	99,307.75	0.04
473	688358	祥生医疗科技	3,285	98,878.50	0.04
474	688057	金达莱环保	8,060	98,493.20	0.04
475	688651	远江盛邦安全	2,233	98,296.66	0.04
476	688170	德龙激光	3,122	98,218.12	0.04
477	688455	科捷智能	4,882	98,079.38	0.04
478	688633	星球石墨	4,132	97,845.76	0.04
479	688501	青岛达能环保	3,694	97,632.42	0.04
480	688589	力合微电子	4,281	97,392.75	0.04
481	688357	建龙微纳	2,893	95,613.65	0.03
482	688246	嘉和美康科技	4,105	95,441.25	0.03
483	688030	山石网科	5,233	95,083.61	0.03
484	688285	高铁电气	10,913	94,724.84	0.03
485	688391	钜泉科技	3,317	93,970.61	0.03
486	688571	杭华油墨股份	12,438	92,663.10	0.03
487	688419	耐科装备	3,305	92,506.95	0.03

488	688529	豪森智能股份	4,999	92,181.56	0.03
489	688345	博力威	2,932	91,478.40	0.03
490	688316	青云科技	1,501	90,315.17	0.03
491	688680	海优新材	2,360	90,270.00	0.03
492	688265	南方模式生物	2,192	89,893.92	0.03
493	688369	致远互联	3,515	89,386.45	0.03
494	688576	西山科技	1,396	87,892.16	0.03
495	688350	富淼科技	3,415	87,867.95	0.03
496	688551	科威尔股份	2,373	87,397.59	0.03
497	688051	罗克佳华科技	2,204	87,300.44	0.03
498	688468	科美诊断	11,879	87,191.86	0.03
499	688251	井松智能科技	2,947	86,641.80	0.03
500	688618	三旺通信	3,228	86,058.48	0.03
501	688137	近岸蛋白	2,127	85,186.35	0.03
502	688560	明冠新材料	5,958	85,139.82	0.03
503	688229	博睿宏远数据	1,356	84,994.08	0.03
504	688398	赛特新材	4,831	82,127.00	0.03
505	688669	聚石化学股份	3,520	81,804.80	0.03
506	688314	康拓医疗	2,473	81,757.38	0.03
507	688597	煜邦电力	9,950	81,689.50	0.03
508	688613	奥精医疗	4,017	81,585.27	0.03
509	688479	用友汽车信息科技	4,302	81,006.66	0.03

510	688045	必易微电子	2,089	80,823.41	0.03
511	688485	九州一轨环科	4,525	80,726.00	0.03
512	688132	邦彦技术股份	4,358	80,274.36	0.03
513	688328	深科达智能装备	2,741	79,982.38	0.03
514	688071	华依科技集团	2,398	79,541.66	0.03
515	688496	清越科技	13,387	79,518.78	0.03
516	688022	瀚川智能	5,126	78,427.80	0.03
517	688367	工大高科	2,525	78,174.00	0.03
518	688218	江苏北人	3,414	77,907.48	0.03
519	688288	鸿泉技术	2,894	77,588.14	0.03
520	688338	赛科希德	2,995	77,510.60	0.03
521	688693	锆威特	2,066	77,351.04	0.03
522	688737	中自科技	3,444	77,283.36	0.03
523	688426	康为世纪生物科技	3,235	77,090.05	0.03
524	688203	海正生物材料	6,020	76,935.60	0.03
525	688310	迈得医疗	4,973	76,236.09	0.03
526	688272	富吉瑞光电	2,314	75,575.24	0.03
527	688113	联测科技	1,909	75,462.77	0.03
528	688060	江苏云涌电子科技	1,780	75,347.40	0.03
529	688619	罗普特科技	5,520	75,072.00	0.03
530	688670	金迪克生物	3,708	75,012.84	0.03

531	688530	欧莱新材	4,561	74,982.84	0.03
532	688069	德林海环保	3,320	74,467.60	0.03
533	688121	卓然技术	6,745	73,655.40	0.03
534	688130	晶华微电子	3,482	72,913.08	0.03
535	688118	普元信息	2,814	71,813.28	0.03
536	688695	中创股份	2,599	71,290.57	0.03
537	688129	东来涂料技术股份	3,491	70,622.93	0.03
538	688056	莱伯泰科仪器	2,035	68,396.35	0.02
539	688216	气派科技	3,066	68,310.48	0.02
540	688718	唯赛勃科技	5,189	67,872.12	0.02
541	688655	迅捷兴科技	3,938	67,457.94	0.02
542	688163	赛伦生物	3,080	67,051.60	0.02
543	688616	西力科技	5,412	66,188.76	0.02
544	688189	南新制药	8,214	65,465.58	0.02
545	688355	明志科技	3,655	65,059.00	0.02
546	688026	洁特生物股份	4,002	64,472.22	0.02
547	688573	信宇人	2,824	64,358.96	0.02
548	688393	安必平医药	2,678	63,441.82	0.02
549	688517	金冠电气	3,997	62,313.23	0.02
550	688058	宝兰德软件	2,209	60,151.07	0.02
551	688420	天津美腾科技	2,492	59,484.04	0.02
552	688638	誉辰智能	1,635	59,399.55	0.02

553	688395	深圳正 弦电气 股份	2,428	59,048.96	0.02
554	688092	爱科科 科技股份	2,346	58,978.44	0.02
555	688078	龙软科 技	2,133	58,657.50	0.02
556	688193	仁度生 物	1,210	58,527.70	0.02
557	688038	武汉中 科通达	3,304	58,381.68	0.02
558	688671	碧兴物 联	2,320	57,466.40	0.02
559	688178	万德斯 环保	2,390	57,431.70	0.02
560	688793	倍轻松 科技	2,634	57,421.20	0.02
561	688466	金科环 境	3,453	56,180.31	0.02
562	688309	恒誉环 保	2,310	55,740.30	0.02
563	688096	江苏京 源环保	7,010	55,379.00	0.02
564	688004	北京博 汇科技	2,372	54,864.36	0.02
565	688681	科汇电 力自动 化	3,116	54,779.28	0.02
566	688528	秦川物 联网	4,960	53,419.20	0.02
567	688450	光格科 技	1,893	52,208.94	0.02
568	688067	爱威科 技	2,080	51,084.80	0.02
569	688565	力源科 技	4,514	50,511.66	0.02
570	688329	苏州艾 隆科技	2,274	48,413.46	0.02
571	688156	路德科 技	2,905	46,509.05	0.02
572	688659	元琛科 技	4,667	44,103.15	0.02
573	688217	上海睿 昂基因	1,608	42,370.80	0.02

574	688296	和达科技	3,104	41,128.00	0.01
575	688021	奥福科技	2,232	40,957.20	0.01
576	688701	浙江卓锦股份	3,950	32,192.50	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

### 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	80,660,650.10	29.07
2	688256	寒武纪科技	65,979,741.72	23.78
3	688981	中芯国际	43,146,971.81	15.55
4	688111	金山办公	37,109,585.95	13.37
5	688012	中微半导体设备	29,580,655.11	10.66
6	688271	联影医疗	24,742,057.31	8.92
7	688036	传音控股	23,417,875.34	8.44
8	688506	百利天恒药业	20,476,069.23	7.38
9	688008	澜起科技	19,765,319.47	7.12
10	688608	恒玄科技	15,796,047.05	5.69
11	688223	晶科能源	15,082,775.75	5.43
12	688396	华润微电子	14,398,688.89	5.19
13	688617	惠泰医疗	14,005,244.05	5.05
14	688169	石头科技	13,116,482.30	4.73
15	688047	龙芯中科	12,148,992.67	4.38
16	688009	中国通号	11,136,247.61	4.01
17	688072	拓荆科技	10,840,542.70	3.91
18	688249	晶合集成	10,668,815.09	3.84
19	688188	上海柏楚电子科技	10,610,684.94	3.82
20	688082	盛美上海半导体	10,521,668.71	3.79

21	688303	大全能源	10,363,794.84	3.73
22	688777	中控技术	10,026,666.00	3.61
23	688120	华海清科	9,943,886.35	3.58
24	688213	思特威电子科技	9,837,023.46	3.54
25	688018	乐鑫科技	9,762,748.46	3.52
26	688017	绿的谐波	9,604,745.28	3.46
27	688220	翱捷科技	9,600,703.11	3.46
28	688052	纳芯微电子	9,466,966.31	3.41
29	688728	格科微有限公司	9,362,443.93	3.37
30	688027	科大国盾量子	9,160,965.87	3.30
31	688521	芯原微电子	9,134,112.85	3.29
32	689009	九号公司	9,032,843.25	3.25
33	688187	时代电气	8,898,974.65	3.21
34	688472	阿特斯阳光电力	8,819,686.80	3.18
35	688235	百济神州	8,638,809.98	3.11
36	688126	上海硅产业集团	8,565,150.18	3.09
37	688599	天合光能	8,524,590.93	3.07
38	688318	财富趋势	8,481,137.14	3.06
39	688019	安集科技	8,431,526.04	3.04
40	688469	芯联集成	8,406,761.65	3.03
41	688200	华峰测控	8,103,755.60	2.92
42	688099	晶晨半导体	7,771,072.42	2.80
43	688578	艾力斯医药科技	7,766,005.60	2.80
44	688114	华大智造	7,630,716.00	2.75
45	688349	三一重能	7,596,789.16	2.74
46	688278	特宝生物	7,446,404.93	2.68
47	688525	佰维存储	7,182,770.31	2.59
48	688538	和辉光电	7,129,805.77	2.57
49	688122	西部超导	7,062,897.52	2.55
50	688375	国博电子	7,021,843.88	2.53
51	688475	萤石网络	7,013,138.91	2.53
52	688568	中科星图公司	7,001,763.23	2.52
53	688361	中科飞测	6,919,282.79	2.49
54	688065	凯赛生物	6,811,658.81	2.45
55	688702	盛科通信	6,759,709.74	2.44
56	688343	云天励飞股	6,550,699.67	2.36

		份		
57	688198	佰仁医疗科技	6,539,976.82	2.36
58	688536	思瑞浦股份	6,474,286.72	2.33
59	688234	天岳先进	6,445,019.52	2.32
60	688631	莱斯信息	6,432,834.05	2.32
61	688819	天能电池集团股份	6,371,043.44	2.30
62	688629	四川华丰科技	6,341,728.83	2.29
63	688172	燕东微电子股份	6,305,853.32	2.27
64	688297	中航无人机	6,213,183.35	2.24
65	688322	奥比中光	6,121,577.56	2.21
66	688561	奇安信集团	5,991,960.19	2.16
67	688279	峰昭科技	5,936,026.52	2.14
68	688301	奕瑞科技股份	5,896,222.04	2.12
69	688582	芯动联科	5,677,457.00	2.05
70	688037	芯源微电子	5,672,827.27	2.04
71	688050	爱博诺德医疗	5,574,953.54	2.01
72	688180	君实生物	5,557,322.68	2.00

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	688608	恒玄科技	5,508,762.55	1.99
2	688027	科大国盾量子	5,463,401.91	1.97
3	688279	峰昭科技	5,177,498.12	1.87
4	688235	百济神州	4,407,422.68	1.59
5	688617	惠泰医疗	4,161,279.79	1.50
6	688498	源杰科技	3,571,984.91	1.29
7	688502	茂莱光学	3,505,756.96	1.26
8	688041	海光信息	3,133,667.69	1.13
9	688111	金山办公	2,967,310.84	1.07
10	688068	热景生物	2,568,143.55	0.93
11	688018	乐鑫科技	2,458,414.62	0.89

12	688019	安集科技	2,186,068.57	0.79
13	688696	极米科技	2,047,104.97	0.74
14	688126	上海硅产业集团	2,015,770.40	0.73
15	688515	裕太微电子	1,911,068.07	0.69
16	688368	晶丰明源半导体	1,903,289.31	0.69
17	688052	纳芯微电子	1,901,879.92	0.69
18	688627	精智达技术	1,858,078.46	0.67
19	688160	步科自动化	1,829,224.14	0.66
20	688507	索辰科技	1,808,179.45	0.65

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

### 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	1,783,893,159.95
卖出股票收入（成交）总额	282,863,826.39

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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）	239,506.51	0.09
8	同业存单	-	-
9	地方政府债	-	-
10	其他	-	-
11	合计	239,506.51	0.09

### 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	118057	甬矽转 债	1,160	187,505.71	0.07
2	118063	金 05 转 债	520	52,000.80	0.02

### 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 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

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

注:本基金本报告期末无其他资产。

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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	中微半导体设备	5,047,229.04	1.82	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## §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

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		招商银行股份有限公司-汇添富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	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,166	98,366.11	131,730,900.00	61.83	81,330,100.00	38.17	67,976,400.00	31.90

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富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”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

### 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	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-	28,813,600.00	13.52

	个险分红		
2	国泰海通证券股份有 限公司	5,759,300.00	2.70
3	华泰证券股份有限公 司	5,500,000.00	2.58
4	中信建投证券股份有 限公司	4,315,800.00	2.03
5	中国银河证券股份有 限公司	3,829,800.00	1.80
6	招商证券股份有限公 司	3,814,500.00	1.79
7	李宏	3,000,000.00	1.41
8	方正证券股份有限公 司	2,593,100.00	1.22
9	BARCLAYS BANK PLC	2,559,700.00	1.20
10	刘润滋	2,000,000.00	0.94
11	招商银行股份有限公司-汇添富上证科创 板综合交易型开放式 指数证券投资基金联接基金	67,976,400.00	31.90

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025年02月26 日）基金份额总额	1,493,061,000.00
--------------------------------	------------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	590,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,870,000,000.00
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	213,061,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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

本基金管理人于2025年7月15日发布公告，自2025年7月14日起，鲁伟铭先生担任公司董事长，李文先生不再担任公司董事长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2025年02月26日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币45,000.00元。

### 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	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 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局
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
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、其他问题(基金销售等)
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《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》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1；高级管理人员 2；高级管理人员 3
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日；2025 年 11 月 11 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局；中国证监会上海证监局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施；行政监管措施；行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函；出具警示函；出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作；其他问题(基金销售)；合规内控
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券期货投资者适当性管理办法》；《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集

	《证券投资基金销售机构监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题及整改要求，通过完善制度、优化管理等完成相关问题整改并已通过监管检查验收。公司将从严加强内控及各业务管理，持续提升管理质效。
其他	无

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 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 (%)	
东方证券	3	2,066,756,986.34	100.00	363,717.53	100.00	

注：此处的佣金指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券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称

“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

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	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金发行文件	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年01月25日
2	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金发售代理机构的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年02月17日
3	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年02月17日
4	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年02月22日
5	汇添富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	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年02月27日
6	关于汇添富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、赎回业务公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025年02月28日
7	汇添富上证科创板综合交易型开	上证报, 上交所, 公	2025年02月28日

	放式指数证券投资基金上市交易公告书	司网站, 中国证监会基金电子披露网站	
8	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 04 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
10	汇添富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提示性公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
11	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(2025 年 3 月 5 日更新)	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 07 日
13	汇添富基金管理股份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(2024 年度)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于董事长变更的公告	深交所, 上交所, 上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 07 月 15 日
19	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网	2025 年 07 月 21 日

		站, 深交所, 上交所, 上证报	
20	关于汇添富基金管理股份有限公司住所变更的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025年07月29日
21	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上证报	2025年08月07日
22	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所	2025年08月15日
23	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所	2025年08月15日
24	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2025年中期报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025年08月29日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加甬兴证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 深交所, 上交所, 公司网站, 上证报	2025年09月15日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为申购赎回代理券商的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025年09月23日
27	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金2025年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025年10月28日
28	汇添富基金管理股份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	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所, 上证报	2025年11月17日
29	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 上交所	2025年11月20日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于设立汇添富基金销售(上海)有限公司的公告	中国证监会基金电子披露网站, 公司网站, 深交所, 上交所, 上证报	2025年12月24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者超过 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 年 3 月 18 日至 2025 年 3 月 19 日	-	145,288,100.00	116,474,500.00	28,813,600.00	13.52
招商银行股份有限公司—汇添富上证科创板综合交	1	2025 年 5 月 13 日至 2025 年 12 月 31 日	-	406,576,700.00	338,600,300.00	67,976,400.00	31.90

易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金 联 接 基 金							
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富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、《汇添富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、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露

的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2026年03月31日