

天弘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:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§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所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	80
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	80
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	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
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.....	83
§10 开放式基金份额变动.....	83
§11 重大事件揭示.....	83
11.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
11.8 其他重大事件.....	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§13 备查文件目录.....	89
13.1 备查文件目录.....	89
13.2 存放地点.....	90
13.3 查阅方式.....	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘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	天弘上证科创板综合ETF
场内简称	科创综指ETF天弘
基金主代码	589860
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	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	230,224,000.00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03月05日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金可以选择采取完全复制策略或抽样复制策略构建基金股票投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金的投资策略包括：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、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率

风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	天弘基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	400-986-8888	010-60836588
传真	022-83865564	010-60834004
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦（新金融大厦）16层02单元3号房间	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	300203	100125
法定代表人	黄辰立	张佑君

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.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8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	本期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	101,449,807.63
本期利润	121,423,177.22
加权平均基金份额本期利润	0.2020
本期加权平均净值利润率	19.88%
本期基金份额净值增长率	29.62%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末
期末可供分配利润	68,183,526.77
期末可供分配基金份额利润	0.2962
期末基金资产净值	298,407,526.77
期末基金份额净值	1.2962
3.1.3 累计期末指标	2025年末
基金份额累计净值增长率	29.62%

注：1、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，开放式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。

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

3、期末可供分配利润为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、本基金合同于2025年02月26日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	-4.15%	1.62%	-4.68%	1.63%	0.53%	-0.01%
过去六个月	33.68%	1.67%	33.08%	1.68%	0.60%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	29.62%	1.74%	29.24%	1.77%	0.38%	-0.03%

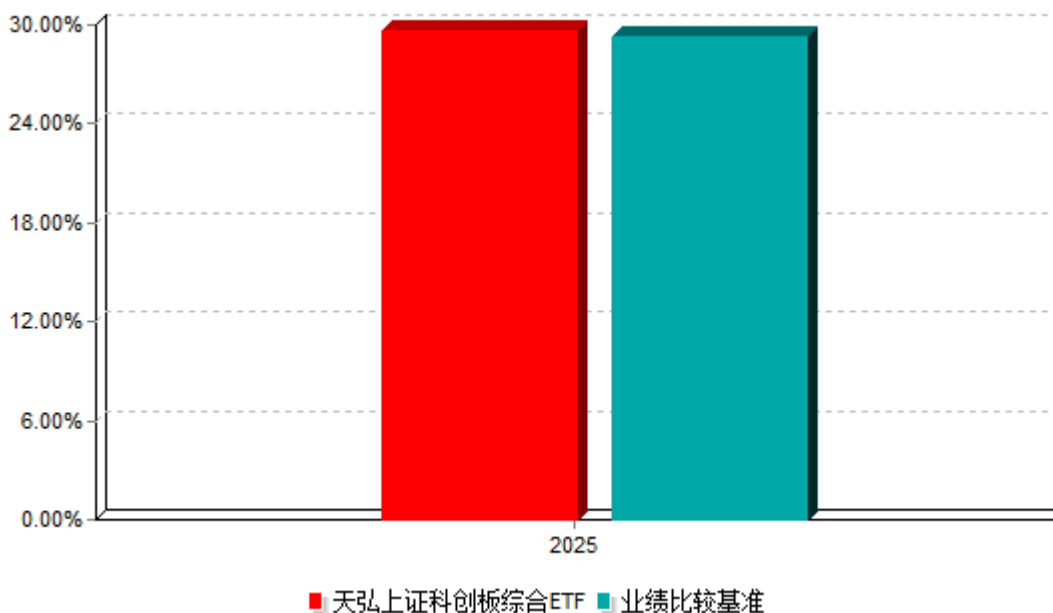
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2025年02月26日生效。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2025年02月26日至2025年08月25日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

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



注：本基金合同于2025年02月26日生效。基金合同生效当年2025年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，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

本基金于2025年02月26日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2025年12月31日，公司共管理运作242只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张戈	本基金基金经理	2025年02月26日	-	12年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，未发生不公平交易和利益输送。

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

2025年行情脉络复杂，市场主线随政策、事件及产业周期动态切换，呈现鲜明的阶段性特征。

市场以科技题材开启全年行情，叠加春节消费旺季催化，形成“成长领涨、消费补涨”格局。1月，DeepSeek-R1开源模型发布激活AI全产业链，宇树机器人亮相春晚带动人形机器人概念走强；2月，《哪吒之魔童闹海》高票房助推影视板块回暖，光线传媒一季度涨幅最高超200%，带动A股成交额重返万亿，交投活跃度升温。3月市场震荡整理，资金向科技赛道头部企业集中。

二季度市场切换为“政策稳增长+科技成长”双轮驱动，政策与外部扰动形成博弈。4月美方上调关税，A股靠国内政策托底展现韧性，大消费板块逆势反弹；5月印巴冲突催化军工板块走强，带动油气板块阶段性上涨，中美会谈缓和预期引北向资金流入。6月并购重组新规及金融支持政策落地，夯实市场基础，为后续行情蓄力。

9月“中特估+基建”受关注，金价突破4000美元/盎司助推黄金板块走强，美联储降息确认流动性拐点，北向资金加速流入。

四季度以后，十五五规划落地锚定发展方向，事件性题材脉冲式爆发，市场震荡上行收官。10月两岸融合概念领涨，二十届四中全会明确科技与高端制造主线，上证指数站稳3800点。12月朱雀三号首飞、海南封关、优必选收购事件密集落地，带动多板块走强，推动市场继续走高。

综合全年表现，结构性行情贯穿始终，科技成长、先进制造板块作为核心主线，引领大盘持续向上突破，人工智能、机器人产业链全年表现亮眼，细分领域龙头标的涨幅可观。在全球流动性宽松、美联储降息的宏观背景下，有色金属等资源类行业受益于资金面与基本面共振，涨幅名列前茅。与之形成鲜明对比的是，以食品饮料、房地产链为代表的消费、周期类板块全年表现疲软，受需求复苏不及预期、行业调整压力等因素影响，多数标的不仅不涨反跌，板块分化格局显著。整体而言，2025年A股市场在政策与产业双轮驱动下，实现规模与结构的双重优化，科技自立自强与高端制造升级成为贯穿全年的核心投资逻辑。

科创综指受到人工智能产业国产化提振，以及创新药领域相关成分股表现优异。全年指数涨幅显著超越上证综指。在此市场状态下，管理人一直以降低跟踪误差为操作目标，按照基金合同约定采用完全复制的策略进行投资运作，并力争在跟踪误差允许范围内获取更高收益。

产品的日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金仓位和持仓结构变化，以及打新收益等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，本基金份额净值为1.2962元，本报告期份额净值增长率29.62%，同期业绩比较基准增长率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，A股市场结构性行情仍将延续，科技成长仍占据主线地位，同时市场可能呈现“主线深化+热点外溢+价值托底”的多元格局。科技端，人工智能、机器人产业链凭借技术迭代加速与政策持续赋能，景气度有望贯穿全年，AI大模型应用落地、人形机器人核心部件国产化率提升将成为核心催化。在此基础上，热点外溢效应将逐步显现：电网设备领域，随着AI数据中心大规模兴建，在电网运维、负荷调度中的需求逐渐成为关键支撑；太空算力作为算力网络的延伸方向，叠加商业航天产业化提速，将成为科技赛道新的增长极，与AI、商业航天形成协同共振。此外，科创板中属于国产算力产业链的成分股权重占比较高，在2026年或有更大边际改善。

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，基金管理人的监察稽核工作从保障基金份额持有人利益、合规运作、防范和控制风险出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层成立了风险管理委员会，指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、投研交环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制。在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，做好投资备选库的入选、维护管理。持续规范新股/新债询价、申购流程，做好关联交易的识别与管控。对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失。根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险。跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及时提醒，保障投资环节的合规性。监督检查各投资组合新股/新债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证投资组合合规开展各项场内、场外交易；

2、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人证券投资申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝利用未公开信息交易、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

3、基金募集与营销环节，严格落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，确保基金营销活动合法合规。坚守投资者利益优先原则，深化投资者适当性管理，致力于提升产品风险评级的合理性和科学性，切实保障投资者合法权益；

4、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

5、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从保障基金份额持有人利益、合规运作、防范和控制风险出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，天弘基金管理有限公司在天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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	毕马威华振审字第2604361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	天弘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>我们审计了后附的天弘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“该基金”）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，自2025年02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，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注7.4.2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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及自2025年02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（以下简称“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第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，</p>

	并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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年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。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>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该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。

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：

(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。

(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。

(3)评价该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。

(4)对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(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。

我们与该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。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	贾君宇
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘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	668,188.03
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	297,785,004.69
其中：股票投资		297,785,004.69
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		46,210.28
应收股利		-
应收申购款		-

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		298,499,403.00
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		38,907.16
应付托管费		12,969.07
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	7.4.7.6	40,000.00
负债合计		91,876.23
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	230,224,000.00
未分配利润	7.4.7.8	68,183,526.77
净资产合计		298,407,526.77
负债和净资产总计		298,499,403.00

注：1.报告截止日2025年12月31日，基金份额净值1.2962元，基金份额总额230,224,000.00份。

2.本财务报表的实际编制期间为2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘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	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
一、营业总收入		122,620,133.74
1.利息收入		188,854.73
其中：存款利息收入	7.4.7.9	188,854.73
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）		102,302,436.98
其中：股票投资收益	7.4.7.10	98,870,303.67
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	14,005.64
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	3,418,127.67
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	19,973,369.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	155,472.44
减：二、营业总支出		1,196,956.52
1.管理人报酬		763,921.83
2.托管费		254,640.68
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	7.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.19	178,394.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		121,423,177.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		121,423,177.22
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		121,423,177.22

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,526,224,000.00	-	1,526,224,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,296,000,000.00	68,183,526.77	-1,227,816,473.23
（一）、综合收益总额	-	121,423,177.22	121,423,177.22
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资	-1,296,000,000.00	-53,239,650.45	-1,349,239,650.45

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,540,000,000.00	103,834,285.52	1,643,834,285.52
2.基金赎回款	-2,836,000,000.00	-157,073,935.97	-2,993,073,935.97
(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	230,224,000.00	68,183,526.77	298,407,526.77

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：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘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]129号《关于准予天弘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》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司自2025年02月17日至2025年02月21日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第80007653_B04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2025年02月26日正式生效。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。

设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,526,224,000.00元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币95,945.25元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币1,526,319,945.25元，折合1,526,224,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括

主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、金融衍生工具（国债期货、股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2026年03月27日批准报出。

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

本基金2025年02月26日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间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日止期间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02月26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

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量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。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(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

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

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会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

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) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 对不存在活跃市场的金融工具，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，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证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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认列，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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

本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。

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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

本基金收益分配方式为现金分红；

本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协

(AMAC) 基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发 [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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税 [2017] 2号文《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 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4号

《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d)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。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	97,763.38

等于：本金	97,723.94
加：应计利息	39.44
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	570,424.65
等于：本金	570,416.43
加：应计利息	8.22
减：坏账准备	-
合计	668,188.03

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金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	277,811,635.10	-	297,785,004.69	19,973,369.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	277,811,635.10	-	297,785,004.69	19,973,369.59
----	----------------	---	----------------	---------------

注：1、股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

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

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 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	40,000.00
合计	40,000.00

7.4.7.7 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	1,526,224,000.00	1,526,224,000.00
本期申购	1,540,000,000.00	1,540,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,836,000,000.00	-2,836,000,000.00
本期末	230,224,000.00	230,224,000.00

注：本基金合同于2025年02月26日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,526,224,000.00份基金份额，其中认购资金利息折合0.00份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初（基金合同生效日）	-	-	-
本期利润	101,449,807.63	19,973,369.59	121,423,177.22
本期基金份额交易产生的变动数	-22,612,766.49	-30,626,883.96	-53,239,650.45
其中：基金申购款	94,207,299.02	9,626,986.50	103,834,285.52
基金赎回款	-116,820,065.51	-40,253,870.46	-157,073,935.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,837,041.14	-10,653,514.37	68,183,526.77

7.4.7.9 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	79,547.44
定期存款利息收入	-	

其他存款利息收入	13,362.04
结算备付金利息收入	-
其他	95,945.25
合计	188,854.73

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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1 2月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	24,898,228.84
股票投资收益——赎回差价收入	73,972,074.83
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	98,870,303.67

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	368,810,818.87
减：卖出股票成本总额	343,102,836.61
减：交易费用	809,753.42
买卖股票差价收入	24,898,228.84

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	2,993,073,935.97
减：现金支付赎回款总额	133,013,916.97
减：赎回股票成本总额	2,786,087,944.17
减：交易费用	-
赎回差价收入	73,972,074.83

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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	1.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	14,003.71
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	14,005.64

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月26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	34,007.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,000.00

减：应计利息总额	1.93
减：交易费用	1.36
买卖债券差价收入	14,003.71

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 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	3,418,127.67
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	3,418,127.67

7.4.7.16 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	19,973,369.59
——股票投资	19,973,369.59

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	19,973,369.59

7.4.7.17 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	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	155,472.44
合计	155,472.44

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 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	40,000.00
信息披露费	-

证券出借违约金	-
ETF登记结算费	137,500.00
开户费	400.00
存托服务费	494.01
合计	178,394.01

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的控股股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘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	本基金的联接基金

注：下述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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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	763,921.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	278,970.86
应支付基金管理人的净管理费	484,950.97

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×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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	254,640.68

注:支付基金托管人中信证券股份有限公司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×该日适用费率/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

本基金本报告期末与关联方进行过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

本基金本报告期末未发生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。

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

本基金本报告期末未发生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。

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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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
天弘上证科创板综合交易型开放式指	44,500,600.00	19.33%

数证券投资 基金联 接基金		
中信证券 股份有限 公司	1,601,400.00	0.70%

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按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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
中信证券 股份有限 公司	97,763.38	79,547.44

注：本基金由基金托管人中信证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，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

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2025年02月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
				基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投 证券股份 有限公司	603202	天有为	网下申购	1,221	114,163.50
中信证券 股份有限 公司	688755	汉邦科技	网下申购	2,023	46,063.71

中信证券股份有限公司	688775	影石创新	网下申购	5,725	270,620.75
中信证券股份有限公司	600930	华电新能	网下申购	197,722	628,755.96
中信证券股份有限公司	688783	西安奕材	网下申购	10,255	88,398.10
中信证券股份有限公司	688759	必贝特	网下申购	3,970	70,586.60
中信证券股份有限公司	688795	摩尔线程	网下申购	492	56,225.76
中信证券股份有限公司	688807	优迅股份	网下申购	1,114	57,549.24

注：中信建投证券股份有限公司为托管人的重要关联方。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

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
6009	华电	2025-	6个	新股	3.18	6.24	138,40	440,1	863,6	-

30	新能	07-09	月	流通受限			6	31.08	53.44	
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月	新股流通受限	114.28	416.18	222	25,370.16	92,391.96	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月	新股流通受限	8.62	18.36	4,615	39,781.30	84,731.40	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6个月	新股流通受限	8.45	24.28	3,339	28,214.55	81,070.92	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6个月	新股流通受限	29.06	52.62	1,169	33,971.14	61,512.78	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月	新股流通受限	104.66	399.31	149	15,594.34	59,497.19	-
688759	必贝特	2025-10-21	6个月	新股流通受限	17.78	25.11	1,588	28,234.64	39,874.68	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6个月	新股流通受限	83.06	117.19	187	15,532.22	21,914.53	-
688809	C强一	2025-12-23	6个月	新股流通受限	85.09	203.31	84	7,147.56	17,078.04	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	新股流通受限	14.99	34.87	479	7,180.21	16,702.73	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	新股流通受限	51.66	135.56	112	5,785.92	15,182.72	-
6887	百奥	2025-	6个	新股	26.68	42.25	262	6,99	11,06	-

96	赛图	12-02	月	流通受限				0.16	9.50	
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月	新股流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603406	天富龙	2025-07-30	6个月	新股流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月	新股流通受限	46.68	55.66	88	4,107.84	4,898.08	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月	新股流通受限	46.36	59.06	77	3,569.72	4,547.62	-
603262	技源集团	2025-07-16	6个月	新股流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月	新股流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
6033	丰倍	2025-	6个	新股	24.49	32.82	88	2,15	2,88	-

34	生物	10-29	月	流通受限				5.12	8.16	
----	----	-------	---	------	--	--	--	------	------	--

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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	2025-12-19	重大事项	272.72	2026-01-05	278.00	20,708	5,010,879.91	5,647,485.76	-

注：本基金截至2025年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末2025年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，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，本基金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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中信证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为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出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能

力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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《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期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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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交易对手管理制度：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未来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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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	668,188.03	-	-	-	668,188.03
交易性金融资产	-	-	-	297,785,004.69	297,785,004.69
应收清算款	-	-	-	46,210.28	46,210.28
资产总计	668,188.03	-	-	297,831,214.97	298,499,403.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	38,907.16	38,907.16
应付托管费	-	-	-	12,969.07	12,969.07
其他负债	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	91,876.23	91,876.23
利率敏感度缺口	668,188.03	-	-	297,739,338.74	298,407,526.77

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的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

于2025年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪上证科创板综合指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调

整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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	297,785,004.69	99.79
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	297,785,004.69	99.79

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	15,270,542.18
	业绩比较基准下降5%	-15,270,542.18

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	290,715,832.22
第二层次	5,647,485.76
第三层次	1,421,686.71
合计	297,785,004.69

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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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。

7.4.14.2.3 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02月26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	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	756,596.39	756,596.39

转出第三层次	-	214,792.06	214,792.06
当期利得或损失总额	-	879,882.38	879,882.38
其中：计入损益的利得或损失	-	879,882.38	879,882.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,421,686.71	1,421,686.71
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	-	736,572.10	736,572.10

注：于2025年12月31日，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。于2025年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。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
股票投资	1,421,686.71	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1628~3.0791	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2025年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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应收款项和其他金融负债，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	297,785,004.69	99.76
	其中：股票	297,785,004.69	99.76
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	668,188.03	0.22
8	其他各项资产	46,210.28	0.02
9	合计	298,499,403.00	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	234,163,114.50	78.47
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	56,724,246.95	19.01
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	4,617,799.34	1.55
N	水利、环境和公共设施管理业	858,157.19	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	296,363,317.98	99.31

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	546,963.77	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	863,653.44	0.29
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	-	-

	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	11,069.50	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	1,421,686.71	0.48

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	13,390	18,150,814.50	6.08
2	688041	海光信息	73,587	16,513,658.67	5.53
3	688981	中芯国际	63,135	7,754,872.05	2.60
4	688012	中微公司	20,708	5,647,485.76	1.89
5	688111	金山办公	14,554	4,469,096.78	1.50
6	688008	澜起科技	36,281	4,273,901.80	1.43
7	688506	百利天恒	13,077	4,225,178.70	1.42
8	688271	联影医疗	25,965	3,258,607.50	1.09
9	688775	影石创新	12,626	2,965,847.40	0.99
10	688072	拓荆科技	8,916	2,942,280.00	0.99

11	688082	盛美上海	15,235	2,682,121.75	0.90
12	688183	生益电子	26,191	2,506,216.79	0.84
13	688036	传音控股	36,467	2,412,656.72	0.81
14	688521	芯原股份	16,519	2,262,607.43	0.76
15	688396	华润微	42,072	2,223,925.92	0.75
16	688126	沪硅产业	100,839	2,182,155.96	0.73
17	688249	晶合集成	63,365	2,103,084.35	0.70
18	688110	东芯股份	13,974	1,835,484.90	0.62
19	688702	盛科通信	12,893	1,826,809.17	0.61
20	688303	大全能源	67,464	1,809,384.48	0.61
21	688498	源杰科技	2,815	1,807,201.85	0.61
22	688223	晶科能源	316,068	1,782,623.52	0.60
23	688375	国博电子	19,043	1,773,093.73	0.59
24	688469	芯联集成	265,026	1,773,023.94	0.59
25	688472	阿特斯	116,499	1,737,000.09	0.58
26	688361	中科飞测	11,116	1,700,636.84	0.57
27	688525	佰维存储	14,681	1,685,231.99	0.56
28	688047	龙芯中科	12,663	1,672,908.93	0.56
29	688120	华海清科	11,066	1,660,785.28	0.56
30	688027	国盾量子	3,274	1,649,408.46	0.55
31	688585	上纬新材	12,823	1,633,265.51	0.55
32	688568	中科星图	25,760	1,519,840.00	0.51
33	688122	西部超导	20,361	1,518,523.38	0.51
34	688009	中国通号	272,075	1,488,250.25	0.50
35	688578	艾力斯	14,287	1,487,991.05	0.50
36	688629	华丰科技	14,511	1,451,970.66	0.49
37	688002	睿创微纳	14,344	1,445,875.20	0.48
38	688187	时代电气	27,415	1,406,115.35	0.47
39	688387	信科移动	107,893	1,391,819.70	0.47
40	688347	华虹公司	12,871	1,388,394.77	0.47
41	688172	燕东微	45,050	1,303,747.00	0.44

42	688676	金盘科技	14,409	1,301,709.06	0.44
43	688313	仕佳光子	14,443	1,282,249.54	0.43
44	688385	复旦微电	17,059	1,257,248.30	0.42
45	689009	九号公司	22,570	1,254,666.30	0.42
46	688778	厦钨新能	15,962	1,234,979.94	0.41
47	688777	中控技术	25,010	1,233,993.40	0.41
48	688188	柏楚电子	9,066	1,231,978.74	0.41
49	688169	石头科技	8,079	1,228,492.74	0.41
50	688728	格科微	82,197	1,228,023.18	0.41
51	688234	天岳先进	13,664	1,214,456.32	0.41
52	688213	思特威	12,765	1,213,823.85	0.41
53	688608	恒玄科技	5,314	1,205,959.16	0.40
54	688336	三生国健	19,686	1,172,695.02	0.39
55	688099	晶晨股份	13,316	1,161,554.68	0.39
56	688538	和辉光电	436,469	1,161,007.54	0.39
57	688019	安集科技	5,310	1,157,155.20	0.39
58	688322	奥比中光	12,797	1,147,506.99	0.38
59	688599	天合光能	68,724	1,137,382.20	0.38
60	688065	凯赛生物	22,751	1,132,999.80	0.38
61	688220	翱捷科技	13,390	1,106,147.90	0.37
62	688017	绿的谐波	5,730	1,100,733.00	0.37
63	688278	特宝生物	12,963	1,084,743.84	0.36
64	688318	财富趋势	7,979	1,055,781.28	0.35
65	688617	惠泰医疗	4,241	1,031,708.07	0.35
66	688819	天能股份	30,773	1,022,279.06	0.34
67	688297	中无人机	21,220	1,018,984.40	0.34
68	688235	百济神州	3,771	1,012,890.60	0.34
69	688349	三一重能	38,703	978,411.84	0.33
70	688692	达梦数据	3,702	967,221.54	0.32
71	688333	铂力特	8,616	960,770.16	0.32
72	688615	合合信息	4,206	957,201.48	0.32

73	688102	斯瑞新材	24,624	953,933.76	0.32
74	688295	中复神鹰	28,429	932,755.49	0.31
75	688037	芯源微	6,194	919,870.94	0.31
76	688709	成都华微	19,875	914,051.25	0.31
77	688147	微导纳米	14,475	908,885.25	0.30
78	688018	乐鑫科技	5,260	894,200.00	0.30
79	688331	荣昌生物	11,304	879,338.16	0.29
80	688433	华曙高科	13,254	877,017.18	0.29
81	688343	云天励飞	11,286	858,638.88	0.29
82	688425	铁建重工	168,347	853,519.29	0.29
83	688582	芯动联科	12,732	841,712.52	0.28
84	688563	航材股份	14,303	836,010.35	0.28
85	688180	君实生物	24,460	835,553.60	0.28
86	688192	迪哲医药	14,410	830,016.00	0.28
87	688200	华峰测控	4,303	818,430.60	0.27
88	688270	臻镭科技	6,651	811,887.57	0.27
89	688114	华大智造	13,321	809,383.96	0.27
90	688248	南网科技	17,944	802,814.56	0.27
91	688005	容百科技	22,486	796,004.40	0.27
92	688708	佳驰科技	12,772	795,057.00	0.27
93	688208	道通科技	21,030	773,904.00	0.26
94	688266	泽璟制药	8,320	771,264.00	0.26
95	688772	珠海冠宇	35,668	767,932.04	0.26
96	688561	奇安信	21,542	766,464.36	0.26
97	688475	萤石网络	24,922	750,401.42	0.25
98	688523	航天环宇	12,966	725,577.36	0.24
99	688660	电气风电	42,348	720,339.48	0.24
100	688195	腾景科技	4,130	700,241.50	0.23
101	688536	思瑞浦	4,305	688,283.40	0.23
102	688205	德科立	4,974	683,825.52	0.23
103	688052	纳芯微	4,296	679,541.28	0.23

104	688048	长光华芯	5,411	678,268.85	0.23
105	688502	茂莱光学	1,698	677,586.90	0.23
106	688146	中船特气	16,760	677,104.00	0.23
107	688301	奕瑞科技	6,674	674,808.14	0.23
108	688363	华熙生物	15,118	660,354.24	0.22
109	688698	伟创电气	6,672	659,727.36	0.22
110	688627	精智达	2,935	656,236.65	0.22
111	688166	博瑞医药	13,359	655,392.54	0.22
112	688449	联芸科技	14,399	650,546.82	0.22
113	688409	富创精密	9,500	640,300.00	0.21
114	688088	虹软科技	12,741	630,679.50	0.21
115	688279	峰昭科技	3,071	624,917.79	0.21
116	688281	华秦科技	8,465	624,717.00	0.21
117	688141	杰华特	14,350	623,220.50	0.21
118	688520	神州细胞	14,146	612,663.26	0.21
119	688123	聚辰股份	4,870	611,574.60	0.20
120	688100	威胜信息	15,516	609,778.80	0.20
121	688548	广钢气体	41,855	608,571.70	0.20
122	688400	凌云光	14,315	606,669.70	0.20
123	688567	孚能科技	38,617	604,356.05	0.20
124	688519	南亚新材	7,188	581,221.68	0.19
125	688766	普冉股份	4,519	574,861.99	0.19
126	688353	华盛锂电	5,031	572,024.70	0.19
127	688630	芯碁微装	4,230	569,061.90	0.19
128	688006	杭可科技	19,144	560,727.76	0.19
129	688388	嘉元科技	13,666	560,032.68	0.19
130	688484	南芯科技	13,647	554,887.02	0.19
131	688116	天奈科技	11,636	548,637.40	0.18
132	688097	博众精工	14,420	544,355.00	0.18
133	688798	艾为电子	7,117	541,674.87	0.18
134	688800	瑞可达	6,410	532,030.00	0.18

135	688668	鼎通科技	4,220	523,280.00	0.18
136	688153	唯捷创芯	13,826	520,410.64	0.17
137	688372	伟测科技	4,660	508,359.40	0.17
138	688382	益方生物	18,265	497,538.60	0.17
139	688332	中科蓝讯	3,780	496,351.80	0.17
140	688127	蓝特光学	12,819	493,403.31	0.17
141	688652	京仪装备	5,008	492,336.48	0.16
142	688167	炬光科技	2,792	488,795.44	0.16
143	688206	概伦电子	13,986	487,132.38	0.16
144	688432	有研硅	39,222	486,745.02	0.16
145	688062	迈威生物	12,589	484,298.83	0.16
146	688686	奥普特	3,856	478,645.28	0.16
147	688352	颀中科技	37,395	471,550.95	0.16
148	688131	皓元医药	6,510	469,240.80	0.16
149	688327	云从科技	32,566	467,973.42	0.16
150	688068	热景生物	2,884	467,208.00	0.16
151	688726	拉普拉斯	12,900	464,400.00	0.16
152	688198	佰仁医疗	4,313	461,534.13	0.15
153	688160	步科股份	3,009	458,872.50	0.15
154	688300	联瑞新材	7,367	457,417.03	0.15
155	688584	上海合晶	20,848	457,405.12	0.15
156	688029	南微医学	5,606	457,225.36	0.15
157	688390	固德威	7,353	456,841.89	0.15
158	688789	宏华数科	5,592	456,139.44	0.15
159	688779	五矿新能	60,890	456,066.10	0.15
160	688503	聚和材料	7,390	450,790.00	0.15
161	688516	奥特维	9,932	449,522.32	0.15
162	688306	均普智能	38,660	448,456.00	0.15
163	688612	威迈斯	13,533	446,183.01	0.15
164	688326	经纬恒润	3,775	443,562.50	0.15
165	688403	汇成股份	26,929	441,097.02	0.15

166	688001	华兴源创	14,101	425,568.18	0.14
167	688549	中巨芯	46,653	425,475.36	0.14
168	688063	派能科技	7,450	423,309.00	0.14
169	688025	杰普特	2,976	421,312.32	0.14
170	688362	甬矽电子	12,905	418,251.05	0.14
171	688031	星环科技	3,858	417,397.02	0.14
172	688032	禾迈股份	4,132	416,464.28	0.14
173	688380	中微半导	12,770	410,555.50	0.14
174	688392	骄成超声	3,648	409,305.60	0.14
175	688228	开普云	2,084	405,567.24	0.14
176	688158	优刻得	14,304	401,799.36	0.13
177	688239	航宇科技	5,851	395,937.17	0.13
178	688543	国科军工	6,376	395,758.32	0.13
179	688605	先锋精科	6,128	393,785.28	0.13
180	688165	埃夫特	16,452	390,899.52	0.13
181	688190	云路股份	3,990	388,626.00	0.13
182	688691	灿芯股份	3,789	386,402.22	0.13
183	688552	航天南湖	10,595	384,810.40	0.13
184	688439	振华风光	5,931	383,142.60	0.13
185	688321	微芯生物	13,009	380,122.98	0.13
186	688055	龙腾光电	105,575	380,070.00	0.13
187	688128	中国电研	12,925	375,859.00	0.13
188	688016	心脉医疗	4,098	375,622.68	0.13
189	688522	纳睿雷达	9,351	373,385.43	0.13
190	688182	灿勤科技	12,604	372,070.08	0.12
191	688559	海目星	7,605	365,496.30	0.12
192	688125	安达智能	2,655	358,557.75	0.12
193	688233	神工股份	5,101	357,223.03	0.12
194	688161	威高骨科	12,689	354,276.88	0.12
195	688050	爱博医疗	5,809	352,373.94	0.12
196	688776	国光电气	3,475	350,071.50	0.12

197	688003	天准科技	5,911	348,157.90	0.12
198	688577	浙海德曼	3,580	346,758.80	0.12
199	688150	莱特光电	12,809	346,227.27	0.12
200	688107	安路科技	12,731	346,028.58	0.12
201	688289	圣湘生物	18,277	345,618.07	0.12
202	688351	微电生理	14,754	341,555.10	0.11
203	688261	东微半导	4,156	340,833.56	0.11
204	688083	中望软件	4,980	339,187.80	0.11
205	688739	成大生物	13,148	338,692.48	0.11
206	688368	晶丰明源	2,888	333,361.84	0.11
207	688690	纳微科技	12,846	331,555.26	0.11
208	688700	东威科技	9,372	330,644.16	0.11
209	688486	龙迅股份	4,416	328,152.96	0.11
210	688586	江航装备	25,154	328,008.16	0.11
211	688319	欧林生物	12,910	327,397.60	0.11
212	688631	莱斯信息	4,775	325,082.00	0.11
213	688658	悦康药业	14,325	323,888.25	0.11
214	688656	浩欧博	2,105	323,749.00	0.11
215	688093	世华科技	8,758	322,732.30	0.11
216	688109	品茗科技	2,534	322,071.40	0.11
217	688513	苑东生物	5,207	320,490.85	0.11
218	688531	日联科技	4,846	319,981.38	0.11
219	688275	万润新能	4,237	319,469.80	0.11
220	688139	海尔生物	10,038	319,007.64	0.11
221	688262	国芯科技	10,471	317,794.85	0.11
222	688443	智翔金泰	11,651	317,373.24	0.11
223	688535	华海诚科	2,805	314,384.40	0.11
224	688603	天承科技	4,186	313,782.56	0.11
225	688591	泰凌微	7,360	313,241.60	0.10
226	688258	卓易信息	4,062	311,027.34	0.10
227	688788	科思科技	4,556	306,801.04	0.10

228	688177	百奥泰	13,056	302,115.84	0.10
229	688562	航天软件	12,582	300,458.16	0.10
230	688556	高测股份	25,988	296,782.96	0.10
231	688507	索辰科技	2,942	295,053.18	0.10
232	688222	成都先导	12,582	295,047.90	0.10
233	688106	金宏气体	15,031	294,457.29	0.10
234	688091	上海谊众	6,245	293,515.00	0.10
235	688596	正帆科技	9,136	288,971.68	0.10
236	688593	新相微	14,275	288,069.50	0.10
237	688717	艾罗能源	4,655	286,748.00	0.10
238	688750	金天钛业	14,296	285,491.12	0.10
239	688230	芯导科技	3,934	285,136.32	0.10
240	688499	利元亨	4,934	284,790.48	0.10
241	688401	路维光电	5,793	282,756.33	0.09
242	688028	沃尔德	4,376	282,427.04	0.09
243	688626	翔宇医疗	4,654	281,567.00	0.09
244	688138	清溢光电	9,881	278,248.96	0.09
245	688305	科德数控	4,477	276,678.60	0.09
246	688408	中信博	6,525	274,767.75	0.09
247	688252	天德钰	12,950	274,151.50	0.09
248	688539	高华科技	5,525	273,542.75	0.09
249	688049	炬芯科技	5,172	272,047.20	0.09
250	688209	英集芯	13,632	271,822.08	0.09
251	688386	泛亚微透	3,101	271,647.60	0.09
252	688648	中邮科技	4,398	270,301.08	0.09
253	688095	福昕软件	3,022	269,773.94	0.09
254	688508	芯朋微	4,418	269,056.20	0.09
255	688257	新锐股份	7,811	267,761.08	0.09
256	688515	裕太微	2,577	264,271.35	0.09
257	688007	光峰科技	14,215	263,972.55	0.09
258	688066	航天宏图	8,096	263,605.76	0.09

259	688518	联赢激光	10,822	262,866.38	0.09
260	688376	美埃科技	4,545	262,791.90	0.09
261	688456	有研粉材	3,372	262,004.40	0.09
262	688383	新益昌	3,337	261,186.99	0.09
263	688232	新点软件	10,383	257,706.06	0.09
264	688575	亚辉龙	18,124	257,360.80	0.09
265	688210	统联精密	4,642	256,795.44	0.09
266	688570	天玛智控	13,859	255,282.78	0.09
267	688108	赛诺医疗	13,225	254,449.00	0.09
268	688196	卓越新能	4,320	254,448.00	0.09
269	688155	先惠技术	4,199	253,829.55	0.09
270	688366	昊海生科	5,725	251,327.50	0.08
271	688639	华恒生物	7,697	250,768.26	0.08
272	688105	诺唯赞	12,521	250,670.42	0.08
273	688325	赛微微电	2,863	250,598.39	0.08
274	688276	百克生物	13,276	250,385.36	0.08
275	688418	震有科技	5,720	248,705.60	0.08
276	688202	美迪西	4,390	247,596.00	0.08
277	688185	康希诺	3,916	246,120.60	0.08
278	688225	亚信安全	12,623	244,886.20	0.08
279	688227	品高股份	3,745	243,462.45	0.08
280	688696	极米科技	2,182	243,249.36	0.08
281	688550	瑞联新材	5,364	243,042.84	0.08
282	688685	迈信林	4,358	241,781.84	0.08
283	688553	汇宇制药	13,531	240,716.49	0.08
284	688059	华锐精密	2,986	234,998.20	0.08
285	688625	呈和科技	5,624	231,708.80	0.08
286	688787	海天瑞声	1,996	231,516.04	0.08
287	688365	光云科技	13,723	231,507.01	0.08
288	688268	华特气体	4,033	231,453.87	0.08
289	688621	阳光诺和	3,709	230,514.35	0.08

290	688348	昱能科技	4,574	230,483.86	0.08
291	688191	智洋创新	7,092	228,220.56	0.08
292	688611	杭州柯林	4,430	225,265.50	0.08
293	688661	和林微纳	4,339	224,586.64	0.08
294	688311	盟升电子	4,925	224,580.00	0.08
295	688151	华强科技	10,867	224,077.54	0.08
296	688359	三孚新科	3,355	223,543.65	0.07
297	688622	禾信仪器	2,199	222,384.87	0.07
298	688636	智明达	5,178	221,825.52	0.07
299	688526	科前生物	14,499	221,254.74	0.07
300	688707	振华新材	15,900	220,215.00	0.07
301	688697	纽威数控	14,205	218,472.90	0.07
302	688488	艾迪药业	13,369	218,315.77	0.07
303	688143	长盈通	4,334	217,610.14	0.07
304	688011	新光光电	3,397	216,864.48	0.07
305	688219	会通股份	17,358	215,586.36	0.07
306	688277	天智航	14,190	215,546.10	0.07
307	688510	航亚科技	8,000	215,200.00	0.07
308	688221	前沿生物	11,894	214,686.70	0.07
309	688377	迪威尔	5,819	213,557.30	0.07
310	688337	普源精电	5,774	213,002.86	0.07
311	688084	晶品特装	2,561	212,050.80	0.07
312	688799	华纳药厂	4,415	210,595.50	0.07
313	688721	龙图光罩	4,504	209,571.12	0.07
314	688378	奥来德	7,651	208,872.30	0.07
315	688176	亚虹医药	18,042	207,663.42	0.07
316	688290	景业智能	3,483	207,029.52	0.07
317	688236	春立医疗	9,046	206,972.48	0.07
318	688226	威腾电气	5,543	205,645.30	0.07
319	688711	宏微科技	6,452	204,721.96	0.07
320	688720	艾森股份	2,903	204,313.14	0.07

321	688212	澳华内镜	4,594	200,803.74	0.07
322	688046	药康生物	13,042	200,325.12	0.07
323	688119	中钢洛耐	35,532	198,623.88	0.07
324	688231	隆达股份	7,610	197,860.00	0.07
325	688168	安博通	2,619	196,844.04	0.07
326	688035	德邦科技	4,048	195,316.00	0.07
327	688601	力芯微	4,559	194,167.81	0.07
328	688678	福立旺	8,028	194,117.04	0.07
329	688371	菲沃泰	10,462	193,233.14	0.06
330	688173	希荻微	13,115	192,790.50	0.06
331	688186	广大特材	8,418	190,920.24	0.06
332	688598	金博股份	6,501	190,869.36	0.06
333	688020	方邦股份	2,805	190,796.10	0.06
334	688136	科兴制药	5,979	189,354.93	0.06
335	688334	西高院	9,766	189,069.76	0.06
336	688090	瑞松科技	4,239	188,550.72	0.06
337	688399	硕世生物	2,731	187,073.50	0.06
338	688085	三友医疗	10,376	186,975.52	0.06
339	688293	奥浦迈	3,773	184,877.00	0.06
340	688505	复旦张江	22,267	184,816.10	0.06
341	688103	国力电子	3,048	184,678.32	0.06
342	688282	理工导航	2,893	183,705.50	0.06
343	688682	霍莱沃	3,470	183,597.70	0.06
344	688623	双元科技	1,948	182,917.20	0.06
345	688588	凌志软件	12,594	180,220.14	0.06
346	688023	安恒信息	3,486	179,215.26	0.06
347	688489	三未信安	3,910	178,726.10	0.06
348	688716	中研股份	4,213	178,420.55	0.06
349	688269	凯立新材	4,458	178,364.58	0.06
350	688566	吉贝尔	5,942	177,368.70	0.06
351	688710	益诺思	4,009	176,997.35	0.06

352	688073	毕得医药	2,898	176,922.90	0.06
353	688389	普门科技	13,625	176,852.50	0.06
354	688677	海泰新光	4,088	176,438.08	0.06
355	688315	诺禾致源	13,219	175,548.32	0.06
356	688360	德马科技	8,183	173,970.58	0.06
357	688733	壹石通	6,003	173,966.94	0.06
358	688112	鼎阳科技	4,627	173,281.15	0.06
359	688381	帝奥微	7,575	172,785.75	0.06
360	688606	奥泰生物	2,697	172,311.33	0.06
361	688087	英科再生	5,568	171,605.76	0.06
362	688039	当虹科技	3,816	170,766.00	0.06
363	688101	三达膜	10,382	170,680.08	0.06
364	688356	键凯科技	2,060	169,332.00	0.06
365	688428	诺诚健华	8,248	169,248.96	0.06
366	688665	四方光电	3,467	169,085.59	0.06
367	688117	圣诺生物	4,457	168,430.03	0.06
368	688075	安旭生物	4,332	167,518.44	0.06
369	688719	爱科赛博	3,787	167,196.05	0.06
370	688379	华光新材	3,035	167,107.10	0.06
371	688302	海创药业	3,391	166,735.47	0.06
372	688135	利扬芯片	6,001	166,587.76	0.06
373	688283	坤恒顺维	4,124	166,197.20	0.06
374	688429	时创能源	12,602	164,960.18	0.06
375	688157	松井股份	4,532	164,194.36	0.06
376	688653	康希通信	13,417	163,016.55	0.05
377	688280	精进电动	18,658	162,324.60	0.05
378	688609	九联科技	15,762	160,930.02	0.05
379	688581	安杰思	2,729	160,001.27	0.05
380	688070	纵横股份	2,882	159,662.80	0.05
381	688512	慧智微	14,277	159,331.32	0.05
382	688699	明微电子	3,746	159,242.46	0.05

383	688339	亿华通	5,894	158,902.24	0.05
384	688197	首药控股	4,557	158,310.18	0.05
385	688320	禾川科技	4,237	158,124.84	0.05
386	688480	赛恩斯	3,069	158,022.81	0.05
387	688259	创耀科技	3,779	157,962.20	0.05
388	688767	博拓生物	4,175	157,731.50	0.05
389	688580	伟思医疗	3,220	155,848.00	0.05
390	688500	慧辰股份	2,519	155,573.44	0.05
391	688663	新风光	3,991	154,731.07	0.05
392	688115	思林杰	2,331	152,866.98	0.05
393	688159	有方科技	3,157	152,609.38	0.05
394	688478	晶升股份	4,035	150,949.35	0.05
395	688215	瑞晟智能	2,080	150,820.80	0.05
396	688620	安凯微	12,480	150,259.20	0.05
397	688299	长阳科技	8,878	150,215.76	0.05
398	688458	美芯晟	3,788	150,156.32	0.05
399	688410	山外山	10,005	149,774.85	0.05
400	688291	金橙子	3,500	149,520.00	0.05
401	688590	新致软件	8,006	149,391.96	0.05
402	688662	富信科技	2,908	149,035.00	0.05
403	688416	恒烁股份	2,696	148,630.48	0.05
404	688181	八亿时空	4,596	148,542.72	0.05
405	688237	超卓航科	3,030	147,712.50	0.05
406	688201	信安世纪	10,034	146,797.42	0.05
407	688330	宏力达	4,052	146,398.76	0.05
408	688610	埃科光电	2,368	146,366.08	0.05
409	688308	欧科亿	4,613	145,955.32	0.05
410	688079	美迪凯	12,878	145,778.96	0.05
411	688273	麦澜德	3,424	145,588.48	0.05
412	688267	中触媒	5,166	145,526.22	0.05
413	688010	福光股份	4,674	145,454.88	0.05

414	688459	哈铁科技	15,007	144,817.55	0.05
415	688286	敏芯股份	1,825	144,083.75	0.05
416	688298	东方生物	6,086	142,594.98	0.05
417	688683	莱尔科技	4,493	142,428.10	0.05
418	688152	麒麟信安	3,518	141,951.30	0.05
419	688602	康鹏科技	16,319	141,648.92	0.05
420	688148	芳源股份	16,019	140,486.63	0.05
421	688569	铁科轨道	6,370	139,948.90	0.05
422	688312	燕麦科技	4,163	138,128.34	0.05
423	688211	中科微至	4,470	137,676.00	0.05
424	688533	上声电子	4,691	137,164.84	0.05
425	688247	宣泰医药	14,131	137,070.70	0.05
426	688435	英方软件	2,918	136,474.86	0.05
427	688175	高凌信息	4,226	136,119.46	0.05
428	688033	天宜新材	17,655	135,943.50	0.05
429	688255	凯尔达	3,710	135,897.30	0.05
430	688238	和元生物	20,389	135,790.74	0.05
431	688579	山大地纬	12,572	135,526.16	0.05
432	688509	正元地信	24,379	133,840.71	0.04
433	688722	同益中	6,814	133,213.70	0.04
434	688595	芯海科技	4,058	133,102.40	0.04
435	688292	浩瀚深度	4,568	132,472.00	0.04
436	688171	纬德信息	2,821	131,627.86	0.04
437	688667	菱电电控	1,857	130,769.94	0.04
438	688768	容知日新	2,999	130,276.56	0.04
439	688307	中润光学	3,013	130,191.73	0.04
440	688179	阿拉丁	10,408	129,995.92	0.04
441	688061	灿瑞科技	3,938	128,418.18	0.04
442	688015	交控科技	5,636	128,388.08	0.04
443	688558	国盛智科	4,437	128,362.41	0.04
444	688607	康众医疗	2,992	128,057.60	0.04

445	688013	天臣医疗	2,623	126,113.84	0.04
446	688081	兴图新科	3,492	125,991.36	0.04
447	688687	凯因科技	5,036	125,497.12	0.04
448	688557	兰剑智能	3,442	125,392.06	0.04
449	688373	盟科药业	20,454	123,542.16	0.04
450	688323	瑞华泰	5,375	120,991.25	0.04
451	688628	优利德	3,799	120,960.16	0.04
452	688207	格灵深瞳	7,875	119,700.00	0.04
453	688162	巨一科技	3,880	119,504.00	0.04
454	688077	大地熊	3,903	119,236.65	0.04
455	688689	银河微电	4,196	119,082.48	0.04
456	688080	映翰通	2,335	117,917.50	0.04
457	688679	通源环境	4,424	117,678.40	0.04
458	688657	浩辰软件	2,206	117,381.26	0.04
459	688448	磁谷科技	2,414	117,006.58	0.04
460	688786	悦安新材	4,100	115,661.00	0.04
461	688098	申联生物	13,000	115,440.00	0.04
462	688358	祥生医疗	3,816	114,861.60	0.04
463	688335	复洁科技	4,255	114,714.80	0.04
464	688651	盛邦安全	2,589	113,967.78	0.04
465	688357	建龙微纳	3,439	113,658.95	0.04
466	688600	皖仪科技	4,534	113,576.70	0.04
467	688089	嘉必优	4,872	113,420.16	0.04
468	688592	司南导航	2,759	113,394.90	0.04
469	688317	之江生物	5,604	113,032.68	0.04
470	688253	英诺特	3,730	112,571.40	0.04
471	688260	昀冢科技	3,861	111,196.80	0.04
472	688199	久日新材	4,699	110,755.43	0.04
473	688170	德龙激光	3,503	110,204.38	0.04
474	688265	南模生物	2,672	109,578.72	0.04
475	688501	青达环保	4,122	108,944.46	0.04

476	688345	博力威	3,463	108,045.60	0.04
477	688680	海优新材	2,824	108,018.00	0.04
478	688455	科捷智能	5,328	107,039.52	0.04
479	688391	钜泉科技	3,736	105,840.88	0.04
480	688244	永信至诚	4,327	105,751.88	0.04
481	688551	科威尔	2,871	105,738.93	0.04
482	688133	泰坦科技	4,743	105,010.02	0.04
483	688285	高铁电气	11,989	104,064.52	0.03
484	688057	金达莱	8,484	103,674.48	0.03
485	688419	耐科装备	3,697	103,479.03	0.03
486	688051	佳华科技	2,601	103,025.61	0.03
487	688316	青云科技	1,700	102,289.00	0.03
488	688576	西山科技	1,610	101,365.60	0.03
489	688350	富淼科技	3,913	100,681.49	0.03
490	688251	井松智能	3,421	100,577.40	0.03
491	688571	杭华股份	13,399	99,822.55	0.03
492	688618	三旺通信	3,717	99,095.22	0.03
493	688633	星球石墨	4,182	99,029.76	0.03
494	688369	致远互联	3,872	98,464.96	0.03
495	688669	聚石化学	4,124	95,841.76	0.03
496	688137	近岸蛋白	2,387	95,599.35	0.03
497	688030	山石网科	5,250	95,392.50	0.03
498	688589	力合微	4,176	95,004.00	0.03
499	688071	华依科技	2,856	94,733.52	0.03
500	688370	丛麟科技	3,835	93,458.95	0.03
501	688693	锆威特	2,484	93,000.96	0.03
502	688328	深科达	3,162	92,267.16	0.03
503	688338	赛科希德	3,565	92,262.20	0.03
504	688468	科美诊断	12,543	92,065.62	0.03
505	688045	必易微	2,375	91,888.75	0.03
506	688367	工大高科	2,954	91,455.84	0.03

507	688737	中自科技	4,073	91,398.12	0.03
508	688529	豪森智能	4,956	91,388.64	0.03
509	688314	康拓医疗	2,744	90,716.64	0.03
510	688218	江苏北人	3,960	90,367.20	0.03
511	688246	嘉和美康	3,840	89,280.00	0.03
512	688597	煜邦电力	10,749	88,249.29	0.03
513	688426	康为世纪	3,669	87,432.27	0.03
514	688288	鸿泉技术	3,239	86,837.59	0.03
515	688130	晶华微	4,121	86,293.74	0.03
516	688560	明冠新材	6,004	85,797.16	0.03
517	688496	清越科技	14,403	85,553.82	0.03
518	688229	博睿数据	1,361	85,307.48	0.03
519	688113	联测科技	2,157	85,266.21	0.03
520	688060	云涌科技	1,992	84,321.36	0.03
521	688670	金迪克	4,146	83,873.58	0.03
522	688272	富吉瑞	2,559	83,576.94	0.03
523	688398	赛特新材	4,882	82,994.00	0.03
524	688069	德林海	3,627	81,353.61	0.03
525	688132	邦彦技术	4,373	80,550.66	0.03
526	688216	气派科技	3,610	80,430.80	0.03
527	688163	赛伦生物	3,671	79,917.67	0.03
528	688695	中创股份	2,871	78,751.53	0.03
529	688129	东来技术	3,868	78,249.64	0.03
530	688022	瀚川智能	5,072	77,601.60	0.03
531	688479	友车科技	4,100	77,203.00	0.03
532	688485	九州一轨	4,319	77,050.96	0.03
533	688613	奥精医疗	3,791	76,995.21	0.03
534	688655	迅捷兴	4,475	76,656.75	0.03
535	688056	莱伯泰科	2,280	76,630.80	0.03
536	688121	卓然股份	7,012	76,571.04	0.03
537	688203	海正生材	5,991	76,564.98	0.03

538	688573	信宇人	3,354	76,437.66	0.03
539	688118	普元信息	2,970	75,794.40	0.03
540	688393	安必平	3,188	75,523.72	0.03
541	688530	欧莱新材	4,588	75,426.72	0.03
542	688355	明志科技	4,206	74,866.80	0.03
543	688619	罗普特	5,482	74,555.20	0.02
544	688310	迈得医疗	4,848	74,319.84	0.02
545	688638	誉辰智能	2,026	73,604.58	0.02
546	688395	正弦电气	2,995	72,838.40	0.02
547	688058	宝兰德	2,642	71,941.66	0.02
548	688038	中科通达	3,956	69,902.52	0.02
549	688178	万德斯	2,897	69,614.91	0.02
550	688092	爱科科技	2,763	69,461.82	0.02
551	688078	龙软科技	2,492	68,530.00	0.02
552	688420	美腾科技	2,856	68,172.72	0.02
553	688193	仁度生物	1,391	67,282.67	0.02
554	688466	金科环境	4,133	67,243.91	0.02
555	688718	唯赛勃	5,093	66,616.44	0.02
556	688189	南新制药	8,344	66,501.68	0.02
557	688616	西力科技	5,390	65,919.70	0.02
558	688671	碧兴物联	2,644	65,491.88	0.02
559	688309	恒誉环保	2,706	65,295.78	0.02
560	688026	洁特生物	4,052	65,277.72	0.02
561	688004	博汇科技	2,686	62,127.18	0.02
562	688450	光格科技	2,192	60,455.36	0.02
563	688681	科汇股份	3,436	60,404.88	0.02
564	688793	倍轻松	2,731	59,535.80	0.02
565	688517	金冠电气	3,748	58,431.32	0.02
566	688067	爱威科技	2,296	56,389.76	0.02
567	688096	京源环保	7,052	55,710.80	0.02
568	688156	路德科技	3,451	55,250.51	0.02

569	688329	艾隆科技	2,582	54,970.78	0.02
570	688528	秦川物联	5,041	54,291.57	0.02
571	688217	睿昂基因	1,821	47,983.35	0.02
572	688565	力源科技	4,275	47,837.25	0.02
573	688021	奥福科技	2,532	46,462.20	0.02
574	688296	和达科技	3,453	45,752.25	0.02
575	688659	元琛科技	4,759	44,972.55	0.02
576	688701	卓锦股份	4,271	34,808.65	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	600930	华电新能	138,406	863,653.44	0.29
2	688795	摩尔线程	222	92,391.96	0.03
3	688783	西安奕材	4,615	84,731.40	0.03
4	688729	屹唐股份	3,339	81,070.92	0.03
5	688765	禾元生物	1,169	61,512.78	0.02
6	688802	沐曦股份	149	59,497.19	0.02
7	688759	必贝特	1,588	39,874.68	0.01
8	688790	昂瑞微	187	21,914.53	0.01
9	688809	C强一	84	17,078.04	0.01
10	688727	恒坤新材	479	16,702.73	0.01
11	688807	优迅股份	112	15,182.72	0.01
12	688796	百奥赛图	262	11,069.50	0.00
13	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
14	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
15	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
16	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
17	603092	德力佳	88	4,898.08	0.00

18	603418	友升股份	77	4,547.62	0.00
19	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
20	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
21	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
22	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
23	603334	丰倍生物	88	2,888.16	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	88,862,796.31	29.78
2	688256	寒武纪	73,402,755.82	24.60
3	688981	中芯国际	46,913,452.09	15.72
4	688111	金山办公	43,652,753.35	14.63
5	688012	中微公司	34,444,601.68	11.54
6	688271	联影医疗	28,624,618.14	9.59
7	688036	传音控股	26,822,759.34	8.99
8	688008	澜起科技	23,805,159.92	7.98
9	688506	百利天恒	21,555,157.96	7.22
10	688223	晶科能源	16,778,277.48	5.62
11	688396	华润微	16,282,699.26	5.46
12	688169	石头科技	15,949,034.64	5.34
13	688072	拓荆科技	15,212,370.60	5.10
14	688608	恒玄科技	15,064,311.03	5.05
15	688188	柏楚电子	14,467,933.40	4.85
16	688082	盛美上海	14,373,828.59	4.82
17	688052	纳芯微	12,791,419.54	4.29
18	688120	华海清科	12,459,554.24	4.18

19	689009	九号公司	12,384,315.97	4.15
20	688047	龙芯中科	12,383,744.96	4.15
21	688009	中国通号	12,231,485.42	4.10
22	688017	绿的谐波	12,095,024.04	4.05
23	688777	中控技术	11,707,068.04	3.92
24	688249	晶合集成	11,453,549.94	3.84
25	688303	大全能源	11,146,982.68	3.74
26	688318	财富趋势	10,573,360.94	3.54
27	688728	格科微	10,388,109.33	3.48
28	688521	芯原股份	10,364,583.40	3.47
29	688578	艾力斯	10,163,763.16	3.41
30	688220	翱捷科技	9,987,389.98	3.35
31	688018	乐鑫科技	9,923,351.31	3.33
32	688187	时代电气	9,895,773.87	3.32
33	688617	惠泰医疗	9,616,400.71	3.22
34	688213	思特威	9,563,361.96	3.20
35	688472	阿特斯	9,544,457.20	3.20
36	688469	芯联集成	9,246,625.54	3.10
37	688599	天合光能	9,157,518.88	3.07
38	688019	安集科技	8,525,192.75	2.86
39	688629	华丰科技	8,347,106.19	2.80
40	688037	芯源微	8,266,529.59	2.77
41	688361	中科飞测	8,247,526.99	2.76
42	688349	三一重能	8,213,654.33	2.75
43	688200	华峰测控	8,129,423.09	2.72
44	688099	晶晨股份	8,075,580.90	2.71
45	688538	和辉光电	8,025,984.47	2.69
46	688631	莱斯信息	7,981,898.19	2.67
47	688122	西部超导	7,932,066.31	2.66
48	688126	沪硅产业	7,875,280.15	2.64
49	688525	佰维存储	7,868,193.43	2.64

50	688568	中科星图	7,842,949.26	2.63
51	688301	奕瑞科技	7,673,596.52	2.57
52	688114	华大智造	7,622,083.25	2.55
53	688475	萤石网络	7,569,023.20	2.54
54	688278	特宝生物	7,540,405.61	2.53
55	688065	凯赛生物	7,504,843.29	2.51
56	688819	天能股份	7,482,157.25	2.51
57	688375	国博电子	7,440,856.63	2.49
58	688266	泽璟制药	7,418,640.08	2.49
59	688027	国盾量子	7,407,690.05	2.48
60	688002	睿创微纳	7,135,355.81	2.39
61	688702	盛科通信	7,057,776.88	2.37
62	688172	燕东微	7,030,169.22	2.36
63	688297	中无人机	6,910,915.54	2.32
64	688235	百济神州	6,821,983.24	2.29
65	688183	生益电子	6,767,461.57	2.27
66	688050	爱博医疗	6,746,518.26	2.26
67	688234	天岳先进	6,650,102.03	2.23
68	688561	奇安信	6,642,713.27	2.23
69	688798	艾为电子	6,570,842.82	2.20
70	688563	航材股份	6,543,622.96	2.19
71	688198	佰仁医疗	6,478,413.35	2.17
72	688343	云天励飞	6,458,345.38	2.16
73	688281	华秦科技	6,317,676.15	2.12
74	688363	华熙生物	6,285,965.01	2.11
75	688322	奥比中光	6,212,936.63	2.08
76	688536	思瑞浦	6,210,409.88	2.08

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

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	688256	寒武纪	9,602,931.67	3.22
2	688617	惠泰医疗	8,430,292.55	2.83
3	688027	国盾量子	6,520,246.57	2.19
4	688608	恒玄科技	6,300,775.20	2.11
5	688235	百济神州	6,128,419.92	2.05
6	688041	海光信息	5,139,119.12	1.72
7	688279	峰昭科技	4,627,018.54	1.55
8	688018	乐鑫科技	3,454,224.21	1.16
9	688498	源杰科技	3,436,303.61	1.15
10	688502	茂莱光学	3,353,873.37	1.12
11	688019	安集科技	3,270,770.33	1.10
12	688200	华峰测控	3,254,073.56	1.09
13	688332	中科蓝讯	3,038,901.07	1.02
14	688032	禾迈股份	3,008,060.48	1.01
15	688068	热景生物	2,951,635.26	0.99
16	688686	奥普特	2,849,434.15	0.95
17	688536	思瑞浦	2,840,496.31	0.95
18	688692	达梦数据	2,834,464.13	0.95
19	688016	心脉医疗	2,724,615.29	0.91
20	688506	百利天恒	2,675,875.33	0.90

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

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	1,949,412,779.73
卖出股票收入（成交）总额	368,810,818.87

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	46,210.28

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,210.28

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	5,647,485.76	1.89	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	600930	华电新能	863,653.44	0.29	新股流通受限
2	688795	摩尔线程	92,391.96	0.03	新股流通受限
3	688783	西安奕材	84,731.40	0.03	新股流通受限
4	688729	屹唐股份	81,070.92	0.03	新股流通受限
5	688765	禾元生物	61,512.78	0.02	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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		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
2,690	85,585.13	80,013,400.00	34.75%	105,710,000.00	45.92%	44,500,600.00	19.33%

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	中国人寿保险股份有限公司	38,387,800.00	16.67%
2	杨明娥	17,387,000.00	7.55%
3	华泰证券股份有限公司	5,555,600.00	2.41%
4	方正证券股份有限公司	5,003,700.00	2.17%
5	中国银河证券股份有限公司	4,692,900.00	2.04%
6	国泰海通证券股份有限公司	4,677,200.00	2.03%
7	申万宏源证券有限公司	3,017,200.00	1.31%
8	黄超	3,000,000.00	1.30%
9	中信建投证券股份有限公司	2,847,400.00	1.24%

10	广发证券股份有限公司	2,823,100.00	1.23%
-	中信证券股份有限公司一天弘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	44,500,600.00	19.33%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘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之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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02月26日)基金份额总额	1,526,224,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,540,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,836,000,000.00
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	230,224,000.00

注：本基金合同于2025年02月26日生效。

§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，本基金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

本报告期内，迟哲先生担任公司副总经理、首席信息官，刘荣逵先生不再担任公司首席信息官，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内无其他涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费40,000.00元。截至本报告期末，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务11个月。

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

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

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	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	

	数量					
中信证券华南	4	2,315,650,854.36	100.00%	477,071.96	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构，再和被选用的证券经营机构签订经纪服务协议。

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
中信证券华南	34,007.00	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	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-02-11
2	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-02-11
3	天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-11
4	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托	中国证监会规定媒介	2025-02-11

	管协议		
5	天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-11
6	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金设置最高募集规模上限的公告	中国证监会规定媒介	2025-02-14
7	天弘基金管理有限公司关于天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-15
8	天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-27
9	天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-28
10	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-02-28
11	天弘基金管理有限公司关于天弘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	中国证监会规定媒介	2025-02-28
12	天弘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（更新）	中国证监会规定媒介	2025-03-03
13	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-03-05

14	天弘基金管理有限公司关于天弘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	中国证监会规定媒介	2025-03-05
15	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年下半年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
16	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-15
17	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-18
18	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-10
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-06
20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-12
21	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-09
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-11
23	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金2025年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-21
24	天弘上证科创板综合交易型	中国证监会规定媒介	2025-08-29

	开放式指数证券投资基金2025年中期报告		
25	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-20
26	天弘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（更新）	中国证监会规定媒介	2025-10-21
27	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-22
28	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-23
29	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-27
30	天弘上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-28
31	天弘基金管理有限公司关于终止方正中期期货有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-18
32	天弘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（更新）	中国证监会规定媒介	2025-11-24
33	天弘基金管理有限公司关于旗下上交所ETF申购赎回清单版本等内容更新的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-24
34	天弘基金管理有限公司关于变更客户服务电话号码的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-28
35	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2025-11-28

	旗下基金关联交易事项的公告		
36	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-12
37	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-19
38	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-25
39	天弘基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-30

§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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人决定自2025年12月1日起启用新客户服务电话号码400-986-8888。原客户服务电话号码95046自2026年1月1日起正式停用。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于变更客户服务电话号码的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日