
华夏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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§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。

基金托管人中国建设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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 2 月 26 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§4 管理人报告	6
§5 托管人报告	11
§6 审计报告	12
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	15
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	17
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 本报告期投资基金情况	60
8.13 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末上市基金前十名持有人	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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的情况	61
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏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	华夏上证科创板综合 ETF
场内简称	科创综指（扩位证券简称：科创综指 ETF 华夏）
基金主代码	589000
交易代码	589000
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 2 月 26 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,075,507,833.00 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 3 月 5 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最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略，替代性策略，存托凭证投资策略，金融衍生品投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金，其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金资产投资于科创板，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于科创板上市公司股票价格波动较大的风险、流动性风险、退市风险等。

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		华夏基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王小飞
	联系电话	400-818-6666	021-6063 7103
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-6666	021-60637228
传真		010-63136700	021-60635778
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市朝阳区北辰西路6号院 北辰中心C座5层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100101	100033

法定代表人	邹迎光	张金良
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/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)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 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	2025 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	468,693,820.56
本期利润	580,951,885.88
加权平均基金份额本期利润	0.3622
本期加权平均净值利润率	34.03%
本期基金份额净值增长率	30.52%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	328,220,262.92
期末可供分配基金份额利润	0.3052
期末基金资产净值	1,403,728,095.92
期末基金份额净值	1.3052
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	30.52%

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，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 2 月 26 日生效。

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	-4.50%	1.63%	-4.68%	1.63%	0.18%	0.00%
过去六个月	33.24%	1.68%	33.08%	1.68%	0.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	30.52%	1.73%	29.24%	1.77%	1.28%	-0.04%

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

华夏上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2025 年 2 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日)

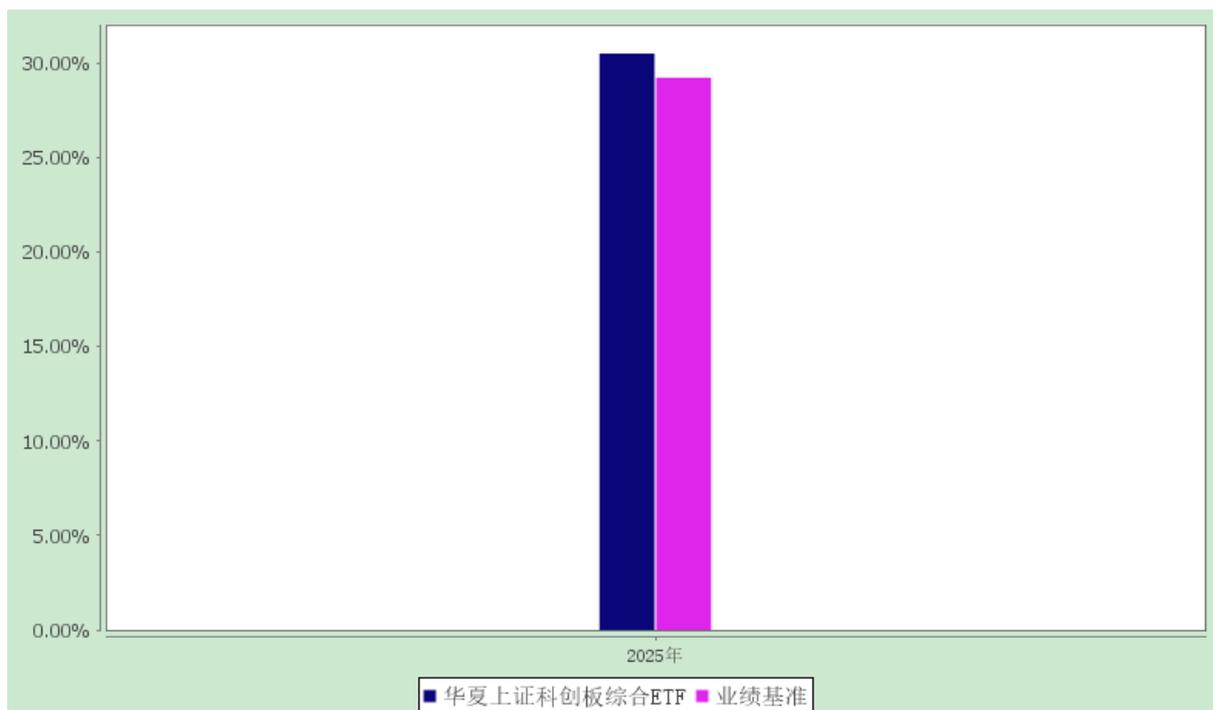


注：①本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效。

②根据本基金的基金合同规定，本基金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本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

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

华夏上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，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

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛

的基金管理公司之一。

华夏基金是境内权益 ETF 管理规模最大的基金管理公司之一，在指数基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基、港股、行业主题、策略、跨境、商品等较为完整的指数产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2025 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在北交所主题偏股型基金(A 类)中华夏北交所创新中小企业精选两年定开混合发起式排名第 2/11；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏数字产业混合排名第 3/62；在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）排名第 3/25；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）排名第 4/16。

固收与固收+产品：在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏聚利债券排名第 2/273；在可转换债券型基金(A 类)中华夏可转债增强债券排名第 3/38；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永康添福混合排名第 4/313；在短期纯债债券型基金(A 类)中华夏安益短债债券排名第 4/132；在债券型 FOF(A 类)中华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）排名第 5/17；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中华夏永顺一年持有混合排名前 5%（第 14/313），华夏兴源稳健一年持有混合排名前 5%（第 15/313）。

在客户服务方面，2025 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销渠道继续优化页面显示及相关功能，新增双因子验证、交易时间预估、交易场景密码验证功能给客户更方便直观安全的使用体验；（2）华夏基金管家客户端新增恒生指数行情，动态追踪港股风向，行情了解更全面，优化长辈模式下的业务办理功能，从客户投资需求出发，进一步提升操作体验；（3）与云湾基金、日照银行等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“一些 ETF 小妙招送给大家”、“当你持有红利低波的时间越长，就越能感到它的可贵”“黄金的信仰比黄金贵”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
单宽之	本基金的基金经理	2025-02-26	-	9 年	硕士。曾任前海金融控股有限公司投资经理助理，华宝基金管理有限公司基金经理助理等。2024 年 2 月加入华夏基金管理有限公司。

					历任数量投资部研究员。
--	--	--	--	--	-------------

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，基金经理个人薪酬激励与其管理的私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，公司对其进行年度综合考核，考核结果作为确定其薪酬激励的重要参考因素之一。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 137 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

2025 年，全球经济增速总体仍然呈现放缓态势，流动性环境总体宽松。贸易摩擦、地缘政治等方面所展现出的国际关系不确定性尚存，一定程度上推动了国际秩序的重构，同时也提升了国家安全和供应链稳定的战略考量，人工智能等科技领域的市场关注度普遍较高。国内方面，在国际环境不确定性尚存的情况下，我国经济总体坚持中长期稳健向好的发展态势，新质生产力的发展稳步推进，政策层面明确以科技创新引领现代化产业体系建设，积极推动传统产业高端化、智能化和绿色化，同时努力培育新兴产业和未来产业，以高质量发展的方式贯彻落实经济结构的转型升级。货币政策方面，央行在 2025 年下调了存款准备金率，以及公开市场操作利率、支农支小再贷款利率、个人住房公积金贷款利率等；此外，还新设或增加了科技创新再贷款、服务消费与养老再贷款等结构性工具额度，并优化了支持资本市场的工具，相关举措有利于降低社会综合融资成本，助力提升宏观经济韧性。

市场方面，A 股市场 2025 年总体呈现上涨行情，有色金属、通信、电子、国防军工等行业表现相对靠前，以人工智能为代表的科技板块是全年最重要的投资主线之一，市场风格方面成长风格全年总体优于价值风格。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回和成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括东方证券股份有限公司、方正证券股份有限

公司、广发证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司等。

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 1.3052 元，本报告期份额净值增长率为 30.52%，同期业绩比较基准增长率 29.24%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.28%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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，预计海外发达经济体或将延续流动性总体宽松的态势，美元信用若无法有效修复或将继续推动人民币等非美元货币的升值进程，国际关系的不确定性依然是市场关注的焦点之一，安全发展的重要性或将进一步提升。国内方面，中国经济不改中长期稳中向好的趋势，新质生产力的稳步推进将逐渐渗透到各行各业，助力优化产业结构并积极探索新的创新增长点。未来有效提升内需、完善供应链安全、鼓励科技创新是值得关注的几个方面；随着全面深化改革的稳步推进和相关政策的有力落实，中国经济将继续展现出中长期稳健发展的韧性。

市场方面，经历了过去一年的市场行情，投资者对 A 股和港股市场的信心得到了较为显著的修复及增强。未来如果全球流动性继续维持总体宽松，中国经济在政策组合拳的指导下继续稳健向好发展，A 股和港股市场将获得全球更多投资者的关注。与此同时，在宏观经济增速放缓的大背景下市场结构性行情或将延续，成长与价值之间的风格轮动或将边际增强。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。报告期内，公司持续推进制度体系建设，结合法律法规和业务实际，在保密管理、专兼合规人员管理、投资管理人员职业道德与行为规范、洗钱风险管理等方面新增和修订多项管理制度，制度化水平显著提高。持续开展合规培训，在全员覆盖的基础上，着重加强投资研究和关键涉密岗位等重点人员的合规督导培训，强化员工主

动合规意识和红线意识。持续优化合规管理的机制化和系统化，完善合规管理综合服务平台，提高合规管理效能。持续做好信息披露业务，通过流程优化、系统优化及强化培训持续保障信息披露的完整性、准确性、及时性。持续做好《推动公募基金高质量发展行动方案》及相关法规配套落实工作。公司高度重视洗钱风险管理，深入贯彻基于风险的原则，依法采取预防、管控措施，建立健全反洗钱内部控制制度，切实履行客户尽职调查、客户身份资料和交易记录保存、可疑交易报告、反洗钱特别预防措施等反洗钱义务，持续提升洗钱风险管理的有效性。

在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续升级优化内部风险管理系统、积极探索智能化业务应用，稳步夯实投资风险管理基础。紧密跟踪各项法律法规要求、加强风险研究，在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。

在监察稽核方面，公司按照法规要求，做好日常合规监控，开展内部检查，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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

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

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

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2601126 号

华夏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：

6.1 审计意见

我们审计了后附的华夏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 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。

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（以下简称“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 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资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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，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。

6.3 其他信息

该基金管理人华夏基金管理有限公司（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。

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。

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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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。

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。

6.5 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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
管祎铭 楼竹君
北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
2026 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏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	982,883.12
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,403,183,606.97
其中：股票投资		1,402,707,957.74
基金投资		-
债券投资		475,649.23

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		-
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		1,404,166,490.09
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		1,117.10
应付赎回款		-
应付管理人报酬		179,511.61
应付托管费		59,837.22
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		1.08
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	197,927.16
负债合计		438,394.17
净资产:		
实收基金	7.4.7.7	1,075,507,833.00
未分配利润	7.4.7.8	328,220,262.92
净资产合计		1,403,728,095.92
负债和净资产总计		1,404,166,490.09

注：①报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3052 元，基金份额总额 1,075,507,833.00 份。

②本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，本报告期自 2025 年 2 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华夏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 2 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 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		584,047,647.99
1.利息收入		33,313.93
其中：存款利息收入	7.4.7.9	33,313.93
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）		470,250,939.66
其中：股票投资收益	7.4.7.10	459,102,798.48
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	504,722.36
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	10,643,418.82
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	112,258,065.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,505,329.08
减：二、营业总支出		3,095,762.11
1.管理人报酬		2,196,595.53
2.托管费		732,198.48
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		0.59
8.其他费用	7.4.7.21	166,967.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		580,951,885.88
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		580,951,885.88
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		580,951,885.88

注：本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，本报告期自 2025 年 2 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：华夏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 2 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 2 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	1,539,507,833.00	-	1,539,507,833.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-464,000,000.00	328,220,262.92	-135,779,737.08
（一）、综合收益总额	-	580,951,885.88	580,951,885.88
（二）、本期基金份额 交易产生的净资产变 动数（净资产减少以 “-”号填列）	-464,000,000.00	-252,731,622.96	-716,731,622.96
其中：1.基金申购款	6,924,000,000.00	323,387,307.85	7,247,387,307.85
2.基金赎回款	-7,388,000,000.00	-576,118,930.81	-7,964,118,930.81
（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	1,075,507,833.00	328,220,262.92	1,403,728,095.92

注：本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，本报告期自 2025 年 2 月 26 日至 2025 年 12 月 31 日。

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：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏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”）已获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〕133 号文《关于准予华夏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》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办

法》、《华夏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》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2025 年 2 月 17 日至 2025 年 2 月 21 日共募集 1,539,507,000.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70035283_A06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 2 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,539,507,833.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 833.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金的标的指数为上证科创板综合指数。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含科创板、创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、股票期权、国债期货、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。通常情况下，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）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%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期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。本会计报表的实际编制期间为 2025 年 2 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

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

1、金融资产分类

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

（1）债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

（2）权益工具

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

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

3、衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

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，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

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。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。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。

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。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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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。当本基金依法有权抵销债权债务且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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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确认为利息收入，将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投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他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按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权。

2、当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率时或者基金可供分配利润金额大于 0 时，基金管理人可进行收益分配。

3、若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

4、本基金收益分配采用现金方式。

5、在符合基金收益分配条件的情况下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。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基金份额净值低于面值；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、监管机关、登记机构、上海证券交易所另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

1、对于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《中国证监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。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

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

根据财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值

税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。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。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10)基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益,其涉及的税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	310,140.77
等于: 本金	310,102.34
加: 应计利息	38.43
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
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	672,742.35
等于: 本金	672,727.50
加: 应计利息	14.85
合计	982,883.12

注: 其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,290,529,525.52	-	1,402,707,957.74	112,178,432.22	
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	396,000.00	16.13	475,649.23	79,633.10
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	396,000.00	16.13	475,649.23	79,633.10

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,290,925,525.52	16.13	1,403,183,606.97	112,258,065.32

注：□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的估值增值。

□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

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

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	165,000.00
可退替代款	32,927.16
合计	197,927.16

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 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	1,539,507,833.00	1,539,507,833.00
本期申购	6,924,000,000.00	6,924,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,388,000,000.00	-7,388,000,000.00
本期末	1,075,507,833.00	1,075,507,833.00

注：本基金在募集期间共募集有效净认购资金 1,539,507,000.00 元，根据本基金招募说明书的规定，认购资金在募集期间产生的利息 89,890.55 元在本基金合同生效后，89,057.55 元计入基金资产，833.00 元折算为 833.00 份基金份额，计入基金份额持有人账户。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	468,693,820.56	112,258,065.32	580,951,885.88
本期基金份额交易产生的变动数	-117,475,637.55	-135,255,985.41	-252,731,622.96
其中：基金申购款	474,459,780.19	-151,072,472.34	323,387,307.85
基金赎回款	-591,935,417.74	15,816,486.93	-576,118,930.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	351,218,183.01	-22,997,920.09	328,220,262.92

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 2 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	17,806.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,507.56
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	33,313.93

注：其他存款利息收入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产生的利息收入。

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 2 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	62,360,686.17
股票投资收益——赎回差价收入	396,742,112.31

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	459,102,798.48

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2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	1,483,465,493.94
减：卖出股票成本总额	1,419,212,789.29
减：交易费用	1,892,018.48
买卖股票差价收入	62,360,686.17

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2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	7,964,118,930.81
减：现金支付赎回款总额	524,382.30
减：赎回股票成本总额	7,566,852,436.20
减：交易费用	-
赎回差价收入	396,742,112.31

7.4.7.11 基金投资收益

无。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年2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	160.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期 兑付）差价收入	504,561.50
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	504,722.36

7.4.7.12.2 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2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	1,871,785.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,367,000.00
减：应计利息总额	149.62
减：交易费用	74.82
买卖债券差价收入	504,561.50

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年2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	10,643,418.82
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	10,643,418.82

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年2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	112,258,065.32
——股票投资	112,178,432.22
——债券投资	79,633.10
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	112,258,065.32

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	89,057.55
替代损益	1,416,271.53
合计	1,505,329.08

7.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

7.4.7.20 信用减值损失

无。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2月26日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	55,000.00
信息披露费	110,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	180.00
存托服务费	1,387.51
其他	400.00
合计	166,967.51

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华夏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（“华夏上证科创板综合 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
Qatar Holding LLC	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
上海华夏财富投资管理有限公司（“华夏财富”）	基金管理人的子公司
华夏资本管理有限公司（“华夏资本”）	基金管理人的子公司
华夏股权投资基金管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
北京华夏金科信息服务有限公司	基金管理人的子公司
China Asset Management（Hong Kong） Limited（中文名：华夏基金（香港）有限公司）	基金管理人的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2025 年 7 月 11 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、Qatar Holding LLC（出资比例 10%）。

②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

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年2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	2,196,595.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	228,543.14
应支付基金管理人的净管理费	1,968,052.39

注：①支付基金管理人的基金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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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2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	732,198.48

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏上证科创板综合 ETF 联接	522,905,100.00	48.62%
中信证券	5,503,100.00	0.51%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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2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
中国建设银行活期存款	310,140.77	17,806.37

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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 2 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：股/张）	总金额
中信证券	688795	摩尔线程	新股发行	2,742	313,355.76
中信证券	688783	西安奕材	新股发行	32,866	283,304.92
中信证券	688807	优迅股份	新股发行	1,303	67,312.98

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

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
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月	新发流通受限	114.28	416.18	1,234	141,021.52	513,566.12	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月	新发流通受限	104.66	399.31	814	85,193.24	325,038.34	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6 个月	新发流通受限	8.62	18.36	14,790	127,489.80	271,544.40	-
688729	屹唐股份	2025-07-01	6 个月	新发流通受限	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6 个月	新发流通受限	83.06	117.19	516	42,858.96	60,470.04	-
688809	强一股份	2025-12-23	6 个月	新发流通受限	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6 个月	新发	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-

				流通受限						
688796	百奥赛图	2025-12-02	6 个月	新发流通受限	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6 个月	新发流通受限	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688805	健信超导	2025-12-17	6 个月	新发流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603418	友升股份	2025-09-16	6 个月	新发流通受限	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6 个月	新发流通受限	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603092	德力佳	2025-10-30	6 个月	新发流通受限	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
601026	道生天合	2025-10-09	6 个月	新发流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-

603406	天富龙	2025-07-30	6 个月	新发流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603262	技源集团	2025-07-16	6 个月	新发流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月	新发流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603370	华新精科	2025-08-27	6 个月	新发流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月	新发流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月	新发流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-

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	2025-	1 个月	新	100.00	100.00	2,570	257,000.00	257,003.94	期

	05 转债	12-25	内 (含)	发 流 通 受 限						未 估 值 单 价 为 含 息 价 格
--	----------	-------	----------	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④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设定限售期的新股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(单位: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	96,583	24,672,669.43	26,340,115.76	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎

评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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	1,402,707,957.74	99.93
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	475,649.23	0.03
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	1,403,183,606.97	99.96

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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	除上证科创板综合指数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
	-5%	-71,859,973.59
	+5%	71,859,973.59

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	1,375,158,950.94
第二层次	26,597,119.70
第三层次	1,427,536.33
合计	1,403,183,606.97

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金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所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

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 2 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	-	511,474.64	511,474.64
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	916,061.69	916,061.69
其中：计入损益的利得或损失	-	916,061.69	916,061.69
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,427,536.33	1,427,536.33
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	-	916,061.69	916,061.69

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,427,536.33	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.18-3.0791	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

截至 2025 年 12 月 31 日止，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

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，其账面价值与公允价值差异很小。

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	1,402,707,957.74	99.90
	其中：股票	1,402,707,957.74	99.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	475,649.23	0.03
	其中：债券	475,649.23	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	982,883.12	0.07
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,404,166,490.09	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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	1,108,653,142.92	78.98
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	267,890,452.93	19.08
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	21,995,268.15	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	4,166,908.58	0.30
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	1,402,705,772.58	99.93

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	688256	寒武纪	62,927	85,300,694.85	6.08
2	688041	海光信息	347,313	77,940,510.33	5.55
3	688981	中芯国际	298,785	36,699,761.55	2.61
4	688012	中微公司	96,583	26,340,115.76	1.88
5	688111	金山办公	69,124	21,225,906.68	1.51
6	688008	澜起科技	170,903	20,132,373.40	1.43
7	688506	百利天恒	61,615	19,907,806.50	1.42
8	688271	联影医疗	123,001	15,436,625.50	1.10
9	688775	影石创新	59,851	14,058,999.90	1.00
10	688072	拓荆科技	41,891	13,824,030.00	0.98
11	688082	盛美上海	71,749	12,631,411.45	0.90
12	688183	生益电子	124,299	11,894,171.31	0.85
13	688036	传音控股	172,020	11,380,843.20	0.81
14	688521	芯原股份	78,577	10,762,691.69	0.77
15	688396	华润微	197,479	10,438,739.94	0.74
16	688126	沪硅产业	476,785	10,317,627.40	0.74
17	688249	晶合集成	298,652	9,912,259.88	0.71
18	688702	盛科通信	60,996	8,642,523.24	0.62
19	688110	东芯股份	65,790	8,641,516.50	0.62
20	688303	大全能源	319,117	8,558,717.94	0.61
21	688223	晶科能源	1,488,469	8,394,965.16	0.60
22	688469	芯联集成	1,247,117	8,343,212.73	0.59
23	688375	国博电子	88,669	8,255,970.59	0.59
24	688498	源杰科技	12,818	8,229,027.82	0.59
25	688472	阿特斯	548,653	8,180,416.23	0.58
26	688361	中科飞测	52,108	7,972,002.92	0.57
27	688525	佰维存储	69,424	7,969,180.96	0.57
28	688120	华海清科	52,623	7,897,659.84	0.56
29	688047	龙芯中科	59,654	7,880,889.94	0.56
30	688027	国盾量子	15,397	7,756,854.63	0.55
31	688585	上纬新材	59,752	7,610,612.24	0.54
32	688122	西部超导	96,631	7,206,739.98	0.51
33	688568	中科星图	120,206	7,092,154.00	0.51
34	688009	中国通号	1,283,863	7,022,730.61	0.50

35	688578	艾力斯	66,943	6,972,113.45	0.50
36	688002	睿创微纳	68,465	6,901,272.00	0.49
37	688629	华丰科技	68,577	6,861,814.62	0.49
38	688187	时代电气	129,275	6,630,514.75	0.47
39	688387	信科移动	508,573	6,560,591.70	0.47
40	688347	华虹公司	60,653	6,542,639.11	0.47
41	688676	金盘科技	68,405	6,179,707.70	0.44
42	688172	燕东微	212,342	6,145,177.48	0.44
43	688313	仕佳光子	68,264	6,060,477.92	0.43
44	689009	九号公司	106,752	5,934,343.68	0.42
45	688169	石头科技	38,680	5,881,680.80	0.42
46	688385	复旦微电	79,695	5,873,521.50	0.42
47	688188	柏楚电子	42,804	5,816,635.56	0.41
48	688778	厦钨新能	75,083	5,809,171.71	0.41
49	688777	中控技术	117,718	5,808,206.12	0.41
50	688728	格科微	386,806	5,778,881.64	0.41
51	688608	恒玄科技	25,113	5,699,144.22	0.41
52	688213	思特威	59,787	5,685,145.83	0.41
53	688234	天岳先进	63,926	5,681,742.88	0.40
54	688019	安集科技	25,092	5,468,048.64	0.39
55	688099	晶晨股份	62,650	5,464,959.50	0.39
56	688538	和辉光电	2,054,432	5,464,789.12	0.39
57	688336	三生国健	91,538	5,452,918.66	0.39
58	688599	天合光能	323,354	5,351,508.70	0.38
59	688322	奥比中光	59,678	5,351,326.26	0.38
60	688065	凯赛生物	107,024	5,329,795.20	0.38
61	688017	绿的谐波	27,310	5,246,251.00	0.37
62	688617	惠泰医疗	21,385	5,202,328.95	0.37
63	688220	翱捷科技	62,035	5,124,711.35	0.37
64	688278	特宝生物	60,715	5,080,631.20	0.36
65	688318	财富趋势	38,232	5,058,858.24	0.36
66	688615	合合信息	21,228	4,831,068.24	0.34
67	688297	中无人机	100,166	4,809,971.32	0.34
68	688819	天能股份	144,271	4,792,682.62	0.34
69	688235	百济神州	17,446	4,685,995.60	0.33
70	688349	三一重能	181,920	4,598,937.60	0.33
71	688333	铂力特	40,588	4,525,967.88	0.32
72	688692	达梦数据	17,171	4,486,267.17	0.32
73	688102	斯瑞新材	114,743	4,445,143.82	0.32
74	688037	芯源微	29,871	4,436,142.21	0.32
75	688295	中复神鹰	133,506	4,380,331.86	0.31
76	688709	成都华微	94,496	4,345,871.04	0.31
77	688147	微导纳米	68,417	4,295,903.43	0.31
78	688018	乐鑫科技	24,881	4,229,770.00	0.30

79	688331	荣昌生物	52,655	4,096,032.45	0.29
80	688433	华曙高科	61,406	4,063,235.02	0.29
81	688343	云天励飞	53,161	4,044,488.88	0.29
82	688425	铁建重工	787,705	3,993,664.35	0.28
83	688192	迪哲医药	68,566	3,949,401.60	0.28
84	688582	芯动联科	59,524	3,935,131.64	0.28
85	688200	华峰测控	20,551	3,908,800.20	0.28
86	688563	航材股份	66,703	3,898,790.35	0.28
87	688180	君实生物	113,721	3,884,709.36	0.28
88	688270	臻镭科技	31,749	3,875,600.43	0.28
89	688114	华大智造	61,967	3,765,114.92	0.27
90	688005	容百科技	106,029	3,753,426.60	0.27
91	688248	南网科技	83,822	3,750,196.28	0.27
92	688708	佳驰科技	59,361	3,695,222.25	0.26
93	688208	道通科技	99,445	3,659,576.00	0.26
94	688266	泽璟制药	39,110	3,625,497.00	0.26
95	688772	珠海冠宇	167,976	3,616,523.28	0.26
96	688561	奇安信	101,216	3,601,265.28	0.26
97	688475	萤石网络	116,889	3,519,527.79	0.25
98	688052	纳芯微	21,612	3,418,586.16	0.24
99	688523	航天环宇	60,293	3,373,996.28	0.24
100	688660	电气风电	197,822	3,364,952.22	0.24
101	688536	思瑞浦	20,895	3,340,692.60	0.24
102	688195	腾景科技	19,613	3,325,384.15	0.24
103	688048	长光华芯	26,041	3,264,239.35	0.23
104	688205	德科立	23,321	3,206,171.08	0.23
105	688301	奕瑞科技	31,523	3,187,290.53	0.23
106	688627	精智达	14,255	3,187,275.45	0.23
107	688146	中船特气	78,526	3,172,450.40	0.23
108	688698	伟创电气	31,881	3,152,393.28	0.22
109	688502	茂莱光学	7,847	3,131,345.35	0.22
110	688363	华熙生物	71,586	3,126,876.48	0.22
111	688166	博瑞医药	62,729	3,077,484.74	0.22
112	688449	联芸科技	68,108	3,077,119.44	0.22
113	688409	富创精密	45,338	3,055,781.20	0.22
114	688281	华秦科技	40,115	2,960,487.00	0.21
115	688088	虹软科技	59,559	2,948,170.50	0.21
116	688123	聚辰股份	23,319	2,928,400.02	0.21
117	688400	凌云光	68,357	2,896,969.66	0.21
118	688141	杰华特	66,626	2,893,567.18	0.21
119	688100	威胜信息	73,156	2,875,030.80	0.20
120	688520	神州细胞	66,035	2,859,975.85	0.20
121	688548	广钢气体	196,169	2,852,297.26	0.20
122	688279	峰昭科技	13,997	2,848,249.53	0.20

123	688766	普冉股份	22,374	2,846,196.54	0.20
124	688567	孚能科技	181,249	2,836,546.85	0.20
125	688519	南亚新材	34,505	2,790,074.30	0.20
126	688630	芯碁微装	19,976	2,687,371.28	0.19
127	688353	华盛锂电	23,505	2,672,518.50	0.19
128	688006	杭可科技	89,590	2,624,091.10	0.19
129	688668	鼎通科技	21,037	2,608,588.00	0.19
130	688798	艾为电子	34,253	2,606,995.83	0.19
131	688388	嘉元科技	63,286	2,593,460.28	0.18
132	688484	南芯科技	63,416	2,578,494.56	0.18
133	688116	天奈科技	54,389	2,564,441.35	0.18
134	688800	瑞可达	30,662	2,544,946.00	0.18
135	688097	博众精工	66,239	2,500,522.25	0.18
136	688372	伟测科技	22,526	2,457,361.34	0.18
137	688652	京仪装备	24,789	2,437,006.59	0.17
138	688153	唯捷创芯	63,861	2,403,728.04	0.17
139	688332	中科蓝讯	18,226	2,393,256.06	0.17
140	688167	炬光科技	13,484	2,360,643.88	0.17
141	688382	益方生物	85,772	2,336,429.28	0.17
142	688127	蓝特光学	60,153	2,315,288.97	0.16
143	688432	有研硅	185,071	2,296,731.11	0.16
144	688686	奥普特	18,473	2,293,053.49	0.16
145	688029	南微医学	27,987	2,282,619.72	0.16
146	688062	迈威生物	59,246	2,279,193.62	0.16
147	688068	热景生物	14,057	2,277,234.00	0.16
148	688390	固德威	36,263	2,253,020.19	0.16
149	688206	概伦电子	64,467	2,245,385.61	0.16
150	688300	联瑞新材	36,034	2,237,351.06	0.16
151	688131	皓元医药	31,019	2,235,849.52	0.16
152	688198	佰仁医疗	20,817	2,227,627.17	0.16
153	688352	颀中科技	175,665	2,215,135.65	0.16
154	688327	云从科技	154,137	2,214,948.69	0.16
155	688789	宏华数科	26,848	2,189,991.36	0.16
156	688503	聚和材料	35,622	2,172,942.00	0.15
157	688584	上海合晶	98,679	2,165,017.26	0.15
158	688726	拉普拉斯	59,882	2,155,752.00	0.15
159	688779	五矿新能	286,583	2,146,506.67	0.15
160	688516	奥特维	46,887	2,122,105.62	0.15
161	688306	均普智能	182,803	2,120,514.80	0.15
162	688326	经纬恒润	18,000	2,115,000.00	0.15
163	688160	步科股份	13,727	2,093,367.50	0.15
164	688403	汇成股份	127,487	2,088,237.06	0.15
165	688063	派能科技	36,134	2,053,133.88	0.15
166	688612	威迈斯	62,187	2,050,305.39	0.15

167	688025	杰普特	14,364	2,033,511.48	0.14
168	688228	开普云	10,410	2,025,890.10	0.14
169	688001	华兴源创	66,135	1,995,954.30	0.14
170	688549	中巨芯	218,002	1,988,178.24	0.14
171	688362	甬矽电子	60,788	1,970,139.08	0.14
172	688031	星环科技	18,177	1,966,569.63	0.14
173	688392	骄成超声	17,366	1,948,465.20	0.14
174	688380	中微半导	59,348	1,908,038.20	0.14
175	688158	优刻得	67,717	1,902,170.53	0.14
176	688605	先锋精科	29,524	1,897,212.24	0.14
177	688543	国科军工	30,518	1,894,252.26	0.13
178	688439	振华风光	29,158	1,883,606.80	0.13
179	688032	禾迈股份	18,618	1,876,508.22	0.13
180	688239	航宇科技	27,717	1,875,609.39	0.13
181	688165	埃夫特	77,338	1,837,550.88	0.13
182	688691	灿芯股份	18,007	1,836,353.86	0.13
183	688552	航天南湖	50,213	1,823,736.16	0.13
184	688522	纳睿雷达	44,856	1,791,100.08	0.13
185	688055	龙腾光电	494,492	1,780,171.20	0.13
186	688321	微芯生物	60,847	1,777,949.34	0.13
187	688233	神工股份	25,355	1,775,610.65	0.13
188	688190	云路股份	18,007	1,753,881.80	0.12
189	688182	灿勤科技	59,319	1,751,096.88	0.12
190	688128	中国电研	60,008	1,745,032.64	0.12
191	688559	海目星	36,243	1,741,838.58	0.12
192	688083	中望软件	25,256	1,720,186.16	0.12
193	688050	爱博医疗	28,144	1,707,215.04	0.12
194	688016	心脉医疗	18,496	1,695,343.36	0.12
195	688003	天准科技	28,285	1,665,986.50	0.12
196	688125	安达智能	12,323	1,664,221.15	0.12
197	688631	莱斯信息	24,329	1,656,318.32	0.12
198	688161	威高骨科	59,313	1,656,018.96	0.12
199	688776	国光电气	16,263	1,638,334.62	0.12
200	688289	圣湘生物	86,228	1,630,571.48	0.12
201	688531	日联科技	24,648	1,627,507.44	0.12
202	688535	华海诚科	14,510	1,626,280.80	0.12
203	688351	微电生理	70,119	1,623,254.85	0.12
204	688150	莱特光电	59,976	1,621,151.28	0.12
205	688107	安路科技	59,517	1,617,672.06	0.12
206	688577	浙海德曼	16,698	1,617,368.28	0.12
207	688739	成大生物	61,708	1,589,598.08	0.11
208	688513	苑东生物	25,749	1,584,850.95	0.11
209	688368	晶丰明源	13,721	1,583,815.03	0.11
210	688788	科思科技	23,340	1,571,715.60	0.11

211	688261	东微半导体	19,064	1,563,438.64	0.11
212	688700	东威科技	44,161	1,558,000.08	0.11
213	688690	纳微科技	60,128	1,551,903.68	0.11
214	688109	品茗科技	12,191	1,549,476.10	0.11
215	688586	江航装备	117,920	1,537,676.80	0.11
216	688486	龙迅股份	20,630	1,533,015.30	0.11
217	688319	欧林生物	60,376	1,531,135.36	0.11
218	688262	国芯科技	50,093	1,520,322.55	0.11
219	688093	世华科技	41,203	1,518,330.55	0.11
220	688658	悦康药业	66,802	1,510,393.22	0.11
221	688028	沃尔德	23,374	1,508,557.96	0.11
222	688139	海尔生物	47,400	1,506,372.00	0.11
223	688591	泰凌微	35,206	1,498,367.36	0.11
224	688443	智翔金泰	54,370	1,481,038.80	0.11
225	688275	万润新能	19,596	1,477,538.40	0.11
226	688717	艾罗能源	23,809	1,466,634.40	0.10
227	688656	浩欧博	9,525	1,464,945.00	0.10
228	688603	天承科技	19,402	1,454,373.92	0.10
229	688258	卓易信息	18,823	1,441,277.11	0.10
230	688177	百奥泰	61,717	1,428,131.38	0.10
231	688562	航天软件	59,641	1,424,227.08	0.10
232	688556	高测股份	123,337	1,408,508.54	0.10
233	688106	金宏气体	71,874	1,408,011.66	0.10
234	688499	利元亨	24,349	1,405,424.28	0.10
235	688091	上海谊众	29,874	1,404,078.00	0.10
236	688222	成都先导	59,687	1,399,660.15	0.10
237	688507	索辰科技	13,919	1,395,936.51	0.10
238	688626	翔宇医疗	23,006	1,391,863.00	0.10
239	688593	新相微	68,410	1,380,513.80	0.10
240	688750	金天钛业	68,688	1,371,699.36	0.10
241	688539	高华科技	27,698	1,371,327.98	0.10
242	688596	正帆科技	43,128	1,364,138.64	0.10
243	688401	路维光电	27,875	1,360,578.75	0.10
244	688408	中信博	31,911	1,343,772.21	0.10
245	688049	炬芯科技	25,339	1,332,831.40	0.09
246	688210	统联精密	24,088	1,332,548.16	0.09
247	688230	芯导科技	18,305	1,326,746.40	0.09
248	688138	清溢光电	46,637	1,313,297.92	0.09
249	688648	中邮科技	21,103	1,296,990.38	0.09
250	688252	天德钰	60,901	1,289,274.17	0.09
251	688209	英集芯	64,406	1,284,255.64	0.09
252	688305	科德数控	20,661	1,276,849.80	0.09
253	688257	新锐股份	37,217	1,275,798.76	0.09
254	688007	光峰科技	68,551	1,272,992.07	0.09

255	688685	迈信林	22,856	1,268,050.88	0.09
256	688515	裕太微	12,316	1,263,005.80	0.09
257	688066	航天宏图	38,596	1,256,685.76	0.09
258	688095	福昕软件	14,077	1,256,653.79	0.09
259	688366	昊海生科	28,443	1,248,647.70	0.09
260	688383	新益昌	15,924	1,246,371.48	0.09
261	688508	芯朋微	20,416	1,243,334.40	0.09
262	688456	有研粉材	15,976	1,241,335.20	0.09
263	688518	联赢激光	50,844	1,235,000.76	0.09
264	688386	泛亚微透	14,025	1,228,590.00	0.09
265	688661	和林微纳	23,580	1,220,500.80	0.09
266	688696	极米科技	10,936	1,219,145.28	0.09
267	688348	昱能科技	24,168	1,217,825.52	0.09
268	688611	杭州柯林	23,813	1,210,891.05	0.09
269	688575	亚辉龙	85,020	1,207,284.00	0.09
270	688418	震有科技	27,751	1,206,613.48	0.09
271	688376	美埃科技	20,691	1,196,353.62	0.09
272	688639	华恒生物	36,699	1,195,653.42	0.09
273	688108	赛诺医疗	62,090	1,194,611.60	0.09
274	688232	新点软件	47,753	1,185,229.46	0.08
275	688570	天玛智控	64,321	1,184,792.82	0.08
276	688105	诺唯赞	58,899	1,179,157.98	0.08
277	688325	赛微微电	13,461	1,178,241.33	0.08
278	688202	美迪西	20,857	1,176,334.80	0.08
279	688155	先惠技术	19,452	1,175,873.40	0.08
280	688196	卓越新能	19,762	1,163,981.80	0.08
281	688276	百克生物	61,507	1,160,022.02	0.08
282	688225	亚信安全	59,588	1,156,007.20	0.08
283	688059	华锐精密	14,567	1,146,422.90	0.08
284	688227	品高股份	17,566	1,141,965.66	0.08
285	688550	瑞联新材	24,890	1,127,765.90	0.08
286	688553	汇宇制药-W	63,130	1,123,082.70	0.08
287	688625	呈和科技	27,258	1,123,029.60	0.08
288	688622	禾信仪器	11,002	1,112,632.26	0.08
289	688185	康希诺	17,671	1,110,622.35	0.08
290	688787	海天瑞声	9,452	1,096,337.48	0.08
291	688191	智洋创新	34,029	1,095,053.22	0.08
292	688311	盟升电子	23,988	1,093,852.80	0.08
293	688621	阳光诺和	17,402	1,081,534.30	0.08
294	688268	华特气体	18,721	1,074,398.19	0.08
295	688365	光云科技	63,490	1,071,076.30	0.08
296	688636	智明达	24,838	1,064,059.92	0.08
297	688151	华强科技	51,371	1,059,270.02	0.08
298	688526	科前生物	69,361	1,058,448.86	0.08

299	688035	德邦科技	21,922	1,057,736.50	0.08
300	688697	纽威数控	68,225	1,049,300.50	0.07
301	688707	振华新材	75,746	1,049,082.10	0.07
302	688337	普源精电	27,882	1,028,566.98	0.07
303	688377	迪威尔	27,964	1,026,278.80	0.07
304	688510	航亚科技	38,146	1,026,127.40	0.07
305	688277	天智航	67,541	1,025,947.79	0.07
306	688488	艾迪药业	62,712	1,024,086.96	0.07
307	688226	威腾电气	27,432	1,017,727.20	0.07
308	688219	会通股份	81,875	1,016,887.50	0.07
309	688221	前沿生物	55,875	1,008,543.75	0.07
310	688359	三孚新科	15,055	1,003,114.65	0.07
311	688378	奥来德	36,731	1,002,756.30	0.07
312	688143	长盈通	19,826	995,463.46	0.07
313	688011	新光光电	15,513	990,349.92	0.07
314	688711	宏微科技	31,077	986,073.21	0.07
315	688176	亚虹医药	85,057	979,006.07	0.07
316	688236	春立医疗	42,619	975,122.72	0.07
317	688799	华纳药厂	20,404	973,270.80	0.07
318	688710	益诺思	21,905	967,105.75	0.07
319	688084	晶品特装	11,660	965,448.00	0.07
320	688721	龙图光罩	20,743	965,171.79	0.07
321	688720	艾森股份	13,517	951,326.46	0.07
322	688231	隆达股份	36,355	945,230.00	0.07
323	688290	景业智能	15,878	943,788.32	0.07
324	688186	广大特材	41,453	940,154.04	0.07
325	688046	药康生物	61,045	937,651.20	0.07
326	688119	中钢洛耐	167,639	937,102.01	0.07
327	688678	福立旺	38,283	925,682.94	0.07
328	688371	菲沃泰	50,008	923,647.76	0.07
329	688136	科兴制药	29,020	919,063.40	0.07
330	688212	澳华内镜	20,924	914,588.04	0.07
331	688334	西高院	47,174	913,288.64	0.07
332	688103	国力电子	14,874	901,215.66	0.06
333	688173	希荻微	61,261	900,536.70	0.06
334	688085	三友医疗	49,735	896,224.70	0.06
335	688399	硕世生物	13,064	894,884.00	0.06
336	688168	安博通	11,845	890,270.20	0.06
337	688601	力芯微	20,773	884,722.07	0.06
338	688157	松井股份	24,273	879,410.79	0.06
339	688505	复旦张江	105,878	878,787.40	0.06
340	688767	博拓生物	23,203	876,609.34	0.06
341	688598	金博股份	29,805	875,074.80	0.06
342	688320	禾川科技	23,432	874,482.24	0.06

343	688623	双元科技	9,271	870,546.90	0.06
344	688293	奥浦迈	17,643	864,507.00	0.06
345	688566	吉贝尔	28,936	863,739.60	0.06
346	688073	毕得医药	14,139	863,185.95	0.06
347	688087	英科再生	27,970	862,035.40	0.06
348	688020	方邦股份	12,644	860,044.88	0.06
349	688112	鼎阳科技	22,944	859,252.80	0.06
350	688282	理工导航	13,497	857,059.50	0.06
351	688588	凌志软件	58,834	841,914.54	0.06
352	688663	新风光	21,672	840,223.44	0.06
353	688733	壹石通	28,989	840,101.22	0.06
354	688117	圣诺生物	22,221	839,731.59	0.06
355	688090	瑞松科技	18,859	838,848.32	0.06
356	688381	帝奥微	36,454	831,515.74	0.06
357	688682	霍莱沃	15,695	830,422.45	0.06
358	688360	德马科技	38,980	828,714.80	0.06
359	688389	普门科技	63,602	825,553.96	0.06
360	688315	诺禾致源	61,962	822,855.36	0.06
361	688135	利扬芯片	29,415	816,560.40	0.06
362	688101	三达膜	49,400	812,136.00	0.06
363	688023	安恒信息	15,762	810,324.42	0.06
364	688428	诺诚健华	39,373	807,933.96	0.06
365	688269	凯立新材	20,144	805,961.44	0.06
366	688489	三未信安	17,602	804,587.42	0.06
367	688197	首药控股	23,107	802,737.18	0.06
368	688478	晶升股份	21,325	797,768.25	0.06
369	688677	海泰新光	18,455	796,517.80	0.06
370	688719	爱科赛博	17,928	791,521.20	0.06
371	688716	中研股份	18,662	790,335.70	0.06
372	688429	时创能源	59,710	781,603.90	0.06
373	688356	键凯科技	9,502	781,064.40	0.06
374	688606	奥泰生物	12,219	780,671.91	0.06
375	688330	宏力达	21,577	779,577.01	0.06
376	688683	莱尔科技	24,382	772,909.40	0.06
377	688480	赛恩斯	14,976	771,114.24	0.05
378	688039	当虹科技	17,230	771,042.50	0.05
379	688653	康希通信	63,404	770,358.60	0.05
380	688379	华光新材	13,955	768,362.30	0.05
381	688512	慧智微	68,788	767,674.08	0.05
382	688339	亿华通	28,328	763,722.88	0.05
383	688280	精进电动	87,674	762,763.80	0.05
384	688609	九联科技	74,541	761,063.61	0.05
385	688075	安旭生物	19,586	757,390.62	0.05
386	688283	坤恒顺维	18,681	752,844.30	0.05

387	688302	海创药业	15,260	750,334.20	0.05
388	688665	四方光电	15,352	748,717.04	0.05
389	688070	纵横股份	13,432	744,132.80	0.05
390	688312	燕麦科技	22,331	740,942.58	0.05
391	688581	安杰思	12,620	739,910.60	0.05
392	688299	长阳科技	42,653	721,688.76	0.05
393	688595	芯海科技	21,950	719,960.00	0.05
394	688259	创耀科技	17,215	719,587.00	0.05
395	688500	慧辰股份	11,635	718,577.60	0.05
396	688699	明微电子	16,881	717,611.31	0.05
397	688410	山外山	47,843	716,209.71	0.05
398	688590	新致软件	38,251	713,763.66	0.05
399	688267	中触媒	25,279	712,109.43	0.05
400	688580	伟思医疗	14,689	710,947.60	0.05
401	688215	瑞晟智能	9,774	708,712.74	0.05
402	688308	欧科亿	22,393	708,514.52	0.05
403	688010	福光股份	22,733	707,450.96	0.05
404	688620	安凯微	58,355	702,594.20	0.05
405	688416	恒烁股份	12,719	701,198.47	0.05
406	688159	有方科技	14,393	695,757.62	0.05
407	688458	美芯晟	17,525	694,691.00	0.05
408	688662	富信科技	13,533	693,566.25	0.05
409	688201	信安世纪	47,350	692,730.50	0.05
410	688079	美迪凯	60,397	683,694.04	0.05
411	688459	哈铁科技	70,825	683,461.25	0.05
412	688298	东方生物	29,082	681,391.26	0.05
413	688533	上声电子	23,301	681,321.24	0.05
414	688286	敏芯股份	8,629	681,259.55	0.05
415	688291	金橙子	15,822	675,915.84	0.05
416	688115	思林杰	10,276	673,900.08	0.05
417	688569	铁科轨道	30,666	673,732.02	0.05
418	688237	超卓航科	13,743	669,971.25	0.05
419	688181	八亿时空	20,726	669,864.32	0.05
420	688602	康鹏科技	76,996	668,325.28	0.05
421	688148	芳源股份	75,978	666,327.06	0.05
422	688610	埃科光电	10,629	656,978.49	0.05
423	688273	麦澜德	15,412	655,318.24	0.05
424	688292	浩瀚深度	22,367	648,643.00	0.05
425	688247	宣泰医药	66,863	648,571.10	0.05
426	688162	巨一科技	21,042	648,093.60	0.05
427	688033	天宜新材	83,823	645,437.10	0.05
428	688238	和元生物	96,653	643,708.98	0.05
429	688722	同益中	32,908	643,351.40	0.05
430	688175	高凌信息	19,833	638,820.93	0.05

431	688211	中科微至	20,679	636,913.20	0.05
432	688579	山大地纬	58,828	634,165.84	0.05
433	688152	麒麟信安	15,656	631,719.60	0.05
434	688253	英诺特	20,929	631,637.22	0.04
435	688509	正元地信	114,379	627,940.71	0.04
436	688786	悦安新材	22,139	624,541.19	0.04
437	688255	凯尔达	17,047	624,431.61	0.04
438	688015	交控科技	27,246	620,663.88	0.04
439	688179	阿拉丁	49,643	620,041.07	0.04
440	688335	复洁科技	22,815	615,092.40	0.04
441	688687	凯因科技	24,326	606,203.92	0.04
442	688171	纬德信息	12,848	599,487.68	0.04
443	688435	英方软件	12,806	598,936.62	0.04
444	688013	天臣医疗	12,447	598,451.76	0.04
445	688373	盟科药业	97,498	588,887.92	0.04
446	688307	中润光学	13,562	586,014.02	0.04
447	688558	国盛智科	20,245	585,687.85	0.04
448	688768	容知日新	13,409	582,486.96	0.04
449	688607	康众医疗	13,582	581,309.60	0.04
450	688323	瑞华泰	25,768	580,037.68	0.04
451	688244	永信至诚	23,720	579,716.80	0.04
452	688207	格灵深瞳	37,838	575,137.60	0.04
453	688080	映翰通	11,382	574,791.00	0.04
454	688061	灿瑞科技	17,621	574,620.81	0.04
455	688081	兴图新科	15,880	572,950.40	0.04
456	688557	兰剑智能	15,676	571,076.68	0.04
457	688089	嘉必优	24,239	564,283.92	0.04
458	688689	银河微电	19,866	563,797.08	0.04
459	688667	菱电电控	7,985	562,303.70	0.04
460	688628	优利德	17,343	552,201.12	0.04
461	688317	之江生物	27,231	549,249.27	0.04
462	688098	申联生物	61,314	544,468.32	0.04
463	688199	久日新材	23,029	542,793.53	0.04
464	688077	大地熊	17,643	538,993.65	0.04
465	688679	通源环境	20,197	537,240.20	0.04
466	688657	浩辰软件	10,086	536,676.06	0.04
467	688448	磁谷科技	11,043	535,254.21	0.04
468	688260	昀冢科技	18,474	532,051.20	0.04
469	688633	星球石墨	22,349	529,224.32	0.04
470	688358	祥生医疗	17,280	520,128.00	0.04
471	688600	皖仪科技	20,761	520,063.05	0.04
472	688370	丛麟科技	21,131	514,962.47	0.04
473	688170	德龙激光	16,340	514,056.40	0.04
474	688795	摩尔线程	1,234	513,566.12	0.04

475	688133	泰坦科技	23,179	513,183.06	0.04
476	688651	盛邦安全	11,620	511,512.40	0.04
477	688357	建龙微纳	15,421	509,664.05	0.04
478	688592	司南导航	12,400	509,640.00	0.04
479	688589	力合微	22,398	509,554.50	0.04
480	688391	钜泉科技	17,745	502,715.85	0.04
481	688501	青达环保	18,876	498,892.68	0.04
482	688057	金达莱	40,731	497,732.82	0.04
483	688680	海优新材	12,949	495,299.25	0.04
484	688419	耐科装备	17,655	494,163.45	0.04
485	688265	南模生物	12,016	492,776.16	0.04
486	688246	嘉和美康	21,182	492,481.50	0.04
487	688345	博力威	15,589	486,376.80	0.03
488	688285	高铁电气	55,889	485,116.52	0.03
489	688350	富淼科技	18,734	482,025.82	0.03
490	688051	佳华科技	12,154	481,419.94	0.03
491	688455	科捷智能	23,886	479,869.74	0.03
492	688551	科威尔	12,957	477,206.31	0.03
493	688030	山石网科	25,766	468,168.22	0.03
494	688571	杭华股份	62,482	465,490.90	0.03
495	688251	井松智能	15,526	456,464.40	0.03
496	688618	三旺通信	17,009	453,459.94	0.03
497	688369	致远互联	17,757	451,560.51	0.03
498	688316	青云科技	7,367	443,272.39	0.03
499	688529	豪森智能	23,894	440,605.36	0.03
500	688132	邦彦技术	23,888	440,016.96	0.03
501	688576	西山科技	6,978	439,334.88	0.03
502	688071	华依科技	13,067	433,432.39	0.03
503	688669	聚石化学	18,609	432,473.16	0.03
504	688137	近岸蛋白	10,763	431,058.15	0.03
505	688468	科美诊断	58,605	430,160.70	0.03
506	688229	博睿数据	6,843	428,919.24	0.03
507	688613	奥精医疗	21,116	428,865.96	0.03
508	688338	赛科希德	16,358	423,345.04	0.03
509	688693	锆威特	11,301	423,109.44	0.03
510	688328	深科达	14,487	422,730.66	0.03
511	688485	九州一轨	23,552	420,167.68	0.03
512	688367	工大高科	13,504	418,083.84	0.03
513	688218	江苏北人	18,279	417,126.78	0.03
514	688479	友车科技	22,134	416,783.22	0.03
515	688045	必易微	10,763	416,420.47	0.03
516	688288	鸿泉技术	15,511	415,849.91	0.03
517	688737	中自科技	18,427	413,501.88	0.03
518	688426	康为世纪	17,337	413,140.71	0.03

519	688560	明冠新材	28,897	412,938.13	0.03
520	688314	康拓医疗	12,460	411,927.60	0.03
521	688398	赛特新材	23,851	405,467.00	0.03
522	688597	煜邦电力	49,006	402,339.26	0.03
523	688496	清越科技	67,375	400,207.50	0.03
524	688060	云涌科技	9,232	390,790.56	0.03
525	688113	联测科技	9,877	390,437.81	0.03
526	688130	晶华微	18,632	390,154.08	0.03
527	688069	德林海	17,331	388,734.33	0.03
528	688022	瀚川智能	25,327	387,503.10	0.03
529	688670	金迪克	18,987	384,107.01	0.03
530	688272	富吉瑞	11,656	380,684.96	0.03
531	688203	海正生材	29,645	378,863.10	0.03
532	688121	卓然股份	34,298	374,534.16	0.03
533	688129	东来技术	18,478	373,809.94	0.03
534	688530	欧莱新材	22,500	369,900.00	0.03
535	688216	气派科技	16,427	365,993.56	0.03
536	688619	罗普特	26,813	364,656.80	0.03
537	688310	迈得医疗	23,590	361,634.70	0.03
538	688163	赛伦生物	16,598	361,338.46	0.03
539	688118	普元信息	14,082	359,372.64	0.03
540	688695	中创股份	13,044	357,796.92	0.03
541	688655	迅捷兴	20,458	350,445.54	0.02
542	688056	莱伯泰科	10,345	347,695.45	0.02
543	688026	洁特生物	21,528	346,816.08	0.02
544	688573	信宇人	14,993	341,690.47	0.02
545	688393	安必平	14,351	339,975.19	0.02
546	688355	明志科技	19,011	338,395.80	0.02
547	688517	金冠电气	20,953	326,657.27	0.02
548	688802	沐曦股份	814	325,038.34	0.02
549	688058	宝兰德	11,922	324,636.06	0.02
550	688189	南新制药	40,635	323,860.95	0.02
551	688420	美腾科技	13,563	323,748.81	0.02
552	688395	正弦电气	13,282	323,018.24	0.02
553	688718	唯赛勃	24,465	320,002.20	0.02
554	688092	爱科科技	12,682	318,825.48	0.02
555	688038	中科通达	17,848	315,374.16	0.02
556	688178	万德斯	13,057	313,759.71	0.02
557	688616	西力科技	25,561	312,611.03	0.02
558	688638	誉辰智能	8,589	312,038.37	0.02
559	688078	龙软科技	11,180	307,450.00	0.02
560	688466	金科环境	18,883	307,226.41	0.02
561	688193	仁度生物	6,218	300,764.66	0.02
562	688671	碧兴物联	12,043	298,305.11	0.02

563	688309	恒誉环保	12,271	296,099.23	0.02
564	688793	倍轻松	13,182	287,367.60	0.02
565	688681	科汇股份	16,241	285,516.78	0.02
566	688004	博汇科技	12,283	284,105.79	0.02
567	688450	光格科技	10,241	282,446.78	0.02
568	688783	西安奕材	14,790	271,544.40	0.02
569	688565	力源科技	23,869	267,094.11	0.02
570	688096	京源环保	33,571	265,210.90	0.02
571	688329	艾隆科技	12,204	259,823.16	0.02
572	688067	爱威科技	10,551	259,132.56	0.02
573	688528	秦川物联	23,755	255,841.35	0.02
574	688156	路德科技	15,447	247,306.47	0.02
575	688217	睿昂基因	8,830	232,670.50	0.02
576	688296	和达科技	17,111	226,720.75	0.02
577	688021	奥福科技	12,080	221,668.00	0.02
578	688659	元琛科技	22,835	215,790.75	0.02
579	688701	卓锦股份	20,695	168,664.25	0.01
580	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.01
581	688790	昂瑞微	516	60,470.04	0.00
582	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
583	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
584	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
585	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
586	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
587	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
588	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
589	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
590	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
591	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
592	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
593	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
594	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
595	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
596	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	117,305,485.29	8.36
2	688256	寒武纪	106,464,554.89	7.58

3	688981	中芯国际	62,841,743.56	4.48
4	688111	金山办公	52,297,356.05	3.73
5	688012	中微公司	41,331,233.91	2.94
6	688271	联影医疗	36,975,683.77	2.63
7	688608	恒玄科技	36,481,217.95	2.60
8	688036	传音控股	34,219,907.81	2.44
9	688506	百利天恒	34,022,300.14	2.42
10	688008	澜起科技	30,425,254.22	2.17
11	688617	惠泰医疗	30,012,292.17	2.14
12	688169	石头科技	26,659,313.46	1.90
13	688775	影石创新	25,289,895.34	1.80
14	688223	晶科能源	21,107,569.94	1.50
15	688396	华润微	20,785,273.68	1.48
16	688017	绿的谐波	20,616,219.29	1.47
17	688235	百济神州	20,572,464.14	1.47
18	688027	国盾量子	20,423,201.75	1.45
19	688052	纳芯微	20,013,117.50	1.43
20	688188	柏楚电子	19,888,664.60	1.42

注：“买入金额”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	688041	海光信息	46,565,343.04	3.32
2	688256	寒武纪	26,109,212.54	1.86
3	688608	恒玄科技	24,195,143.84	1.72
4	688617	惠泰医疗	23,648,367.12	1.68
5	688981	中芯国际	18,630,212.75	1.33
6	688027	国盾量子	17,445,340.17	1.24
7	688235	百济神州	16,920,056.71	1.21
8	688169	石头科技	15,950,716.11	1.14
9	688052	纳芯微	14,208,626.51	1.01
10	688188	柏楚电子	13,164,136.93	0.94
11	688018	乐鑫科技	12,839,714.22	0.91
12	688019	安集科技	12,610,503.08	0.90
13	688279	峰岬科技	12,233,563.95	0.87
14	688017	绿的谐波	12,174,229.93	0.87
15	688200	华峰测控	11,704,104.18	0.83
16	688318	财富趋势	11,624,970.65	0.83
17	688536	思瑞浦	11,075,533.58	0.79
18	688111	金山办公	9,968,960.83	0.71

19	688498	源杰科技	9,673,849.09	0.69
20	688502	茂莱光学	9,464,299.08	0.67

注：“卖出金额”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	3,119,068,103.41
卖出股票收入（成交）总额	1,483,465,493.94

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

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）	475,649.23	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	475,649.23	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118063	金 05 转债	2,570	257,003.94	0.02
2	118062	天准转债	1,390	218,645.29	0.02
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

8.13.4 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。

8.13.5 期末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	26,340,115.76	1.88	重大事项

8.13.6 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		华夏上证科创板综合 ETF 联接	
		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
4,339	247,869.98	361,857,230.00	33.65%	190,745,503.00	17.74%	522,905,100.00	48.62%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并别重。

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	231,000,000.00	21.48%
2	国泰海通证券股份有限公司	20,403,355.00	1.90%
3	方正证券股份有限公司	12,007,600.00	1.12%
4	华泰证券股份有限公司	10,520,000.00	0.98%
5	柯庆杰	9,880,000.00	0.92%
6	招商证券股份有限公司	8,487,206.00	0.79%
7	联储证券股份有限公司	7,702,600.00	0.72%
8	长江证券股份有限公司	6,055,000.00	0.56%
9	中信建投证券股份有限公司	6,020,765.00	0.56%
10	中信证券股份有限公司	5,503,100.00	0.51%
11	中国建设银行股份有限公司-华夏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	522,905,100.00	48.62%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	31,700.00	0.00%

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的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 2 月 26 日）基金份额总额	1,539,507,833.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,924,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,388,000,000.00
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	1,075,507,833.00

注：本基金合同于 2025 年 2 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

本报告期内，邹迎光先生担任本基金管理人董事长，李一梅女士担任本基金管理人副董事长，张佑君先生离任本基金管理人董事长。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 55,000.00 元人民币。本基金本报告期内选聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供首年审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	华夏基金管理有限公司

受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 11 月 4 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
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	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《证券发行与承销管理办法(2018 年修订)》《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券基金经营机构信息技术管理办法(2021 年修正)》《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法(2021 年修正)》
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
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
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 12 月 26 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
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	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理、其他问题（内部控制、销售管理等）
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	基金管理人高度重视，从业务改进、制度优化、培训宣贯等方面进行了整改，现已完成全部整改工作，并向监管机构报送整改报告。
其他	无

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	7	4,600,470,440.88	100.00%	855,532.13	100.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④本基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效，除本表列示外，本基金本报告期未选择其他交易单元作为本基金交易单元。

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

				比例				
兴业证券	1,871,785.94	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	华夏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	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-27
2	华夏基金管理有限公司关于华夏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提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
3	华夏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	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
4	华夏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	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
5	华夏基金管理有限公司关于调整华夏上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-04
6	华夏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	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-05
7	华夏基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-07
8	华夏基金管理有限公司关于广州分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-12
9	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-07-11
10	华夏基金管理有限公司关于设立北京华夏金科信息服务有限公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-08-06
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-01
12	华夏基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在首批科创成长层股票上市首日的风险提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-10-28
13	华夏基金管理有限公司关于调整旗下部分交易型开放式指数证券投资基金申购赎回现金替代相关内容并修订招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-11-24
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-12-12

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	2025-09-11至2025-12-31	-	263,332,700.00	32,332,700.00	231,000,000.00	21.48%
华夏上证科创板综合ETF联接	1	2025-04-17至2025-12-31	-	3,954,035,100.00	3,431,130,000.00	522,905,100.00	48.62%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§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、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日