

中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:华夏银行股份有限公司

报告送出日期: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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准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06月24日（基金合同生效日）起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
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	59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§ 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 10 开放式基金份额变动	61
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	64
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投上证科创板综合指数增强	
基金主代码	024390	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 06 月 24 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	37,682,652.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投上证科创板综合指数增强 A	中信建投上证科创板综合指数增强 C
下属分级基金的交易代码	024390	024391
报告期末下属分级基金的份额总额	5,775,062.42 份	31,907,590.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为指数增强型基金，在力求对上证科创板综合指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。</p>
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以上证科创板综合指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力争实现超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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		中信建投基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	朱绍纲
	联系电话	010-59100208	010-85238309
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	zhzsg@hxb.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95577
传真		010-59100298	010-85238680
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市东城区建国门内大街 22 号
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市东城区建国门内大街 22 号
邮政编码		100010	100005
法定代表人		黄凌	杨书剑

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 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 06 月 24 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日	
	中信建投上证科创板综合指数增强 A	中信建投上证科创板综合指数增强 C
本期已实现收益	3,085,109.18	10,635,568.27
本期利润	3,219,170.56	11,080,204.88
加权平均基金份额本期利润	0.2004	0.1494

本期加权平均净值利润率	18.78%	14.06%
本期基金份额净值增长率	17.01%	16.77%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	982,290.18	5,349,592.91
期末可供分配基金份额利润	0.1701	0.1677
期末基金资产净值	6,757,352.60	37,257,183.22
期末基金份额净值	1.1701	1.1677
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	17.01%	16.77%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

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

中信建投上证科创板综合指数增强 A 净值表现

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	-4.38%	1.39%	-4.39%	1.54%	0.01%	-0.15%
过去六个月	16.79%	1.36%	31.36%	1.60%	-14.57%	-0.24%
自基金合同生效起至今	17.01%	1.33%	31.36%	1.60%	-14.35%	-0.27%

中信建投上证科创板综合指数增强 C 净值表现

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	-4.47%	1.39%	-4.39%	1.54%	-0.08%	-0.15%
过去六个月	16.56%	1.36%	31.36%	1.60%	-14.80%	-0.24%
自基金合同生效起至今	16.77%	1.33%	31.36%	1.60%	-14.59%	-0.27%

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

中信建投上证科创板综合指数增强A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06月24日-2025年12月31日)



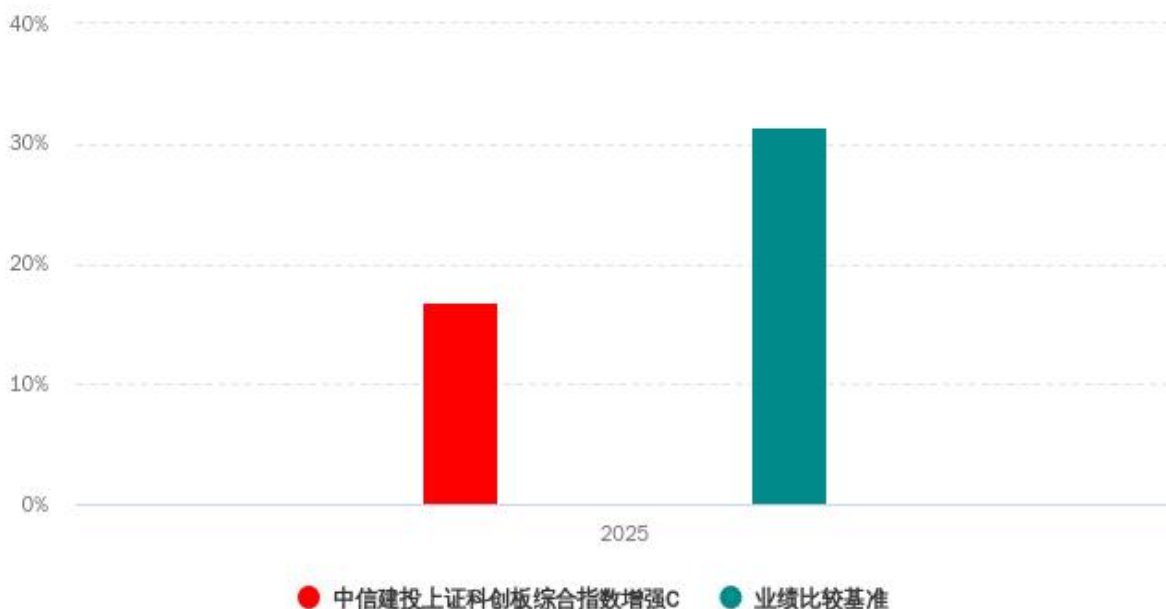
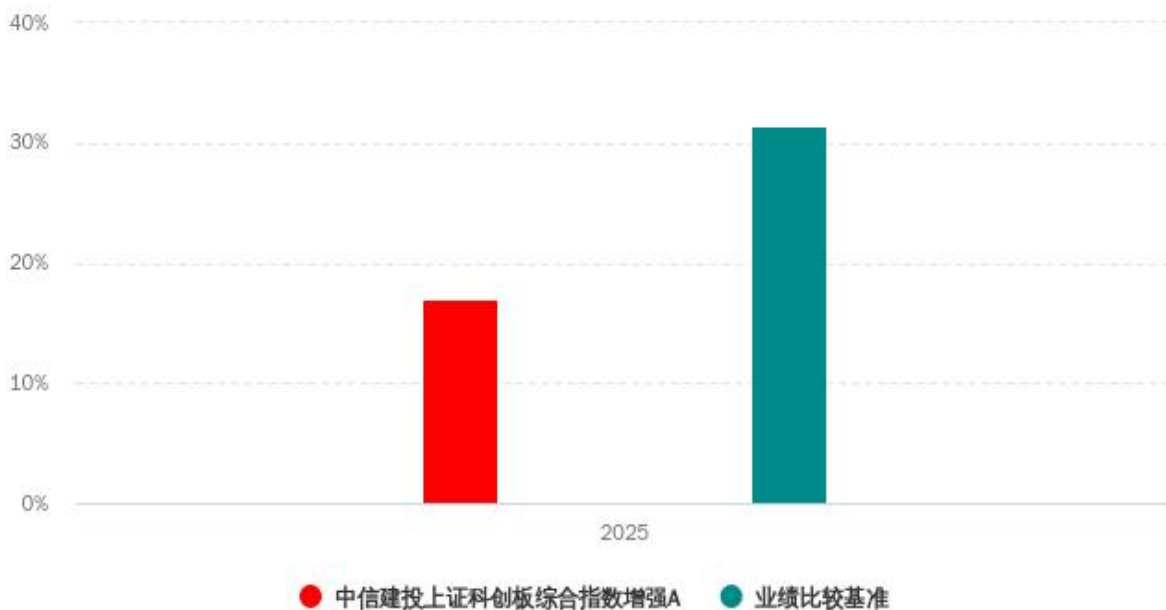
中信建投上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2025年06月24日-2025年12月31日)



注：1、本基金于 2025 年 6 月 24 日合同生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月为建仓期，建仓期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的相关约定。

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



注：基金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

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 68 个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

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		
杨志武	本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人、兼任指数与量化投资部行政负责人	2025-06-24	-	13 年	中国籍，伯明翰大学货币银行与金融学硕士。曾任职于北京首创期货有限责任公司期权及场外衍生品部从事衍生品投资与研究，中国国际期货股份有限公司金融业务部从事衍生品投资与研究，中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部从事证券投资研究、权益投资部担任投资经理。2022 年 3 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部行政负责人，兼任指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综

					合指数增强型证券投资基金基金经理。
艾翀	本基金的基金经理	2025-06-24	-	8 年	中国籍，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师，国金基金管理有限公司指数投资部、量化投资三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金销售有限公司基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿保险有限公司投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，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》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，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，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

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《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年中国经济 GDP 总量约 140 万亿元，增速 5%，全年发展更聚焦高质量导向，不再单纯追求增速规模。由于高基数和贸易保护主义等因素影响，全年进出口增速下降到 3.8%（前三季度累计进出口增速 4%）。其中第三产业增长 5.4%，贡献占比近 60%；高技术制造业增长 9.4%，新质生产力也发展迅速。全年进出口额实现稳定增长，增速 3.8%，其中出口增速 6.1%，进口增速 0.5%。分季度来看，出口稳中有进。其中显著的因素有：民营企业出口占比进一步提升到 57%；出口到“一带一路”国家的增速 6.3%，占比也达 52%；“新三样”出口增速 27%。2025 年全年 PMI 均值为 49.6，比 2024 年有所改善。分季度来看，一季度受政策推动逐月改善，整体较好。二三季度处于收缩区间，结构也有分化，生产端保持韧性，内外需求阶段性不足，服务业较强，制造业偏弱。四季度逐月走强，12 月超季节性地回升到荣枯线以上。总体来看，特征有生产强于需求、服务强于制造、大企业强于小企业。从全球来看，亚洲 PMI 最强，欧美最弱，中国在此之间。2025 年地产销售面积下降 8.7% 至 8.8 亿平方米，降幅较 2024 年收窄 4.2%；销售均价下降约 4%，其中二手房销售 7.37 亿平方米，成为销售主力。竣工面积 6 亿平方米，其中住宅竣工 4.28 亿平方米，较 2024 年下降 20%，明显收窄。地产开发投资 8.28 万亿元，降幅 17.2%，较 2024 年扩大 6.6%。其中办公楼降速 22.8%。地产政策进一步放松。2025 年消费稳中向好，社零全年达 50 万亿元，增长 3.7%，较 2024 年增速略有提升。最终消费支出占 GDP 增长贡献率 52%，较 2024 年提升 5%。消费结构持续优化，服务零售额增速 5.5%，快于商品零售额 1.7%的增速。分季度来看，由于年初消费政策发力和基数影响，呈现前高后低的走势。全年网上零售额增长较快；体育娱乐用品、金银珠宝等新消费相关商品增长较快。全年 CPI 总体平稳，但结构分化。食品和能源价格持续走低，而核心 CPI 逐步回升，服务和非食品涨价。PPI 全年同比下降 2.6%，但反内卷政策在三季度成效显现，10 月起降幅连续收窄，12 月下降 1.9%，呈底部回升走势。2025 年全国基建投资下降 2.2%，为 2014 年以来首次负增长。固定资产投资整体下降 3.8%，反映出地方财政紧平衡、优质项目储备不足及城投债净融资受限等多重压力。但“两重”“两新”政策引领的设备置换和高技术产业投资增速较快，是基建亮点。另外，2025 年底集中

批复了 4000 亿元重大项目，为“十五五”开局蓄力。

2025 年美国整体呈现“前低后高、再回落”的非对称增长态势，全年实际 GDP 增长 2.2%，虽低于 2024 年的 2.8%，但展现出较强韧性，尤其在第三季度实现强劲反弹，随后受政府停摆等因素拖累，四季度增速显著放缓。经济结构上，增长动力集中于消费与 AI 相关投资，但分配不均、政府支出波动和劳动力市场分化构成潜在风险。

A 股全年走出了结构性的“科技牛”行情。一季度在政策支持下走出了开门红，其中科技和小微盘表现较强；二季度尽管受到了特朗普税收政策的冲击，但 A 股经历波动后继续上行，风格回归均衡；三季度科技主线强化，市场全面爆发；四季度风格再平衡，风格偏向红利和防御。十年国债活跃券利率从年初 1.6% 低位震荡上行，3 月冲高至 1.9% 后回落，7 月前在 1.6%-1.7% 区间震荡，8 月起逐步回升，年末稳定在 1.85%。

报告期内依然坚持价值投资的理念，在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，利用量化方法对各种风格与行业进行了均衡的配置，充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争在行业与风格均衡配置的基础上，保持指数跟踪效果稳定，提升获取超额收益的能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投上证科创板综合指数增强 A 基金份额净值为 1.1701 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 17.01%，同期业绩比较基准收益率为 31.36%；截至报告期末中信建投上证科创板综合指数增强 C 基金份额净值为 1.1677 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 16.77%，同期业绩比较基准收益率为 31.36%。

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，作为“十五五”的起始年，政策支持应该会比较到位，经济基本面也可能是边际走强的。市场预期一、二季度 PPI 将延续上行态势；流动性层面，货币政策保持适度宽松，整体环境不会收紧。美联储在 6 月份或迎来新主席，其政策大概率更倾向于鸽派。全球流动性可能会出现阶段性波动，但从中期来看，政策将持续偏向鸽派。尽管 2026 年 3 月美以对伊朗发动军事行动，但考虑到特朗普政府的中期选举需求，全年来看，国际形势与贸易摩擦有望较 2025 年呈现阶段性缓和。新兴产业在过去几年里不仅有政策支持，而且科技水平和盈利水平都有长足进步，门类也在持续增加。人民币兑美元汇率也有可能继续偏强，权益可能以震荡上行为主，而有政策支持和有业绩支撑的新兴产业，以及受益于反内卷的偏上游行业、新型消费和服务消费等，在一季度都会有结构性机会和阶段性表现。

中美科技领域的竞争态势在 2026 年仍将延续，全球 AI 投资逻辑可能已经有了新的变化，国内投资受全球投资的影响会更加广泛和深入。而中国的高端制造业和科技产业将呈现多点开花的格局。监管部门在金融市场上展现出更加成熟稳健的治理能力，多项制度性政策协同发力，为 A 股市场稳中有进、长期健康发展奠定坚实基础。仍需注意，本轮行情中部分板块累计涨幅较大，叠加部分资金获利了结，市场波动可能加大。科技成长仍是主旋律，内需复苏尚待验证；在长线资金支撑下，红利与价值板块有望较 2025 年表现更佳。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，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

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

本基金自 2025 年 11 月 14 日起出现超过连续二十个工作日基金资产净值低于 5000 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面，能够遵守有关法律法规，未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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	安永华明（2026）审字第 70069507_A59 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	中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年 6 月 24 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，后附的中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投上</p>

	<p>证科创板综合指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及</p>

	<p>相关披露的合理性。</p> <p>(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2026-03-30

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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	2,945,181.61
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	41,777,520.44
其中：股票投资		41,777,520.44
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		-

应收股利		-
应收申购款		999.86
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		44,723,701.91
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		584,325.29
应付管理人报酬		32,184.69
应付托管费		4,023.07
应付销售服务费		13,633.04
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	75,000.00
负债合计		709,166.09
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	37,682,652.73
未分配利润	7.4.7.8	6,331,883.09
净资产合计		44,014,535.82
负债和净资产总计		44,723,701.91

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 37,682,652.73 份，其中中信建投上证科创板综合指数增强 A 类基金份额净值 1.1701 元，基金份额 5,775,062.42 份；中信建投上证科创板综合指数增强 C 类基金份额净值 1.1677 元，基金份额 31,907,590.31 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 06 月 24 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 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		14,972,202.62
1. 利息收入		268,584.59

其中：存款利息收入	7.4.7.9	10,680.51
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		257,904.08
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,123,337.60
其中：股票投资收益	7.4.7.10	13,991,834.87
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.12	131,502.73
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	578,697.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	1,582.44
减：二、营业总支出		672,827.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	388,916.99
2. 托管费	7.4.10.2.2	48,614.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	159,495.54
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	7.4.7.15	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.16	75,800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,299,375.44
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,299,375.44
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		14,299,375.44

7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 06 月 24 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 06 月 24 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	224,941,541.18	-	224,941,541.18

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-187,258,888.45	6,331,883.09	-180,927,005.36
(一)、综合收益总额	-	14,299,375.44	14,299,375.44
(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)	-187,258,888.45	-7,967,492.35	-195,226,380.80
其中：1. 基金申购款	35,955,536.36	4,668,671.58	40,624,207.94
2. 基金赎回款	-223,214,424.81	-12,636,163.93	-235,850,588.74
(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	37,682,652.73	6,331,883.09	44,014,535.82

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：

黄凌	张欣宇	谭保民
-----	-----	-----
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

中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2025)1048号《关于准予中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的运作方式为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币224,899,193.50元,业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2500460号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年6月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为224,941,541.18份基金份额,其中认购资金利息折合42,347.68份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不收取销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为估值日各类别基金资产净值除以估值日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业

板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、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、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及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:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的 80%(投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%),投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金以后,本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:上证科创板综合指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 06 月 24 日(基金合同生效日)起至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值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

本基金会计年度采用公历年度,即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 06 月 24 日(基金合同生效日)起至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获

得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持

有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

（4）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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〔2016〕127 号《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》及其他境内外相关税务法规的

规定和实务操作执行。

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	914,670.52
等于：本金	914,514.79
加：应计利息	155.73
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	2,030,511.09
等于：本金	2,030,482.99
加：应计利息	28.10
减：坏账准备	-
合计	2,945,181.61

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	41,198,822.45	-	41,777,520.44	578,697.99
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	41,198,822.45	-	41,777,520.44	578,697.99

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

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

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	75,000.00
合计	75,000.00

7.4.7.7 实收基金

中信建投上证科创板综合指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 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	35,104,609.82	35,104,609.82
本期申购	2,880,234.20	2,880,234.20
本期赎回（以“-”号填列）	-32,209,781.60	-32,209,781.60
本期末	5,775,062.42	5,775,062.42

中信建投上证科创板综合指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 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	189,836,931.36	189,836,931.36
本期申购	33,075,302.16	33,075,302.16
本期赎回（以“-”号填列）	-191,004,643.21	-191,004,643.21
本期末	31,907,590.31	31,907,590.31

注：1、申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。
 2、本基金自 2025 年 6 月 9 日至 2025 年 6 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 224,899,193.50 元，折合为 224,899,193.50 份基金份额（其中 A 类基金份额 35,094,635.60 份，C 类基金份额 189,804,557.90 份）。根据《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 42,347.68 元，在本基金成立后，折合为 42,347.68 份基金份额（其中 A 类基金份额 9,974.22 份，C 类基金份额 32,373.46 份），划入基金份额持有人账户。
 3、根据《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》、《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书》、《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于 2025 年 6 月 24 日(基金合同生效日)至 2025 年 7 月 27 日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购、赎回、定期定额投资业务自 2025 年 7 月 28 日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

中信建投上证科创板综合指数增强 A

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	3,085,109.18	134,061.38	3,219,170.56
本期基金份额交易产生的变动数	-2,002,797.49	-234,082.89	-2,236,880.38
其中：基金申购款	330,109.06	-36,469.84	293,639.22
基金赎回款	-2,332,906.55	-197,613.05	-2,530,519.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,082,311.69	-100,021.51	982,290.18

中信建投上证科创板综合指数增强 C

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	10,635,568.27	444,636.61	11,080,204.88
本期基金份额交易产生的变动数	-4,734,102.49	-996,509.48	-5,730,611.97
其中：基金申购款	3,741,307.76	633,724.60	4,375,032.36
基金赎回款	-8,475,410.25	-1,630,234.08	-10,105,644.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,901,465.78	-551,872.87	5,349,592.91

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	8,588.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,091.86
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	10,680.51

7.4.7.10 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 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	515,015,942.14
减：卖出股票成本总额	500,492,137.03
减：交易费用	531,970.24
买卖股票差价收入	13,991,834.87

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

无。

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 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	131,502.73
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	131,502.73

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	578,697.99
——股票投资	578,697.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	578,697.99

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,582.44
合计	1,582.44

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

7.4.7.15 信用减值损失

无。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	15,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
证券账户开户费	800.00
合计	75,800.00

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

截至财务报表批准日，本基金无重大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
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
华夏银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	148,596,693.07	14.07%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,870,300,000.00	87.84%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 06 月 24 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	28,987.90	14.02%	0.00	0.00%

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 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	388,916.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	188,369.85
应支付基金管理人的净管理费	200,547.14

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 06 月 24 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	48,614.65

注：支付基金托管人华夏银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 06 月 24 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销售服务费		
	中信建投上证科创板综合指数增强 A	中信建投上证科创板综合指数增强 C	合计
中信建投证券股份有限公司	-	20,628.03	20,628.03
华夏银行股份有限公司	-	104,695.06	104,695.06
合计	-	125,323.09	125,323.09

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 06 月 24 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
华夏银行股份有限公司-托管户	914,670.52	8,588.65
中信建投证券股份有限公司-证券户	20,949.23	782.02

注：本基金托管账户的存款由基金托管人华夏银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

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

无。

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	1,500	412,751.47	409,080.00	-

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖

公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

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和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。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。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，将风险控制可在承受的范围之内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，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主要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，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

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一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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（如有）。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,945,181.61	-	-	-	2,945,181.61
交易性金融资产	-	-	-	41,777,520.44	41,777,520.44
应收申购款	-	-	-	999.86	999.86
资产总计	2,945,181.61	-	-	41,778,520.30	44,723,701.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	584,325.29	584,325.29
应付管理人报酬	-	-	-	32,184.69	32,184.69
应付托管费	-	-	-	4,023.07	4,023.07
应付销售服务费	-	-	-	13,633.04	13,633.04
其他负债	-	-	-	75,000.00	75,000.00
负债总计	-	-	-	709,166.09	709,166.09
利率敏感度缺口	2,945,181.61	-	-	41,069,354.21	44,014,535.82

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

于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，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。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	41,777,520.44	94.92
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	41,777,520.44	94.92

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%	1,752,170.93
	业绩比较基准下降 5%	-1,752,170.93

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	41,368,440.44

第二层次	409,080.00
第三层次	-
合计	41,777,520.44

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、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于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。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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	41,777,520.44	93.41
	其中：股票	41,777,520.44	93.41
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	2,945,181.61	6.59
8	其他各项资产	999.86	0.00
9	合计	44,723,701.91	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	33,379,276.98	75.84
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	4,882,314.86	11.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,965,231.60	4.46
N	水利、环境和公共设施管理业	97,831.00	0.22
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	40,324,654.44	91.62

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	143,958.00	0.33
C	制造业	1,119,579.00	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,970.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	43,578.00	0.10

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,852.00	0.06
J	金融业	112,391.00	0.26
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,538.00	0.01
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	1,452,866.00	3.30

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

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	688041	海光信息	8,800	1,974,808.00	4.49
2	688256	寒武纪	1,000	1,355,550.00	3.08
3	688981	中芯国际	7,300	896,659.00	2.04
4	688008	澜起科技	6,900	812,820.00	1.85
5	688009	中国通号	139,800	764,706.00	1.74
6	688772	珠海冠宇	34,800	749,244.00	1.70
7	688002	睿创微纳	6,600	665,280.00	1.51
8	688728	格科微	43,000	642,420.00	1.46
9	688208	道通科技	17,400	640,320.00	1.45
10	688187	时代电气	12,300	630,867.00	1.43
11	688599	天合光能	36,070	596,958.50	1.36
12	688123	聚辰股份	4,680	587,714.40	1.34
13	688127	蓝特光学	15,100	581,199.00	1.32
14	688200	华峰测控	2,900	551,580.00	1.25
15	688248	南网科技	11,900	532,406.00	1.21
16	688321	微芯生物	18,000	525,960.00	1.19
17	688425	铁建重工	92,500	468,975.00	1.07
18	688072	拓荆科技	1,400	462,000.00	1.05
19	688007	光峰科技	24,400	453,108.00	1.03

20	688510	航亚科技	16,200	435,780.00	0.99
21	688049	炬芯科技	8,260	434,476.00	0.99
22	688508	芯朋微	7,100	432,390.00	0.98
23	688257	新锐股份	12,300	421,644.00	0.96
24	688012	中微公司	1,500	409,080.00	0.93
25	688295	中复神鹰	12,400	406,844.00	0.92
26	688475	萤石网络	13,400	403,474.00	0.92
27	688131	皓元医药	5,400	389,232.00	0.88
28	688303	大全能源	14,200	380,844.00	0.87
29	688798	艾为电子	5,000	380,550.00	0.86
30	688100	威胜信息	9,600	377,280.00	0.86
31	688180	君实生物	11,000	375,760.00	0.85
32	688819	天能股份	11,300	375,386.00	0.85
33	688087	英科再生	12,000	369,840.00	0.84
34	688352	硕中科技	28,800	363,168.00	0.83
35	688584	上海合晶	16,400	359,816.00	0.82
36	688612	威迈斯	10,900	359,373.00	0.82
37	688549	中巨芯	39,300	358,416.00	0.81
38	688677	海泰新光	8,100	349,596.00	0.79
39	688586	江航装备	26,590	346,733.60	0.79
40	688533	上声电子	11,800	345,032.00	0.78
41	688521	芯原股份	2,500	342,425.00	0.78
42	688591	泰凌微	8,000	340,480.00	0.77
43	688252	天德钰	16,070	340,201.90	0.77
44	688377	迪威尔	9,200	337,640.00	0.77
45	688575	亚辉龙	23,700	336,540.00	0.76
46	688557	兰剑智能	9,180	334,427.40	0.76
47	688267	中触媒	11,700	329,589.00	0.75
48	688334	西高院	16,970	328,539.20	0.75
49	688097	博众精工	8,700	328,425.00	0.75
50	688029	南微医学	4,000	326,240.00	0.74
51	688381	帝奥微	14,300	326,183.00	0.74
52	688235	百济神州	1,200	322,320.00	0.73
53	688179	阿拉丁	25,700	320,993.00	0.73
54	688357	建龙微纳	9,700	320,585.00	0.73
55	688550	瑞联新材	7,000	317,170.00	0.72
56	688600	皖仪科技	12,600	315,630.00	0.72
57	688328	深科达	10,200	297,636.00	0.68
58	688107	安路科技	10,500	285,390.00	0.65
59	688111	金山办公	900	276,363.00	0.63
60	688185	康希诺	4,100	257,685.00	0.59
61	688692	达梦数据	968	252,909.36	0.57
62	688138	清溢光电	8,700	244,992.00	0.56

63	688114	华大智造	4,000	243,040.00	0.55
64	688598	金博股份	8,200	240,752.00	0.55
65	688223	晶科能源	39,400	222,216.00	0.50
66	688595	芯海科技	6,600	216,480.00	0.49
67	688079	美迪凯	19,000	215,080.00	0.49
68	688206	概伦电子	6,100	212,463.00	0.48
69	688327	云从科技	14,700	211,239.00	0.48
70	688222	成都先导	9,000	211,050.00	0.48
71	688472	阿特斯	14,000	208,740.00	0.47
72	688443	智翔金泰	7,400	201,576.00	0.46
73	688369	致远互联	7,800	198,354.00	0.45
74	688231	隆达股份	7,600	197,600.00	0.45
75	688396	华润微	3,700	195,582.00	0.44
76	688512	慧智微	17,300	193,068.00	0.44
77	688410	山外山	12,800	191,616.00	0.44
78	688045	必易微	4,900	189,581.00	0.43
79	688561	奇安信	5,300	188,574.00	0.43
80	688517	金冠电气	12,000	187,080.00	0.43
81	688077	大地熊	5,600	171,080.00	0.39
82	688093	世华科技	4,600	169,510.00	0.39
83	688106	金宏气体	8,300	162,597.00	0.37
84	688653	康希通信	13,000	157,950.00	0.36
85	688548	广钢气体	10,700	155,578.00	0.35
86	688135	利扬芯片	5,400	149,904.00	0.34
87	688522	纳睿雷达	3,700	147,741.00	0.34
88	688663	新风光	3,700	143,449.00	0.33
89	688150	莱特光电	5,200	140,556.00	0.32
90	688225	亚信安全	7,200	139,680.00	0.32
91	688371	菲沃泰	7,200	132,984.00	0.30
92	688101	三达膜	8,000	131,520.00	0.30
93	688620	安凯微	10,900	131,236.00	0.30
94	688506	百利天恒	400	129,240.00	0.29
95	688618	三旺通信	4,800	127,968.00	0.29
96	688310	迈得医疗	8,300	127,239.00	0.29
97	688687	凯因科技	5,100	127,092.00	0.29
98	688271	联影医疗	1,000	125,500.00	0.29
99	688065	凯赛生物	2,500	124,500.00	0.28
100	688182	灿勤科技	4,200	123,984.00	0.28
101	688118	普元信息	4,800	122,496.00	0.28
102	688393	安必平	5,100	120,819.00	0.27
103	688177	百奥泰	5,200	120,328.00	0.27
104	688388	嘉元科技	2,900	118,842.00	0.27
105	688153	唯捷创芯	3,100	116,684.00	0.27

106	688700	东威科技	3,300	116,424.00	0.26
107	688686	奥普特	930	115,440.90	0.26
108	688480	赛恩斯	1,900	97,831.00	0.22
109	688630	芯碁微装	700	94,171.00	0.21
110	688073	毕得医药	1,488	90,842.40	0.21
111	688259	创耀科技	2,100	87,780.00	0.20
112	688025	杰普特	608	86,074.56	0.20
113	688003	天准科技	1,400	82,460.00	0.19
114	688219	会通股份	6,600	81,972.00	0.19
115	688305	科德数控	1,300	80,340.00	0.18
116	688209	英集芯	3,800	75,772.00	0.17
117	688016	心脉医疗	800	73,328.00	0.17
118	688578	艾力斯	700	72,905.00	0.17
119	688023	安恒信息	1,400	71,974.00	0.16
120	688697	纽威数控	4,600	70,748.00	0.16
121	688518	联赢激光	2,900	70,441.00	0.16
122	688188	柏楚电子	500	67,945.00	0.15
123	688625	呈和科技	1,600	65,920.00	0.15
124	688385	复旦微电	890	65,593.00	0.15
125	688270	臻镭科技	500	61,035.00	0.14
126	688520	神州细胞	1,400	60,634.00	0.14
127	688378	奥来德	2,200	60,060.00	0.14
128	688690	纳微科技	2,300	59,363.00	0.13
129	688777	中控技术	1,200	59,208.00	0.13
130	688639	华恒生物	1,800	58,644.00	0.13
131	688319	欧林生物	2,300	58,328.00	0.13
132	688202	美迪西	1,000	56,400.00	0.13
133	688082	盛美上海	300	52,815.00	0.12
134	688553	汇宇制药	2,800	49,812.00	0.11
135	688088	虹软科技	1,000	49,500.00	0.11
136	688778	厦钨新能	600	46,422.00	0.11
137	688128	中国电研	1,593	46,324.44	0.11
138	688195	腾景科技	270	45,778.50	0.10
139	688262	国芯科技	1,500	45,525.00	0.10
140	688608	恒玄科技	200	45,388.00	0.10
141	688037	芯源微	300	44,553.00	0.10
142	688488	艾迪药业	2,700	44,091.00	0.10
143	688513	苑东生物	700	43,085.00	0.10
144	688588	凌志软件	2,900	41,499.00	0.09
145	688136	科兴制药	1,300	41,171.00	0.09
146	688789	宏华数科	500	40,785.00	0.09
147	688383	新益昌	520	40,700.40	0.09
148	688519	南亚新材	500	40,430.00	0.09

149	688580	伟思医疗	800	38,720.00	0.09
150	688766	普冉股份	300	38,163.00	0.09
151	688116	天奈科技	800	37,720.00	0.09
152	688176	亚虹医药	3,000	34,530.00	0.08
153	688299	长阳科技	2,000	33,840.00	0.08
154	688068	热景生物	200	32,400.00	0.07
155	688339	亿华通	1,200	32,352.00	0.07
156	688656	浩欧博	200	30,760.00	0.07
157	688169	石头科技	200	30,412.00	0.07
158	688103	国力电子	500	30,295.00	0.07
159	688626	翔宇医疗	500	30,250.00	0.07
160	688577	浙海德曼	300	29,058.00	0.07
161	688499	利元亨	500	28,860.00	0.07
162	688559	海目星	600	28,836.00	0.07
163	688085	三友医疗	1,600	28,832.00	0.07
164	688095	福昕软件	300	26,781.00	0.06
165	688036	传音控股	400	26,464.00	0.06
166	688363	华熙生物	600	26,208.00	0.06
167	688226	威腾电气	700	25,970.00	0.06
168	688277	天智航	1,700	25,823.00	0.06
169	688308	欧科亿	800	25,312.00	0.06
170	688080	映翰通	500	25,250.00	0.06
171	688013	天臣医疗	521	25,049.68	0.06
172	688707	振华新材	1,800	24,930.00	0.06
173	688621	阳光诺和	400	24,860.00	0.06
174	688668	鼎通科技	200	24,800.00	0.06
175	688220	翱捷科技	300	24,783.00	0.06
176	688590	新致软件	1,300	24,258.00	0.06
177	688678	福立旺	1,000	24,180.00	0.05
178	688269	凯立新材	600	24,006.00	0.05
179	688286	敏芯股份	300	23,685.00	0.05
180	688091	上海谊众	500	23,500.00	0.05
181	688201	信安世纪	1,600	23,408.00	0.05
182	688312	燕麦科技	700	23,226.00	0.05
183	688779	五矿新能	3,100	23,219.00	0.05
184	688192	迪哲医药	400	23,040.00	0.05
185	688158	优刻得	800	22,472.00	0.05
186	688039	当虹科技	500	22,375.00	0.05
187	688685	迈信林	400	22,192.00	0.05
188	688255	凯尔达	600	21,978.00	0.05
189	688280	精进电动	2,500	21,750.00	0.05
190	688636	智明达	500	21,420.00	0.05
191	688350	富淼科技	800	20,584.00	0.05

192	688655	迅捷兴	1,200	20,556.00	0.05
193	688083	中望软件	300	20,433.00	0.05
194	688186	广大特材	900	20,412.00	0.05
195	688665	四方光电	400	19,508.00	0.04
196	688017	绿的谐波	100	19,210.00	0.04
197	688183	生益电子	200	19,138.00	0.04
198	688799	华纳药厂	400	19,080.00	0.04
199	688767	博拓生物	500	18,890.00	0.04
200	688556	高测股份	1,500	17,130.00	0.04
201	688191	智洋创新	500	16,090.00	0.04
202	688536	思瑞浦	100	15,988.00	0.04
203	688155	先惠技术	250	15,112.50	0.03
204	688230	芯导科技	200	14,496.00	0.03
205	688278	特宝生物	160	13,388.80	0.03
206	688543	国科军工	200	12,414.00	0.03
207	688212	澳华内镜	280	12,238.80	0.03
208	688372	伟测科技	100	10,909.00	0.02
209	688301	奕瑞科技	100	10,111.00	0.02
210	688300	联瑞新材	160	9,934.40	0.02
211	688099	晶晨股份	100	8,723.00	0.02
212	688607	康众医疗	200	8,560.00	0.02
213	688386	泛亚微透	90	7,884.00	0.02
214	688258	卓易信息	100	7,657.00	0.02
215	688122	西部超导	100	7,458.00	0.02
216	688667	菱电电控	100	7,042.00	0.02
217	688015	交控科技	300	6,834.00	0.02
218	688249	晶合集成	200	6,638.00	0.02
219	688403	汇成股份	400	6,552.00	0.01
220	688582	芯动联科	90	5,949.90	0.01
221	688581	安杰思	100	5,863.00	0.01
222	688469	芯联集成	800	5,352.00	0.01
223	688568	中科星图	90	5,310.00	0.01
224	688432	有研硅	300	3,723.00	0.01
225	688551	科威尔	100	3,683.00	0.01
226	688661	和林微纳	70	3,623.20	0.01
227	688175	高凌信息	100	3,221.00	0.01
228	688449	联芸科技	70	3,162.60	0.01
229	688349	三一重能	100	2,528.00	0.01
230	688567	孚能科技	100	1,565.00	0.00

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	000725	京东方 A	23,600	99,356.00	0.23
2	002993	奥海科技	2,000	87,420.00	0.20
3	000100	TCL 科技	15,400	69,916.00	0.16
4	600369	西南证券	12,300	55,104.00	0.13
5	002376	新北洋	6,400	49,408.00	0.11
6	000576	甘化科工	3,900	41,067.00	0.09
7	601163	三角轮胎	2,500	35,725.00	0.08
8	603733	仙鹤股份	1,400	33,838.00	0.08
9	601857	中国石油	3,200	33,312.00	0.08
10	601138	工业富联	500	31,025.00	0.07
11	300951	博硕科技	900	30,915.00	0.07
12	002182	宝武镁业	2,000	30,600.00	0.07
13	002978	安宁股份	900	29,745.00	0.07
14	600028	中国石化	4,600	28,428.00	0.06
15	002835	同为股份	1,700	27,846.00	0.06
16	002408	齐翔腾达	5,600	27,328.00	0.06
17	601633	长城汽车	1,200	27,156.00	0.06
18	601898	中煤能源	2,000	24,880.00	0.06
19	600845	宝信软件	1,200	24,852.00	0.06
20	000338	潍柴动力	1,400	24,080.00	0.05
21	601003	柳钢股份	4,700	23,641.00	0.05
22	300032	金龙机电	3,800	20,406.00	0.05
23	002938	鹏鼎控股	400	20,232.00	0.05
24	600029	南方航空	2,400	19,224.00	0.04
25	603019	中科曙光	200	17,128.00	0.04
26	000408	藏格矿业	200	16,880.00	0.04
27	300857	协创数据	100	16,868.00	0.04
28	603993	洛阳钼业	800	16,000.00	0.04
29	000895	双汇发展	600	15,882.00	0.04
30	600989	宝丰能源	800	15,704.00	0.04
31	000333	美的集团	200	15,630.00	0.04
32	601600	中国铝业	1,200	14,664.00	0.03
33	002463	沪电股份	200	14,614.00	0.03
34	300787	海能实业	1,200	14,100.00	0.03
35	603301	振德医疗	200	14,100.00	0.03
36	002493	荣盛石化	1,200	14,052.00	0.03
37	300154	瑞凌股份	1,400	13,790.00	0.03
38	600115	中国东航	2,200	13,200.00	0.03
39	601288	农业银行	1,700	13,056.00	0.03
40	601601	中国太保	300	12,573.00	0.03
41	300790	宇瞳光学	400	11,964.00	0.03

42	003025	思进智能	800	11,496.00	0.03
43	300162	雷曼光电	1,400	11,382.00	0.03
44	603713	密尔克卫	200	11,154.00	0.03
45	600362	江西铜业	200	10,984.00	0.02
46	002837	英维克	100	10,689.00	0.02
47	601211	国泰海通	500	10,275.00	0.02
48	301093	华兰股份	200	10,220.00	0.02
49	300604	长川科技	100	10,131.00	0.02
50	605116	奥锐特	400	10,020.00	0.02
51	000807	云铝股份	300	9,852.00	0.02
52	603920	世运电路	200	9,682.00	0.02
53	600643	爱建集团	1,600	8,848.00	0.02
54	600958	东方证券	800	8,720.00	0.02
55	002384	东山精密	100	8,465.00	0.02
56	000630	铜陵有色	1,400	8,414.00	0.02
57	601339	百隆东方	1,400	8,106.00	0.02
58	002532	天山铝业	500	8,090.00	0.02
59	603328	依顿电子	700	7,672.00	0.02
60	002080	中材科技	200	7,268.00	0.02
61	002353	杰瑞股份	100	7,083.00	0.02
62	002801	微光股份	200	7,082.00	0.02
63	603799	华友钴业	100	6,826.00	0.02
64	600346	恒力石化	300	6,759.00	0.02
65	601225	陕西煤业	300	6,396.00	0.01
66	002436	兴森科技	300	6,351.00	0.01
67	600600	青岛啤酒	100	6,120.00	0.01
68	600039	四川路桥	600	5,970.00	0.01
69	603538	美诺华	300	5,772.00	0.01
70	600590	泰豪科技	600	5,646.00	0.01
71	000792	盐湖股份	200	5,632.00	0.01
72	600963	岳阳林纸	1,200	5,604.00	0.01
73	002265	建设工业	200	5,364.00	0.01
74	601233	桐昆股份	300	5,163.00	0.01
75	600967	内蒙一机	300	5,040.00	0.01
76	600549	厦门钨业	100	4,106.00	0.01
77	601658	邮储银行	700	3,815.00	0.01
78	600096	云天化	100	3,341.00	0.01
79	301458	钧崴电子	100	3,209.00	0.01
80	002635	安洁科技	200	2,772.00	0.01
81	601168	西部矿业	100	2,764.00	0.01
82	002859	洁美科技	100	2,760.00	0.01
83	603568	伟明环保	100	2,538.00	0.01
84	000975	山金国际	100	2,433.00	0.01

85	000301	东方盛虹	200	2,178.00	0.00
86	603225	新风鸣	100	1,946.00	0.00
87	002552	宝鼎科技	100	1,651.00	0.00
88	300303	聚飞光电	200	1,368.00	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	688981	中芯国际	9,101,799.60	20.68
2	688012	中微公司	8,386,183.64	19.05
3	688041	海光信息	7,314,950.80	16.62
4	688256	寒武纪	6,846,907.32	15.56
5	688008	澜起科技	6,747,587.64	15.33
6	688728	格科微	5,216,221.02	11.85
7	688599	天合光能	4,434,054.78	10.07
8	688002	睿创微纳	4,311,106.39	9.79
9	688396	华润微	4,210,616.34	9.57
10	688187	时代电气	4,001,518.91	9.09
11	688139	海尔生物	3,943,827.86	8.96
12	688009	中国通号	3,853,347.79	8.75
13	688138	清溢光电	3,665,102.15	8.33
14	688126	沪硅产业	3,477,117.94	7.90
15	688208	道通科技	3,453,513.18	7.85
16	688099	晶晨股份	3,453,270.67	7.85
17	688772	珠海冠宇	3,247,818.98	7.38
18	688127	蓝特光学	3,211,875.00	7.30
19	688111	金山办公	3,185,074.83	7.24
20	688561	奇安信	3,146,909.86	7.15
21	688036	传音控股	3,142,806.31	7.14
22	688007	光峰科技	3,063,437.85	6.96
23	688271	联影医疗	3,023,527.14	6.87
24	688082	盛美上海	2,993,199.06	6.80
25	688690	纳微科技	2,973,310.69	6.76
26	688315	诺禾致源	2,861,339.01	6.50
27	688777	中控技术	2,768,830.80	6.29
28	688223	晶科能源	2,658,320.29	6.04
29	688029	南微医学	2,624,010.06	5.96
30	688100	威胜信息	2,620,032.45	5.95
31	688819	天能股份	2,609,897.17	5.93
32	688586	江航装备	2,579,434.94	5.86
33	688567	孚能科技	2,562,122.54	5.82

34	688107	安路科技	2,561,448.98	5.82
35	688798	艾为电子	2,478,046.91	5.63
36	688575	亚辉龙	2,417,407.04	5.49
37	688128	中国电研	2,408,670.46	5.47
38	688123	聚辰股份	2,380,546.63	5.41
39	688475	萤石网络	2,378,620.77	5.40
40	688668	鼎通科技	2,340,747.97	5.32
41	688303	大全能源	2,289,678.50	5.20
42	688518	联赢激光	2,244,865.56	5.10
43	688508	芯朋微	2,206,498.85	5.01
44	688025	杰普特	2,151,966.56	4.89
45	688006	杭可科技	2,134,858.34	4.85
46	688510	航亚科技	2,117,084.05	4.81
47	688579	地纬智能	2,109,497.21	4.79
48	688289	圣湘生物	2,102,295.88	4.78
49	688133	泰坦科技	2,102,253.18	4.78
50	688026	洁特生物	2,081,265.59	4.73
51	688233	神工股份	2,013,237.16	4.57
52	688220	翱捷科技	2,004,657.55	4.55
53	688016	心脉医疗	1,984,333.88	4.51
54	688686	奥普特	1,969,352.42	4.47
55	688079	美迪凯	1,946,129.24	4.42
56	688065	凯赛生物	1,923,960.23	4.37
57	688183	生益电子	1,921,015.55	4.36
58	688566	吉贝尔	1,889,440.32	4.29
59	688049	炬芯科技	1,873,539.36	4.26
60	688236	春立医疗	1,867,919.03	4.24
61	688550	瑞联新材	1,847,208.77	4.20
62	688295	中复神鹰	1,827,869.29	4.15
63	688097	博众精工	1,802,248.20	4.09
64	688389	普门科技	1,796,574.90	4.08
65	688711	宏微科技	1,795,880.50	4.08
66	688484	南芯科技	1,787,853.66	4.06
67	688122	西部超导	1,768,646.27	4.02
68	688269	凯立新材	1,766,024.05	4.01
69	688658	悦康药业	1,765,600.98	4.01
70	688378	奥来德	1,747,749.77	3.97
71	688598	金博股份	1,744,718.26	3.96
72	688087	英科再生	1,739,420.56	3.95
73	688591	泰凌微	1,722,405.22	3.91
74	688557	兰剑智能	1,721,232.60	3.91
75	688689	银河微电	1,717,171.54	3.90
76	688249	晶合集成	1,709,211.62	3.88

77	688595	芯海科技	1,706,813.56	3.88
78	688114	华大智造	1,705,924.15	3.88
79	688177	百奥泰	1,692,288.40	3.84
80	688231	隆达股份	1,683,973.99	3.83
81	688588	凌志软件	1,682,774.33	3.82
82	688538	和辉光电	1,675,612.02	3.81
83	688697	纽威数控	1,662,896.84	3.78
84	688180	君实生物	1,658,344.07	3.77
85	688131	皓元医药	1,631,896.37	3.71
86	688578	艾力斯	1,623,026.38	3.69
87	688088	虹软科技	1,611,876.95	3.66
88	688779	五矿新能	1,592,486.99	3.62
89	688456	有研粉材	1,585,187.19	3.60
90	688363	华熙生物	1,553,955.63	3.53
91	688161	威高骨科	1,539,728.88	3.50
92	688377	迪威尔	1,519,026.00	3.45
93	688365	光云科技	1,509,205.33	3.43
94	688321	微芯生物	1,506,785.42	3.42
95	688298	东方生物	1,500,170.99	3.41
96	688357	建龙微纳	1,498,184.02	3.40
97	688677	海泰新光	1,492,359.94	3.39
98	688153	唯捷创芯	1,480,236.68	3.36
99	688381	帝奥微	1,465,006.44	3.33
100	688262	国芯科技	1,439,283.58	3.27
101	688327	云从科技	1,427,010.88	3.24
102	688687	凯因科技	1,423,540.22	3.23
103	688339	亿华通	1,422,386.56	3.23
104	688472	阿特斯	1,416,176.65	3.22
105	688328	深科达	1,391,397.44	3.16
106	688558	国盛智科	1,391,143.19	3.16
107	688676	金盘科技	1,381,728.46	3.14
108	688678	福立旺	1,379,447.28	3.13
109	688526	科前生物	1,353,645.13	3.08
110	688276	百克生物	1,341,000.92	3.05
111	688162	巨一科技	1,337,604.50	3.04
112	688200	华峰测控	1,337,284.36	3.04
113	688112	鼎阳科技	1,336,471.48	3.04
114	688403	汇成股份	1,335,472.21	3.03
115	688612	威迈斯	1,330,577.55	3.02
116	688209	英集芯	1,318,227.66	2.99
117	688219	会通股份	1,309,632.21	2.98
118	688371	菲沃泰	1,293,177.78	2.94
119	688089	嘉必优	1,290,705.57	2.93

120	688432	有研硅	1,273,259.62	2.89
121	688525	佰维存储	1,273,148.18	2.89
122	688739	成大生物	1,259,973.89	2.86
123	688106	金宏气体	1,256,316.89	2.85
124	688030	山石网科	1,255,897.29	2.85
125	688150	莱特光电	1,235,914.73	2.81
126	688033	天宜新材	1,231,089.80	2.80
127	688387	信科移动	1,220,737.18	2.77
128	688336	三生国健	1,220,148.55	2.77
129	688105	诺唯赞	1,209,780.37	2.75
130	688334	西高院	1,201,953.19	2.73
131	688179	阿拉丁	1,198,029.36	2.72
132	688261	东微半导	1,183,545.03	2.69
133	688630	芯碁微装	1,176,129.52	2.67
134	688235	百济神州	1,171,036.27	2.66
135	688185	康希诺	1,142,233.81	2.60
136	688270	臻镭科技	1,137,786.02	2.59
137	688352	顾中科技	1,134,669.54	2.58
138	688589	力合微	1,134,641.38	2.58
139	688248	南网科技	1,132,005.89	2.57
140	688286	敏芯股份	1,130,427.95	2.57
141	688512	慧智微	1,123,811.77	2.55
142	688169	石头科技	1,121,133.02	2.55
143	688380	中微半导	1,118,930.37	2.54
144	688181	八亿时空	1,079,996.36	2.45
145	688182	灿勤科技	1,077,358.93	2.45
146	688521	芯原股份	1,071,927.22	2.44
147	688080	映翰通	1,069,774.66	2.43
148	688259	创耀科技	1,061,811.37	2.41
149	688621	阳光诺和	1,056,382.71	2.40
150	688548	广钢气体	1,045,460.78	2.38
151	688786	悦安新材	1,038,469.42	2.36
152	688709	成都华微	1,033,381.66	2.35
153	688778	厦钨新能	1,032,131.03	2.34
154	688639	华恒生物	1,025,304.54	2.33
155	688192	迪哲医药	1,016,623.35	2.31
156	688509	正元地信	1,013,284.20	2.30
157	688313	仕佳光子	999,619.07	2.27
158	688410	山外山	999,021.21	2.27
159	688653	康希通信	994,933.85	2.26
160	688499	利元亨	992,852.25	2.26
161	688369	致远互联	992,302.30	2.25
162	688252	天德钰	989,856.65	2.25

163	688116	天奈科技	987,449.91	2.24
164	688063	派能科技	986,294.69	2.24
165	688072	拓荆科技	980,417.49	2.23
166	688101	三达膜	976,374.58	2.22
167	688319	欧林生物	975,068.28	2.22
168	688022	瀚川智能	973,230.97	2.21
169	688176	亚虹医药	965,953.71	2.19
170	688108	赛诺医疗	964,468.62	2.19
171	688533	上声电子	961,468.78	2.18
172	688268	华特气体	959,790.77	2.18
173	688665	四方光电	959,439.02	2.18
174	688023	安恒信息	956,234.11	2.17
175	688386	泛亚微透	953,424.56	2.17
176	688013	天臣医疗	951,293.89	2.16
177	688358	祥生医疗	948,004.82	2.15
178	688388	嘉元科技	945,511.29	2.15
179	688501	青达环保	944,172.17	2.15
180	688308	欧科亿	938,386.74	2.13
181	688362	甬矽电子	934,291.49	2.12
182	688568	中科星图	930,905.21	2.11
183	688519	南亚新材	926,014.30	2.10
184	688246	嘉和美康	923,758.95	2.10
185	688166	博瑞医药	912,974.17	2.07
186	688172	燕东微	912,159.11	2.07
187	600150	中国船舶	911,596.11	2.07
188	688085	三友医疗	905,965.56	2.06
189	688202	美迪西	905,701.10	2.06
190	688001	华兴源创	896,859.64	2.04
191	688195	腾景科技	888,169.37	2.02

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	8,696,369.95	19.76
2	688012	中微公司	8,121,446.09	18.45
3	688256	寒武纪	6,548,335.22	14.88
4	688041	海光信息	6,189,288.92	14.06
5	688008	澜起科技	6,182,668.42	14.05
6	688728	格科微	4,516,647.23	10.26
7	688396	华润微	3,973,376.47	9.03
8	688002	睿创微纳	3,962,142.60	9.00
9	688139	海尔生物	3,915,459.20	8.90

10	688599	天合光能	3,800,088.67	8.63
11	688126	沪硅产业	3,665,851.34	8.33
12	688099	晶晨股份	3,654,127.90	8.30
13	688138	清溢光电	3,450,731.54	7.84
14	688187	时代电气	3,388,243.85	7.70
15	688082	盛美上海	3,113,066.23	7.07
16	688009	中国通号	3,043,294.88	6.91
17	688036	传音控股	2,992,078.30	6.80
18	688561	奇安信	2,986,155.19	6.78
19	688111	金山办公	2,962,657.88	6.73
20	688690	纳微科技	2,925,842.32	6.65
21	688127	蓝特光学	2,899,447.75	6.59
22	688315	诺禾致源	2,869,666.47	6.52
23	688007	光峰科技	2,842,680.33	6.46
24	688208	道通科技	2,840,159.45	6.45
25	688777	中控技术	2,824,037.71	6.42
26	688772	珠海冠宇	2,819,358.43	6.41
27	688271	联影医疗	2,816,024.25	6.40
28	688567	孚能科技	2,585,375.91	5.87
29	688006	杭可科技	2,496,147.21	5.67
30	688025	杰普特	2,490,065.14	5.66
31	688668	鼎通科技	2,481,798.17	5.64
32	688128	中国电研	2,457,957.41	5.58
33	688223	晶科能源	2,416,470.74	5.49
34	688100	威胜信息	2,307,238.11	5.24
35	688029	南微医学	2,304,758.28	5.24
36	688107	安路科技	2,292,263.33	5.21
37	688819	天能股份	2,257,488.60	5.13
38	688586	江航装备	2,251,239.54	5.11
39	688518	联赢激光	2,228,359.33	5.06
40	688233	神工股份	2,203,990.89	5.01
41	688798	艾为电子	2,192,194.83	4.98
42	688026	洁特生物	2,163,727.14	4.92
43	688579	地纬智能	2,161,701.63	4.91
44	688220	翱捷科技	2,126,083.40	4.83
45	688183	生益电子	2,059,225.02	4.68
46	688289	圣湘生物	2,056,466.97	4.67
47	688711	宏微科技	2,032,591.20	4.62
48	688133	泰坦科技	2,025,744.25	4.60
49	688575	亚辉龙	2,013,140.67	4.57
50	688236	春立医疗	1,989,170.65	4.52
51	688566	吉贝尔	1,975,750.49	4.49
52	688475	萤石网络	1,959,782.22	4.45

53	688122	西部超导	1,951,155.06	4.43
54	688484	南芯科技	1,947,822.34	4.43
55	688123	聚辰股份	1,939,427.90	4.41
56	688303	大全能源	1,900,516.23	4.32
57	688016	心脉医疗	1,888,318.29	4.29
58	688508	芯朋微	1,879,691.44	4.27
59	688249	晶合集成	1,858,270.88	4.22
60	688065	凯赛生物	1,786,924.68	4.06
61	688389	普门科技	1,777,392.53	4.04
62	688588	凌志软件	1,776,664.33	4.04
63	688079	美迪凯	1,776,283.88	4.04
64	688686	奥普特	1,747,702.72	3.97
65	688378	奥来德	1,740,153.76	3.95
66	688658	悦康药业	1,725,848.70	3.92
67	688689	银河微电	1,725,714.52	3.92
68	688510	航亚科技	1,725,011.65	3.92
69	688269	凯立新材	1,720,068.15	3.91
70	688538	和辉光电	1,717,780.94	3.90
71	688779	五矿新能	1,667,675.04	3.79
72	688456	有研粉材	1,656,611.25	3.76
73	688088	虹软科技	1,649,542.23	3.75
74	688231	隆达股份	1,600,875.93	3.64
75	688697	纽威数控	1,565,585.23	3.56
76	688550	瑞联新材	1,560,183.47	3.54
77	688365	光云科技	1,552,140.86	3.53
78	688161	威高骨科	1,551,913.56	3.53
79	688676	金盘科技	1,527,726.30	3.47
80	688177	百奥泰	1,522,092.53	3.46
81	688097	博众精工	1,518,985.02	3.45
82	688363	华熙生物	1,485,487.60	3.37
83	688298	东方生物	1,481,411.35	3.37
84	688295	中复神鹰	1,471,019.33	3.34
85	688049	炬芯科技	1,460,544.81	3.32
86	688578	艾力斯	1,458,736.93	3.31
87	688595	芯海科技	1,441,711.94	3.28
88	688598	金博股份	1,440,396.51	3.27
89	688339	亿华通	1,433,394.97	3.26
90	688114	华大智造	1,423,836.26	3.23
91	688591	泰凌微	1,421,155.46	3.23
92	688557	兰剑智能	1,419,306.56	3.22
93	688403	汇成股份	1,409,850.39	3.20
94	688153	唯捷创芯	1,408,590.49	3.20
95	688472	阿特斯	1,402,838.03	3.19

96	688262	国芯科技	1,384,543.58	3.15
97	688525	佰维存储	1,373,782.70	3.12
98	688558	国盛智科	1,361,706.99	3.09
99	688678	福立旺	1,359,519.88	3.09
100	688162	巨一科技	1,352,394.91	3.07
101	688087	英科再生	1,339,122.38	3.04
102	688209	英集芯	1,331,869.67	3.03
103	688112	鼎阳科技	1,326,901.91	3.01
104	688526	科前生物	1,309,974.46	2.98
105	688432	有研硅	1,309,165.45	2.97
106	688276	百克生物	1,308,262.58	2.97
107	688261	东微半导	1,296,946.18	2.95
108	688131	皓元医药	1,294,512.34	2.94
109	688180	君实生物	1,280,124.03	2.91
110	688030	山石网科	1,276,642.40	2.90
111	688377	迪威尔	1,276,217.11	2.90
112	688687	凯因科技	1,258,537.87	2.86
113	688033	天宜新材	1,257,161.09	2.86
114	688181	八亿时空	1,249,853.62	2.84
115	688387	信科移动	1,246,265.24	2.83
116	688739	成大生物	1,235,395.76	2.81
117	688380	中微半导	1,225,643.60	2.78
118	688089	嘉必优	1,223,279.71	2.78
119	688336	三生国健	1,213,860.71	2.76
120	688357	建龙微纳	1,210,527.78	2.75
121	688219	会通股份	1,209,713.03	2.75
122	688150	莱特光电	1,206,690.34	2.74
123	688327	云从科技	1,205,323.26	2.74
124	688381	帝奥微	1,183,958.03	2.69
125	688328	深科达	1,181,265.56	2.68
126	688677	海泰新光	1,178,978.30	2.68
127	688270	臻镭科技	1,144,830.28	2.60
128	688105	诺唯赞	1,137,400.27	2.58
129	688063	派能科技	1,126,090.06	2.56
130	688108	赛诺医疗	1,114,631.76	2.53
131	688080	映翰通	1,111,218.69	2.52
132	688621	阳光诺和	1,110,875.58	2.52
133	688630	芯碁微装	1,106,667.00	2.51
134	688286	敏芯股份	1,102,302.76	2.50
135	688371	菲沃泰	1,099,170.63	2.50
136	688589	力合微	1,082,285.94	2.46
137	688778	厦钨新能	1,073,585.35	2.44
138	688313	仕佳光子	1,063,945.87	2.42

139	688106	金宏气体	1,062,280.21	2.41
140	688733	壹石通	1,055,596.41	2.40
141	688786	悦安新材	1,051,126.26	2.39
142	688169	石头科技	1,042,480.66	2.37
143	688362	甬矽电子	1,040,313.91	2.36
144	688386	泛亚微透	1,023,191.31	2.32
145	688268	华特气体	1,019,824.21	2.32
146	688709	成都华微	1,016,672.08	2.31
147	688013	天臣医疗	1,009,608.51	2.29
148	688639	华恒生物	1,003,586.99	2.28
149	688568	中科星图	991,696.79	2.25
150	688259	创耀科技	985,784.68	2.24
151	688509	正元地信	983,341.02	2.23
152	688519	南亚新材	982,004.18	2.23
153	688116	天奈科技	981,274.79	2.23
154	688172	燕东微	977,804.29	2.22
155	688499	利元亨	976,198.17	2.22
156	688246	嘉和美康	969,764.95	2.20
157	688548	广钢气体	969,405.47	2.20
158	688192	迪哲医药	969,040.64	2.20
159	688665	四方光电	956,256.76	2.17
160	688321	微芯生物	948,810.52	2.16
161	688358	祥生医疗	942,111.36	2.14
162	688182	灿勤科技	941,593.98	2.14
163	688066	航天宏图	941,296.99	2.14
164	688022	瀚川智能	939,670.19	2.13
165	688512	慧智微	939,112.53	2.13
166	688319	欧林生物	936,824.82	2.13
167	688308	欧科亿	929,072.09	2.11
168	688501	青达环保	928,332.99	2.11
169	688085	三友医疗	923,250.75	2.10
170	688176	亚虹医药	920,692.89	2.09
171	688001	华兴源创	920,537.77	2.09
172	688800	瑞可达	916,601.32	2.08
173	688166	博瑞医药	915,287.99	2.08
174	688612	威迈斯	909,653.18	2.07
175	600150	中国船舶	900,618.84	2.05
176	000792	盐湖股份	888,695.00	2.02
177	688388	嘉元科技	888,113.33	2.02
178	688185	康希诺	884,159.13	2.01
179	688202	美迪西	882,206.89	2.00
180	688653	康希通信	882,137.09	2.00

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	541,690,959.48
卖出股票收入（成交）总额	515,015,942.14

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国铁路通信信号股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到丽水市交通运输局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	999.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	999.86

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投 上证科创	131	44,084.45	0.00	0.0000%	5,775,062.42	100.0000%

板综合指数增强 A						
中信建投上证科创板综合指数增强 C	644	49,545.95	0.00	0.0000%	31,907,590.31	100.0000%
合计	763	49,387.49	0.00	0.0000%	37,682,652.73	100.0000%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中信建投上证科创板综合指数增强 A	98,864.78	1.7119%
	中信建投上证科创板综合指数增强 C	20,010.11	0.0627%
	合计	118,874.89	0.3155%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	中信建投上证科创板综合指数增强 A	0~10
	中信建投上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投上证科创板综合指数增强 A	0~10
	中信建投上证科创板综合指数增强 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投上证科创板综合指数增强 A	中信建投上证科创板综合指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 06 月 24 日）基金份	35,104,609.82	189,836,931.36

额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,880,234.20	33,075,302.16
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,209,781.60	191,004,643.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,775,062.42	31,907,590.31

§ 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，基金管理人、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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 15,000.00 元整，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

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，管理人未受调查或处罚。

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，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	3	907,785,790.33	85.93%	177,845.59	85.98%	-
中信建投证券股份有限公司	3	148,596,693.07	14.07%	28,987.90	14.02%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

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	成交金额	占当期

						的比例	额	基金成交总额的比例
东北证券股份有限公司	-	-	259,000,000.00	12.16%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	1,870,300,000.00	87.84%	-	-	-	-

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	中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	规定网站、规定报刊	2025-06-25
2	中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	规定网站、规定报刊	2025-07-25
3	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-10-28
4	中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	规定网站	2025-10-28

§ 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，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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、《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 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；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日