

国泰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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十日

§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。

基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 03 月 04 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	66
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	66
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	66
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	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
§10 开放式基金份额变动	68
§11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰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	国泰上证科创板综合 ETF
场内简称	科创综指 ETF 国泰
基金主代码	589630
交易代码	589630
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 4 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国国际金融股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,629,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2025 年 3 月 12 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人可以采取替代性策略等方式对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本等因素，可以采用抽样复制的策略。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对</p>

	<p>值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、金融衍生品投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。</p>
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p> <p>本基金投资于科创板股票，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，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</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		国泰基金管理有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	刘晴川
	联系电话	021-31081600转	010-65051166
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	AC_Product@cicc.com.cn
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	010-65353060; 010-65351622
传真		021-31081800	010-65059873
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市朝阳区建国门外大街1 号国贸大厦2座27层及28层
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市朝阳区建国门外大街1 号国贸大厦2座27层及28层
邮政编码		200082	100004
法定代表人		周向勇	陈亮

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	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层及基金托管人住所或办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
本期已实现收益	163,348,782.96
本期利润	177,073,320.98
加权平均基金份额本期利润	0.2188
本期加权平均净值利润率	21.41%
本期基金份额净值增长率	32.85%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
期末可供分配利润	80,042,322.58
期末可供分配基金份额利润	0.3285
期末基金资产净值	323,671,322.58
期末基金份额净值	1.3285
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
基金份额累计净值增长率	32.85%

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

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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

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	-4.25%	1.57%	-4.68%	1.63%	0.43%	-0.06%
过去六个月	35.60%	1.61%	33.08%	1.68%	2.52%	-0.07%
自基金合同生效起至今	32.85%	1.67%	33.33%	1.75%	-0.48%	-0.08%

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

国泰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份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2025 年 3 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日)



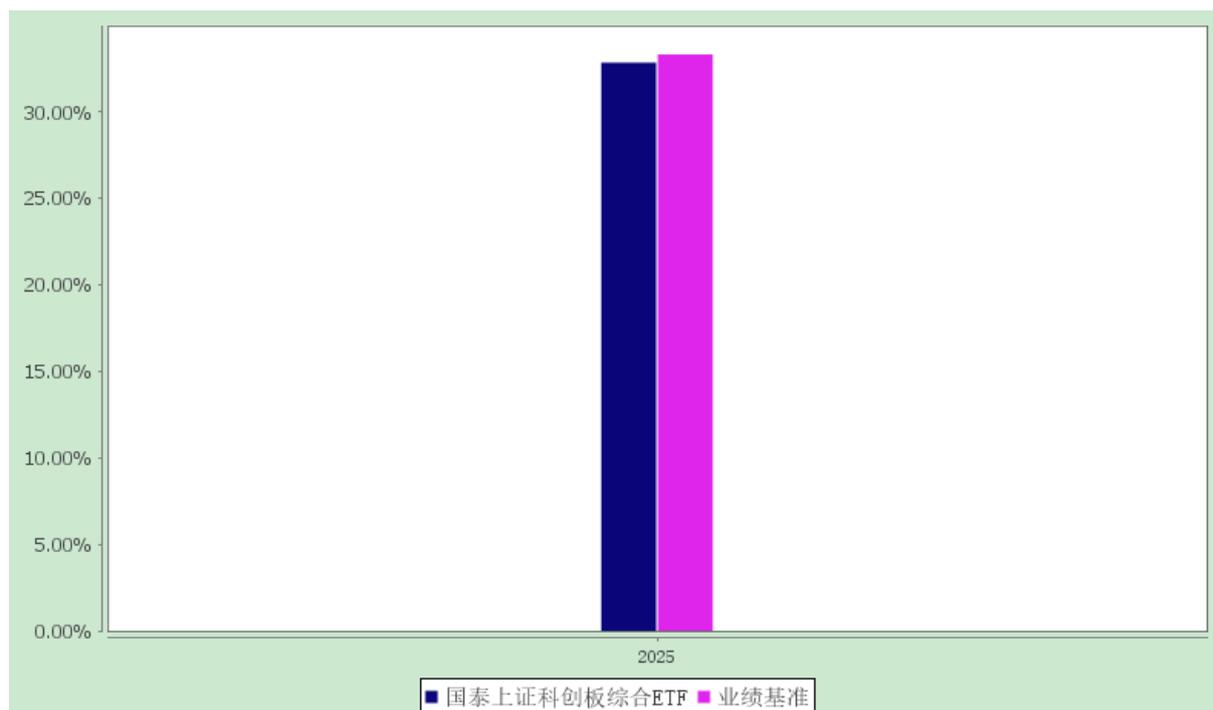
注：(1)本基金合同生效日为 2025 年 3 月 4 日，截至 2025 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年。

(2)本基金的建仓期为 6 个月，在建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰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：2025 年计算期间为本基金合同生效日 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日，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日（2025 年 3 月 4 日）至本报告期末未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在

北京和深圳设有分公司。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 301 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

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		
麻绎文	国泰中证有色金属 ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰中证 2000ETF、国泰中证全指集成电路 ETF、国泰上证科创板 100ETF 发起联接、国泰中证沪深港黄金产业股票 ETF、国泰上证国有企业红利 ETF、国泰中证港股通高股息投资 ETF、国泰沪深 300 增强策略 ETF 发起联接、国泰创业板 50ETF、国泰富时中国 A 股自由现金流聚焦 ETF、国	2025-03-04	-	6 年	硕士研究生。2020 年 6 月加入国泰基金，历任助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理。2023 年 8 月起兼任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 10 月起兼任国泰中证全指集成电路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 4 月起兼任国泰中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任

	<p>泰上证科创板综合 ETF、国泰创业板人工智能 ETF、国泰上证科创板芯片 ETF、国泰创业板医药卫生 ETF、国泰创业板新能源 ETF、国泰上证科创板创新药 ETF、国泰上证科创板人工智能 ETF 的基金经理</p>				<p>国泰创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 2 月起兼任国泰富时中国 A 股自由现金流聚焦交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月起兼任国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 4 月起兼任国泰创业板医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰创业板新能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 7 月起兼任国泰上证科创板创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
<p>刘昉元</p>	<p>国泰中证 2000ETF、国泰上证科创板综合 ETF、国泰中证 A500 增强策略 ETF、国泰上证科创板芯片 ETF 发起联接、国泰中证港股通汽车产业主题 ETF、国泰创业板医药卫生 ETF 发起联接、国泰创业板人工智能 ETF 发起联接的基金经理</p>	<p>2025-04-11</p>	<p>-</p>	<p>6 年</p>	<p>硕士研究生。曾任职于浙商基金管理有限公司。2022 年 7 月加入国泰基金，历任量化研究员、基金经理助理。2025 年 4 月起任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2025 年 10 月起兼任国泰创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。</p>

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，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法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期

检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2025 年市场总体震荡上行。市场开年震荡调整，但春节前后 DeepSeek 为代表的 AI 产业趋势持续发酵，叠加 3 月重要会议政策定调积极，催化市场上行，小盘股表现出更强弹性。二季度 A 股市场先下后上，受 4 月初关税影响，A 股大幅回调，但在“国家队”出手后迅速止跌企稳。

三季度 A 股市场在多重利好共振下大幅走强，主要指数均实现显著上涨，市场活跃度提升。半导体、通信设备等科技板块成为市场上涨主要驱动力，资金持续流入科技成长赛道。尽管季末受外部关税扰动出现短期震荡，市场整体情绪趋于积极。四季度，受高基数效应、补贴退坡等因素影响，A 股市场以震荡为主。板块间出现分化，三季度涨幅较大的科技和新能源方向调整幅度较大，市场活跃度仍维持在较高位置。

科创综指以科创板所有符合条件的股票为成分，成分股权重集中度较低、行业市值分布更均匀，侧重于全面表征科创板表现。作为资本市场针对转变经济增长方式、实现高质量发展的重要抓手，科创综指的主要成分股具备明显“硬科技”特征。其成分股主要分布在半导体、生物医药、计算机等行业，行业分布较为分散，具备明显成长型宽基特征，是弹性较佳、适合进攻的品种。

作为跟踪标的指数的被动型基金，本基金紧密跟踪标的指数，在追求跟踪偏离度和跟踪误差的同时，也会精细化操作以更好的跟踪市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 32.85%，同期业绩比较基准收益率为 33.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，随着宏观政策逐步落地，提振内需趋势进一步强化，风险偏好有望维持高位。叠加流动性改善，市场中长期或将有所表现。

科技板块在前期强势后迎来回调，但未来行情主线或仍将围绕硬科技方向进一步展开。从基本面角度看，全球 AI 产业如火如荼，国内大力推动新质生产力、专精特新、高端制造等新兴产业，两会、中央政治局会议等重要会议继续注重“发展新质生产力”，多维度支持科创领域发展。后期行情或将转向基本面驱动，以先进制造为代表的科技主线值得重点关注。

中长期来看，一系列新政有望推动新质生产力相关领域发展，代表新质生产力和科技发展方向的科创综指长期向好趋势不变，具备较高长期投资价值。

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，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内

相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国国际金融股份有限公司（以下称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的重大违规行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2605257 号

国泰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

我们审计了后附的国泰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 3 月 4 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、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 3 月 4 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

该基金管理人国泰基金管理有限公司（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

王国蓓 叶凯韵

北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2026 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,807,670.59
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	322,075,844.45
其中：股票投资		322,011,843.47
基金投资		-
债券投资		64,000.98
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		323,883,515.04
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		3,702.77
应付赎回款		-
应付管理人报酬		45,367.28

应付托管费		15,122.41
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	148,000.00
负债合计		212,192.46
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	243,629,000.00
未分配利润	7.4.7.8	80,042,322.58
净资产合计		323,671,322.58
负债和净资产总计		323,883,515.04

注：1. 报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3285 元，基金份额总额 243,629,000.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 4 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：国泰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 3 月 4 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 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		178,583,846.38
1.利息收入		102,828.08
其中：存款利息收入	7.4.7.9	102,828.08
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）		164,448,467.15
其中：股票投资收益	7.4.7.10	159,353,175.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	0.98
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-

衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	5,095,291.16
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	13,724,538.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	308,013.13
减：二、营业总支出		1,510,525.40
1. 管理人报酬		1,020,536.02
2. 托管费		340,178.72
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. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.16	149,810.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		177,073,320.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		177,073,320.98
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		177,073,320.98

注：本基金合同生效日为 2025 年 3 月 4 日，无上年度可比期间数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰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 3 月 4 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 3 月 4 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	1,503,629,000.00	-	1,503,629,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”	-1,260,000,000.00	80,042,322.58	-1,179,957,677.42

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	177,073,320.98	177,073,320.98
(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)	-1,260,000,000.00	-97,030,998.40	-1,357,030,998.40
其中: 1. 基金申购款	2,085,000,000.00	364,103,221.77	2,449,103,221.77
2. 基金赎回款	-3,345,000,000.00	-461,134,220.17	-3,806,134,220.17
(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	243,629,000.00	80,042,322.58	323,671,322.58

注: 本基金合同生效日为 2025 年 3 月 4 日, 无上年度可比期间数据。

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: 李昇 主管会计工作负责人: 李昇 会计机构负责人: 吴洪涛

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]219 号《关于准予国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册, 由国泰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《国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金, 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 1,503,629,000.00 元, 基金合同于 2025 年 3 月 4 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 1,503,629,000.00 份基金份额, 无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司, 基金托管人为中国国际金融股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2025]58 号文审核同意, 本基金

1,503,629,000.00 份基金份额于 2025 年 3 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰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》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股（含存托凭证）、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、金融衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具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）。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80% 且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证科创板综合指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“国泰上证科创板综合 ETF 发起联接”)。国泰上证科创板综合 ETF 发起联接为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、自 2025 年 3 月 4 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的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。

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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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,在资产负债表中的其他负债科目下列示。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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

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

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未

显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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 1)具有抵销已确认金额

的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行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。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。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未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

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

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扣除按票面利率(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确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用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，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可根据实际情况对本基金进行收益分配。本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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、债券投资和资产支持证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和债券，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)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中

证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(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固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政

策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2025 年 12 月 31 日	
活期存款		842,192.58
等于：本金		841,914.87
加：应计利息		277.71
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		965,478.01
等于：本金		965,437.23
加：应计利息		40.78
合计		1,807,670.59

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	308,287,305.45	-	322,011,843.47	13,724,538.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	64,000.00	0.98	64,000.98	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	64,000.00	0.98	64,000.98	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	308,351,305.45	0.98	322,075,844.45	13,724,538.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	148,000.00
合计	148,000.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 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	1,503,629,000.00	1,503,629,000.00
本期申购	2,085,000,000.00	2,085,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,345,000,000.00	-3,345,000,000.00
本期末	243,629,000.00	243,629,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	163,348,782.96	13,724,538.02	177,073,320.98
本期基金份额交易产生的变动数	-76,160,786.11	-20,870,212.29	-97,030,998.40
其中：基金申购款	354,316,616.23	9,786,605.54	364,103,221.77
基金赎回款	-430,477,402.34	-30,656,817.83	-461,134,220.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,187,996.85	-7,145,674.27	80,042,322.58

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	25,548.84
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	102,828.08
----	------------

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3月4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	44,696,574.69
股票投资收益——赎回差价收入	114,656,600.32
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	159,353,175.01

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3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	684,185,864.03
减：卖出股票成本总额	638,457,095.88
减：交易费用	1,032,193.46
买卖股票差价收入	44,696,574.69

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3月4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	3,806,134,220.17
减：现金支付赎回款总额	13,007,936.85
减：赎回股票成本总额	3,678,469,683.00
减：交易费用	-
赎回差价收入	114,656,600.32

7.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月4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	0.98

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	0.98

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月4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	5,095,291.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,095,291.16

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	13,724,538.02
——股票投资	13,724,538.02
——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	13,724,538.02

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	218,270.38
其他	89,742.75
合计	308,013.13

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	48,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
存托服务费	774.30
银行汇划费用	1,036.36
合计	149,810.66

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“国泰上证科创板综合 ETF 发起联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）	基金托管人、申购赎回代理券商
中国建银投资有限责任公司（“中国建投”）	基金管理人的控股股东

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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3月4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	1,020,536.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	415,489.82
应支付基金管理人的净管理费	605,046.20

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 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3月4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	340,178.72	

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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

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
国泰上证科创板综合 ETF 发起联接	20,158,747.00	8.27%
中金公司	4,908,187.00	2.01%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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3月4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

中金公司	842,192.58	77,279.24
------	------------	-----------

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中金公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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
603418	友升股份	2025-09-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.36	59.06	139.00	6,444.04	8,209.34	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.08	48.56	169.00	2,886.52	8,206.64	-
601026	道生天合	2025-10-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	5.98	14.28	451.00	2,696.98	6,440.28	-
603406	天富龙	2025-07-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.60	40.16	153.00	3,610.80	6,144.48	-
60309	德力	2025-1	6 个月	新股	46.68	55.66	106.00	4,948.	5,899.	-

2	佳	0-30	以上	锁定 流通 受限				08	96	
603248	锡华科技	2025-12-16	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	10.10	16.30	260.00	2,626.00	4,238.00	-
603370	华新精科	2025-08-27	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	18.60	46.35	82.00	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	12.55	26.21	111.00	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	24.49	32.82	88.00	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 05 转债	2025-12-25	1 个月以内(含)	配债未上市	100.00	100.00	640.00	64,000.00	64,000.98	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

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	重大事项停牌	272.72	2026-01-05	278.00	24,849.00	6,716,599.51	6,776,819.28	

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资于科创板股票，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，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中金公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.02%。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	1,807,670.59	-	-	-	1,807,670.59
交易性金融资产	-	-	64,000.98	322,011,843.47	322,075,844.45
资产总计	1,807,670.59	-	64,000.98	322,011,843.47	323,883,515.04
负债					
应付清算款	-	-	-	3,702.77	3,702.77
应付管理人报酬	-	-	-	45,367.28	45,367.28
应付托管费	-	-	-	15,122.41	15,122.41
其他负债	-	-	-	148,000.00	148,000.00
负债总计	-	-	-	212,192.46	212,192.46
利率敏感度缺口	1,807,670.59	-	64,000.98	321,799,651.01	323,671,322.58

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.02%，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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。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	322,011,843.47	99.49
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	-	-
合计	322,011,843.47	99.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

7.4.14 公允价值
7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具
7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	第一层次	315,186,287.32
第二层次	6,840,820.26	
第三层次	48,736.87	
合计	322,075,844.45	

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2025年3月4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	-	28,285.79	28,285.79
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	20,451.08	20,451.08
其中:计入损益的利得或损失	-	20,451.08	20,451.08
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	48,736.87	48,736.87
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	-	20,451.08	20,451.08

注:于2025年12月31日,本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2025年度,本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位:人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	48,736.87	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%-303.23%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

自 2025 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2025 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 2,449,103,221.77 元，其中包括以股票支付的申购款 2,424,341,533.07 元和以现金支付的申购款 24,761,688.70 元。

(2) 除基金申购款外，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	322,011,843.47	99.42
	其中：股票	322,011,843.47	99.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,000.98	0.02
	其中：债券	64,000.98	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,807,670.59	0.56
8	其他各项资产	-	-
9	合计	323,883,515.04	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	254,346,689.80	78.58
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	61,461,635.16	18.99
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	5,093,591.72	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	1,061,189.92	0.33
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	321,963,106.60	99.47

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	48,736.87	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,736.87	0.02

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	688256	寒武纪	14,158	19,191,876.90	5.93
2	688041	海光信息	80,349	18,031,119.09	5.57
3	688981	中芯国际	68,689	8,437,069.87	2.61
4	688012	中微公司	24,849	6,776,819.28	2.09
5	688111	金山办公	16,027	4,921,410.89	1.52
6	688008	澜起科技	39,716	4,678,544.80	1.45
7	688506	百利天恒	13,557	4,380,266.70	1.35
8	688271	联影医疗	28,501	3,576,875.50	1.11
9	688775	影石创新	13,361	3,138,498.90	0.97
10	688082	盛美上海	16,586	2,919,965.30	0.90
11	688072	拓荆科技	8,500	2,805,000.00	0.87
12	688183	生益电子	28,684	2,744,771.96	0.85
13	688036	传音控股	39,470	2,611,335.20	0.81
14	688396	华润微	45,823	2,422,203.78	0.75
15	688521	芯原股份	17,288	2,367,937.36	0.73
16	688249	晶合集成	69,646	2,311,550.74	0.71
17	688498	源杰科技	3,500	2,246,965.00	0.69
18	688027	国盾量子	4,200	2,115,918.00	0.65
19	688126	沪硅产业	94,602	2,047,187.28	0.63
20	688110	东芯股份	15,200	1,996,520.00	0.62
21	688303	大全能源	74,075	1,986,691.50	0.61
22	688702	盛科通信	13,779	1,952,346.51	0.60
23	688469	芯联集成	291,709	1,951,533.21	0.60
24	688223	晶科能源	345,578	1,949,059.92	0.60
25	688375	国博电子	20,750	1,932,032.50	0.60
26	688472	阿特斯	127,565	1,901,994.15	0.59
27	688525	佰维存储	15,900	1,825,161.00	0.56
28	688047	龙芯中科	13,273	1,753,496.03	0.54
29	688361	中科飞测	11,400	1,744,086.00	0.54
30	688585	上纬新材	13,521	1,722,169.77	0.53
31	688120	华海清科	11,472	1,721,717.76	0.53
32	688122	西部超导	22,431	1,672,903.98	0.52
33	688568	中科星图	28,081	1,656,779.00	0.51
34	688009	中国通号	298,415	1,632,330.05	0.50
35	688578	艾力斯	15,535	1,617,970.25	0.50
36	688629	华丰科技	15,900	1,590,954.00	0.49
37	688002	睿创微纳	15,700	1,582,560.00	0.49
38	688187	时代电气	29,934	1,535,314.86	0.47
39	688387	信科移动	118,384	1,527,153.60	0.47
40	688347	华虹公司	13,700	1,477,819.00	0.46
41	688676	金盘科技	15,900	1,436,406.00	0.44
42	688172	燕东微	49,311	1,427,060.34	0.44
43	688313	仕佳光子	15,800	1,402,724.00	0.43
44	689009	九号公司	24,757	1,376,241.63	0.43

45	688385	复旦微电	18,554	1,367,429.80	0.42
46	688778	厦钨新能	17,564	1,358,926.68	0.42
47	688777	中控技术	27,323	1,348,116.82	0.42
48	688728	格科微	90,046	1,345,287.24	0.42
49	688234	天岳先进	14,605	1,298,092.40	0.40
50	688213	思特威	13,500	1,283,715.00	0.40
51	688538	和辉光电	478,994	1,274,124.04	0.39
52	688336	三生国健	21,277	1,267,470.89	0.39
53	688235	百济神州	4,700	1,262,420.00	0.39
54	688099	晶晨股份	14,400	1,256,112.00	0.39
55	688065	凯赛生物	25,215	1,255,707.00	0.39
56	688615	合合信息	5,500	1,251,690.00	0.39
57	688617	惠泰医疗	5,145	1,251,624.15	0.39
58	688599	天合光能	75,040	1,241,912.00	0.38
59	688188	柏楚电子	9,093	1,235,647.77	0.38
60	688019	安集科技	5,525	1,204,008.00	0.37
61	688692	达梦数据	4,600	1,201,842.00	0.37
62	688322	奥比中光	13,400	1,201,578.00	0.37
63	688608	恒玄科技	5,260	1,193,704.40	0.37
64	688220	翱捷科技	14,176	1,171,079.36	0.36
65	688169	石头科技	7,580	1,152,614.80	0.36
66	688278	特宝生物	13,700	1,146,416.00	0.35
67	688297	中无人机	23,444	1,125,780.88	0.35
68	688819	天能股份	33,874	1,125,294.28	0.35
69	688349	三一重能	42,414	1,072,225.92	0.33
70	688200	华峰测控	5,513	1,048,572.60	0.32
71	688102	斯瑞新材	26,563	1,029,050.62	0.32
72	688709	成都华微	22,168	1,019,506.32	0.31
73	688295	中复神鹰	30,804	1,010,679.24	0.31
74	688147	微导纳米	15,955	1,001,814.45	0.31
75	688318	财富趋势	7,505	993,061.60	0.31
76	688017	绿的谐波	5,133	986,049.30	0.30
77	688425	铁建重工	186,322	944,652.54	0.29
78	688433	华曙高科	14,258	943,451.86	0.29
79	688192	迪哲医药	15,937	917,971.20	0.28
80	688180	君实生物	26,563	907,392.08	0.28
81	688333	铂力特	8,100	903,231.00	0.28
82	688331	荣昌生物	11,600	902,364.00	0.28
83	688563	航材股份	15,400	900,130.00	0.28
84	688195	腾景科技	5,300	898,615.00	0.28
85	688343	云天励飞	11,700	890,136.00	0.28
86	688018	乐鑫科技	5,220	887,400.00	0.27
87	688582	芯动联科	13,400	885,874.00	0.27
88	688005	容百科技	24,878	880,681.20	0.27

89	688502	茂莱光学	2,200	877,910.00	0.27
90	688627	精智达	3,900	872,001.00	0.27
91	688248	南网科技	19,360	866,166.40	0.27
92	688536	思瑞浦	5,400	863,352.00	0.27
93	688208	道通科技	23,360	859,648.00	0.27
94	688114	华大智造	13,900	844,564.00	0.26
95	688772	珠海冠宇	39,211	844,212.83	0.26
96	688561	奇安信	23,444	834,137.52	0.26
97	688475	萤石网络	27,670	833,143.70	0.26
98	688052	纳芯微	5,200	822,536.00	0.25
99	688660	电气风电	46,149	784,994.49	0.24
100	688279	峰岬科技	3,800	773,262.00	0.24
101	688037	芯源微	5,200	772,252.00	0.24
102	688523	航天环宇	13,544	757,922.24	0.23
103	688146	中船特气	18,316	739,966.40	0.23
104	688270	臻镭科技	6,015	734,251.05	0.23
105	688630	芯碁微装	5,400	726,462.00	0.22
106	688266	泽璟制药	7,803	723,338.10	0.22
107	688363	华熙生物	16,534	722,205.12	0.22
108	688205	德科立	5,200	714,896.00	0.22
109	688166	博瑞医药	14,295	701,312.70	0.22
110	688766	普冉股份	5,500	699,655.00	0.22
111	688400	凌云光	16,000	678,080.00	0.21
112	688088	虹软科技	13,600	673,200.00	0.21
113	688141	杰华特	15,500	673,165.00	0.21
114	688353	华盛锂电	5,900	670,830.00	0.21
115	688100	威胜信息	16,964	666,685.20	0.21
116	688520	神州细胞	15,300	662,643.00	0.20
117	688668	鼎通科技	5,305	657,820.00	0.20
118	688548	广钢气体	45,193	657,106.22	0.20
119	688567	孚能科技	41,821	654,498.65	0.20
120	688048	长光华芯	5,200	651,820.00	0.20
121	688167	炬光科技	3,700	647,759.00	0.20
122	688409	富创精密	9,600	647,040.00	0.20
123	688332	中科蓝讯	4,900	643,419.00	0.20
124	688123	聚辰股份	5,100	640,458.00	0.20
125	688686	奥普特	5,157	640,138.41	0.20
126	688068	热景生物	3,800	615,600.00	0.19
127	688006	杭可科技	21,013	615,470.77	0.19
128	688281	华秦科技	8,200	605,160.00	0.19
129	688484	南芯科技	14,864	604,370.24	0.19
130	688097	博众精工	15,700	592,675.00	0.18
131	688388	嘉元科技	14,300	586,014.00	0.18
132	688326	经纬恒润	4,880	573,400.00	0.18

133	688116	天奈科技	12,100	570,515.00	0.18
134	688160	步科股份	3,700	564,250.00	0.17
135	688198	佰仁医疗	5,200	556,452.00	0.17
136	688372	伟测科技	5,100	556,359.00	0.17
137	688301	奕瑞科技	5,500	556,105.00	0.17
138	688025	杰普特	3,900	552,123.00	0.17
139	688382	益方生物	20,171	549,458.04	0.17
140	688228	开普云	2,800	544,908.00	0.17
141	688519	南亚新材	6,728	544,026.08	0.17
142	688698	伟创电气	5,500	543,840.00	0.17
143	688153	唯捷创芯	14,400	542,016.00	0.17
144	688392	骄成超声	4,800	538,560.00	0.17
145	688652	京仪装备	5,476	538,345.56	0.17
146	688031	星环科技	4,900	530,131.00	0.16
147	688432	有研硅	42,674	529,584.34	0.16
148	688127	蓝特光学	13,709	527,659.41	0.16
149	688352	硕中科技	41,503	523,352.83	0.16
150	688584	上海合晶	23,679	519,517.26	0.16
151	688032	禾迈股份	5,100	514,029.00	0.16
152	688327	云从科技	35,582	511,313.34	0.16
153	688798	艾为电子	6,687	508,947.57	0.16
154	688206	概伦电子	14,600	508,518.00	0.16
155	688062	迈威生物	13,200	507,804.00	0.16
156	688779	五矿新能	67,750	507,447.50	0.16
157	688691	灿芯股份	4,900	499,702.00	0.15
158	688306	均普智能	43,032	499,171.20	0.15
159	688726	拉普拉斯	13,400	482,400.00	0.15
160	688403	汇成股份	29,400	481,572.00	0.15
161	688190	云路股份	4,900	477,260.00	0.15
162	688001	华兴源创	15,780	476,240.40	0.15
163	688016	心脉医疗	5,100	467,466.00	0.14
164	688612	威迈斯	14,100	464,877.00	0.14
165	688549	中巨芯	50,684	462,238.08	0.14
166	688125	安达智能	3,400	459,170.00	0.14
167	688800	瑞可达	5,400	448,200.00	0.14
168	688516	奥特维	9,886	447,440.36	0.14
169	688577	浙海德曼	4,600	445,556.00	0.14
170	688776	国光电气	4,400	443,256.00	0.14
171	688158	优刻得	15,600	438,204.00	0.14
172	688362	甬矽电子	13,500	437,535.00	0.14
173	688503	聚和材料	7,153	436,333.00	0.13
174	688300	联瑞新材	6,993	434,195.37	0.13
175	688380	中微半导	13,489	433,671.35	0.13
176	688029	南微医学	5,300	432,268.00	0.13

177	688165	埃夫特	18,012	427,965.12	0.13
178	688789	宏华数科	5,240	427,426.80	0.13
179	688261	东微半导	5,200	426,452.00	0.13
180	688390	固德威	6,800	422,484.00	0.13
181	688055	龙腾光电	117,053	421,390.80	0.13
182	688631	莱斯信息	6,104	415,560.32	0.13
183	688368	晶丰明源	3,600	415,548.00	0.13
184	688131	皓元医药	5,676	409,126.08	0.13
185	688109	品茗科技	3,200	406,720.00	0.13
186	688535	华海诚科	3,600	403,488.00	0.12
187	688063	派能科技	7,087	402,683.34	0.12
188	688486	龙迅股份	5,400	401,274.00	0.12
189	688656	浩欧博	2,600	399,880.00	0.12
190	688258	卓易信息	5,200	398,164.00	0.12
191	688321	微芯生物	13,600	397,392.00	0.12
192	688275	万润新能	5,200	392,080.00	0.12
193	688182	灿勤科技	13,200	389,664.00	0.12
194	688128	中国电研	13,306	386,938.48	0.12
195	688552	航天南湖	10,600	384,992.00	0.12
196	688603	天承科技	5,100	382,296.00	0.12
197	688289	圣湘生物	19,905	376,403.55	0.12
198	688739	成大生物	14,500	373,520.00	0.12
199	688161	威高骨科	13,362	373,067.04	0.12
200	688351	微电生理	16,100	372,715.00	0.12
201	688150	莱特光电	13,764	372,040.92	0.11
202	688522	纳睿雷达	9,200	367,356.00	0.11
203	688507	索辰科技	3,633	364,353.57	0.11
204	688233	神工股份	5,175	362,405.25	0.11
205	688107	安路科技	13,326	362,200.68	0.11
206	688658	悦康药业	15,900	359,499.00	0.11
207	688515	裕太微	3,500	358,925.00	0.11
208	688586	江航装备	27,206	354,766.24	0.11
209	688439	振华风光	5,460	352,716.00	0.11
210	688788	科思科技	5,200	350,168.00	0.11
211	688239	航宇科技	5,167	349,650.89	0.11
212	688456	有研粉材	4,500	349,650.00	0.11
213	688230	芯导科技	4,800	347,904.00	0.11
214	688083	中望软件	5,103	347,565.33	0.11
215	688559	海目星	7,200	346,032.00	0.11
216	688531	日联科技	5,200	343,356.00	0.11
217	688690	纳微科技	13,300	343,273.00	0.11
218	688305	科德数控	5,500	339,900.00	0.11
219	688319	欧林生物	13,400	339,824.00	0.10
220	688095	福昕软件	3,800	339,226.00	0.10

221	688028	沃尔德	5,196	335,349.84	0.10
222	688543	国科军工	5,400	335,178.00	0.10
223	688177	百奥泰	14,400	333,216.00	0.10
224	688508	芯朋微	5,400	328,860.00	0.10
225	688383	新益昌	4,200	328,734.00	0.10
226	688262	国芯科技	10,788	327,415.80	0.10
227	688443	智翔金泰	11,900	324,156.00	0.10
228	688386	泛亚微透	3,700	324,120.00	0.10
229	688556	高测股份	28,368	323,962.56	0.10
230	688106	金宏气体	16,531	323,842.29	0.10
231	688696	极米科技	2,900	323,292.00	0.10
232	688050	爱博医疗	5,300	321,498.00	0.10
233	688717	艾罗能源	5,200	320,320.00	0.10
234	688648	中邮科技	5,200	319,592.00	0.10
235	688376	美埃科技	5,500	318,010.00	0.10
236	688750	金天钛业	15,900	317,523.00	0.10
237	688700	东威科技	9,000	317,520.00	0.10
238	688562	航天软件	13,249	316,386.12	0.10
239	688513	苑东生物	5,137	316,182.35	0.10
240	688325	赛微微电	3,600	315,108.00	0.10
241	688007	光峰科技	16,953	314,817.21	0.10
242	688593	新相微	15,600	314,808.00	0.10
243	688139	海尔生物	9,900	314,622.00	0.10
244	688003	天准科技	5,309	312,700.10	0.10
245	688202	美迪西	5,500	310,200.00	0.10
246	688222	成都先导	13,200	309,540.00	0.10
247	688155	先惠技术	5,100	308,295.00	0.10
248	688626	翔宇医疗	5,085	307,642.50	0.10
249	688093	世华科技	8,338	307,255.30	0.09
250	688196	卓越新能	5,200	306,280.00	0.09
251	688185	康希诺	4,866	305,828.10	0.09
252	688621	阳光诺和	4,800	298,320.00	0.09
253	688252	天德钰	14,000	296,380.00	0.09
254	688209	英集芯	14,836	295,829.84	0.09
255	688499	利元亨	5,100	294,372.00	0.09
256	688787	海天瑞声	2,500	289,975.00	0.09
257	688591	泰凌微	6,700	285,152.00	0.09
258	688059	华锐精密	3,600	283,320.00	0.09
259	688685	迈信林	5,100	282,948.00	0.09
260	688210	统联精密	5,086	281,357.52	0.09
261	688268	华特气体	4,900	281,211.00	0.09
262	688359	三孚新科	4,200	279,846.00	0.09
263	688575	亚辉龙	19,654	279,086.80	0.09
264	688108	赛诺医疗	14,500	278,980.00	0.09

265	688596	正帆科技	8,800	278,344.00	0.09
266	688143	长盈通	5,500	276,155.00	0.09
267	688138	清溢光电	9,783	275,489.28	0.09
268	688049	炬芯科技	5,200	273,520.00	0.08
269	688084	晶品特装	3,300	273,240.00	0.08
270	688570	天玛智控	14,767	272,008.14	0.08
271	688553	汇宇制药	14,990	266,672.10	0.08
272	688408	中信博	6,287	264,745.57	0.08
273	688661	和林微纳	5,100	263,976.00	0.08
274	688232	新点软件	10,616	263,489.12	0.08
275	688518	联赢激光	10,830	263,060.70	0.08
276	688105	诺唯赞	13,100	262,262.00	0.08
277	688348	昱能科技	5,200	262,028.00	0.08
278	688011	新光光电	4,100	261,744.00	0.08
279	688611	杭州柯林	5,100	259,335.00	0.08
280	688401	路维光电	5,300	258,693.00	0.08
281	688091	上海谊众	5,500	258,500.00	0.08
282	688276	百克生物	13,700	258,382.00	0.08
283	688799	华纳药厂	5,400	257,580.00	0.08
284	688526	科前生物	16,784	256,123.84	0.08
285	688225	亚信安全	13,200	256,080.00	0.08
286	688539	高华科技	5,172	256,065.72	0.08
287	688721	龙图光罩	5,500	255,915.00	0.08
288	688257	新锐股份	7,423	254,460.44	0.08
289	688720	艾森股份	3,600	253,368.00	0.08
290	688035	德邦科技	5,200	250,900.00	0.08
291	688290	景业智能	4,200	249,648.00	0.08
292	688103	国力电子	4,115	249,327.85	0.08
293	688066	航天宏图	7,600	247,456.00	0.08
294	688365	光云科技	14,467	244,058.29	0.08
295	688707	振华新材	17,545	242,998.25	0.08
296	688366	昊海生科	5,525	242,547.50	0.07
297	688697	纽威数控	15,600	239,928.00	0.07
298	688639	华恒生物	7,300	237,834.00	0.07
299	688219	会通股份	18,975	235,669.50	0.07
300	688601	力芯微	5,500	234,245.00	0.07
301	688176	亚虹医药	20,346	234,182.46	0.07
302	688277	天智航	15,415	234,153.85	0.07
303	688311	盟升电子	5,116	233,289.60	0.07
304	688168	安博通	3,100	232,996.00	0.07
305	688399	硕世生物	3,400	232,900.00	0.07
306	688119	中钢洛耐	41,526	232,130.34	0.07
307	688488	艾迪药业	14,200	231,886.00	0.07
308	688418	震有科技	5,300	230,444.00	0.07

309	688293	奥浦迈	4,700	230,300.00	0.07
310	688151	华强科技	11,165	230,222.30	0.07
311	688550	瑞联新材	5,078	230,084.18	0.07
312	688710	益诺思	5,200	229,580.00	0.07
313	688282	理工导航	3,600	228,600.00	0.07
314	688212	澳华内镜	5,200	227,292.00	0.07
315	688090	瑞松科技	5,100	226,848.00	0.07
316	688073	毕得医药	3,700	225,885.00	0.07
317	688221	前沿生物	12,501	225,643.05	0.07
318	688623	二元科技	2,400	225,360.00	0.07
319	688020	方邦股份	3,300	224,466.00	0.07
320	688046	药康生物	14,588	224,071.68	0.07
321	688677	海泰新光	5,175	223,353.00	0.07
322	688682	霍莱沃	4,200	222,222.00	0.07
323	688636	智明达	5,100	218,484.00	0.07
324	688269	凯立新材	5,400	216,054.00	0.07
325	688023	安恒信息	4,200	215,922.00	0.07
326	688489	三未信安	4,700	214,837.00	0.07
327	688191	智洋创新	6,600	212,388.00	0.07
328	688173	希荻微	14,441	212,282.70	0.07
329	688505	复旦张江	25,543	212,006.90	0.07
330	688716	中研股份	5,000	211,750.00	0.07
331	688606	奥泰生物	3,300	210,837.00	0.07
332	688378	奥来德	7,699	210,182.70	0.06
333	688625	呈和科技	5,100	210,120.00	0.06
334	688665	四方光电	4,300	209,711.00	0.06
335	688719	爱科赛博	4,700	207,505.00	0.06
336	688371	菲沃泰	11,185	206,586.95	0.06
337	688039	当虹科技	4,600	205,850.00	0.06
338	688356	键凯科技	2,500	205,500.00	0.06
339	688085	三友医疗	11,398	205,391.96	0.06
340	688581	安杰思	3,500	205,205.00	0.06
341	688226	威腾电气	5,500	204,050.00	0.06
342	688500	慧辰股份	3,300	203,808.00	0.06
343	688379	华光新材	3,700	203,722.00	0.06
344	688283	坤恒顺维	5,000	201,500.00	0.06
345	688075	安旭生物	5,200	201,084.00	0.06
346	688480	赛恩斯	3,900	200,811.00	0.06
347	688622	禾信仪器	1,982	200,439.66	0.06
348	688070	纵横股份	3,600	199,440.00	0.06
349	688510	航亚科技	7,400	199,060.00	0.06
350	688330	宏力达	5,500	198,715.00	0.06
351	688663	新风光	5,100	197,727.00	0.06
352	688286	敏芯股份	2,500	197,375.00	0.06

353	688236	春立医疗	8,622	197,271.36	0.06
354	688302	海创药业	4,000	196,680.00	0.06
355	688337	普源精电	5,300	195,517.00	0.06
356	688237	超卓航科	4,000	195,000.00	0.06
357	688478	晶升股份	5,200	194,532.00	0.06
358	688458	美芯晟	4,900	194,236.00	0.06
359	688320	禾川科技	5,200	194,064.00	0.06
360	688580	伟思医疗	4,000	193,600.00	0.06
361	688117	圣诺生物	5,100	192,729.00	0.06
362	688767	博拓生物	5,100	192,678.00	0.06
363	688112	鼎阳科技	5,137	192,380.65	0.06
364	688259	创耀科技	4,600	192,280.00	0.06
365	688699	明微电子	4,500	191,295.00	0.06
366	688389	普门科技	14,681	190,559.38	0.06
367	688588	凌志软件	13,300	190,323.00	0.06
368	688377	迪威尔	5,166	189,592.20	0.06
369	688334	西高院	9,743	188,624.48	0.06
370	688215	瑞晟智能	2,600	188,526.00	0.06
371	688609	九联科技	18,359	187,445.39	0.06
372	688416	恒烁股份	3,400	187,442.00	0.06
373	688512	慧智微	16,788	187,354.08	0.06
374	688280	精进电动	21,528	187,293.60	0.06
375	688315	诺禾致源	14,000	185,920.00	0.06
376	688231	隆达股份	7,119	185,094.00	0.06
377	688157	松井股份	5,100	184,773.00	0.06
378	688662	富信科技	3,600	184,500.00	0.06
379	688159	有方科技	3,800	183,692.00	0.06
380	688678	福立旺	7,500	181,350.00	0.06
381	688291	金橙子	4,200	179,424.00	0.06
382	688711	宏微科技	5,637	178,862.01	0.06
383	688197	首药控股	5,100	177,174.00	0.05
384	688115	思林杰	2,700	177,066.00	0.05
385	688186	广大特材	7,800	176,904.00	0.05
386	688136	科兴制药	5,533	175,230.11	0.05
387	688429	时创能源	13,376	175,091.84	0.05
388	688273	麦澜德	4,100	174,332.00	0.05
389	688653	康希通信	14,300	173,745.00	0.05
390	688610	埃科光电	2,800	173,068.00	0.05
391	688381	帝奥微	7,500	171,075.00	0.05
392	688101	三达膜	10,400	170,976.00	0.05
393	688175	高凌信息	5,300	170,713.00	0.05
394	688428	诺诚健华	8,289	170,090.28	0.05
395	688312	燕麦科技	5,112	169,616.16	0.05
396	688152	麒麟信安	4,200	169,470.00	0.05

397	688162	巨一科技	5,500	169,400.00	0.05
398	688768	容知日新	3,874	168,286.56	0.05
399	688595	芯海科技	5,100	167,280.00	0.05
400	688598	金博股份	5,670	166,471.20	0.05
401	688211	中科微至	5,400	166,320.00	0.05
402	688080	映翰通	3,269	165,084.50	0.05
403	688255	凯尔达	4,500	164,835.00	0.05
404	688181	八亿时空	5,100	164,832.00	0.05
405	688308	欧科亿	5,200	164,528.00	0.05
406	688557	兰剑智能	4,500	163,935.00	0.05
407	688061	灿瑞科技	5,000	163,050.00	0.05
408	688010	福光股份	5,200	161,824.00	0.05
409	688033	天宜新材	21,000	161,700.00	0.05
410	688683	莱尔科技	5,100	161,670.00	0.05
411	688360	德马科技	7,600	161,576.00	0.05
412	688459	哈铁科技	16,626	160,440.90	0.05
413	688087	英科再生	5,200	160,264.00	0.05
414	688435	英方软件	3,400	159,018.00	0.05
415	688013	天臣医疗	3,300	158,664.00	0.05
416	688171	纬德信息	3,400	158,644.00	0.05
417	688509	正元地信	28,851	158,391.99	0.05
418	688253	英诺特	5,200	156,936.00	0.05
419	688602	康鹏科技	17,972	155,996.96	0.05
420	688590	新致软件	8,350	155,811.00	0.05
421	688307	中润光学	3,600	155,556.00	0.05
422	688620	安凯微	12,900	155,316.00	0.05
423	688566	吉贝尔	5,200	155,220.00	0.05
424	688579	山大地纬	14,367	154,876.26	0.05
425	688533	上声电子	5,283	154,474.92	0.05
426	688148	芳源股份	17,602	154,369.54	0.05
427	688607	康众医疗	3,600	154,080.00	0.05
428	688558	国盛智科	5,259	152,142.87	0.05
429	688247	宣泰医药	15,681	152,105.70	0.05
430	688079	美迪凯	13,400	151,688.00	0.05
431	688081	兴图新科	4,200	151,536.00	0.05
432	688410	山外山	10,106	151,286.82	0.05
433	688733	壹石通	5,200	150,696.00	0.05
434	688689	银河微电	5,292	150,186.96	0.05
435	688339	亿华通	5,517	148,738.32	0.05
436	688238	和元生物	22,327	148,697.82	0.05
437	688667	菱电电控	2,100	147,882.00	0.05
438	688170	德龙激光	4,700	147,862.00	0.05
439	688292	浩瀚深度	5,084	147,436.00	0.05
440	688628	优利德	4,600	146,464.00	0.05

441	688299	长阳科技	8,600	145,512.00	0.04
442	688267	中触媒	5,134	144,624.78	0.04
443	688135	利扬芯片	5,200	144,352.00	0.04
444	688260	昀冢科技	5,000	144,000.00	0.04
445	688786	悦安新材	5,100	143,871.00	0.04
446	688657	浩辰软件	2,700	143,667.00	0.04
447	688679	通源环境	5,400	143,640.00	0.04
448	688077	大地熊	4,700	143,585.00	0.04
449	688201	信安世纪	9,700	141,911.00	0.04
450	688419	耐科装备	5,050	141,349.50	0.04
451	688448	磁谷科技	2,900	140,563.00	0.04
452	688600	皖仪科技	5,500	137,775.00	0.04
453	688335	复洁科技	5,101	137,522.96	0.04
454	688651	盛邦安全	3,100	136,462.00	0.04
455	688592	司南导航	3,300	135,630.00	0.04
456	688357	建龙微纳	4,100	135,505.00	0.04
457	688358	祥生医疗	4,500	135,450.00	0.04
458	688501	青达环保	5,100	134,793.00	0.04
459	688373	盟科药业	22,294	134,655.76	0.04
460	688370	丛麟科技	5,500	134,035.00	0.04
461	688722	同益中	6,814	133,213.70	0.04
462	688391	钜泉科技	4,700	133,151.00	0.04
463	688369	致远互联	5,200	132,236.00	0.04
464	688265	南模生物	3,200	131,232.00	0.04
465	688680	海优新材	3,400	130,050.00	0.04
466	688179	阿拉丁	10,411	130,033.39	0.04
467	688551	科威尔	3,500	128,905.00	0.04
468	688298	东方生物	5,500	128,865.00	0.04
469	688350	富淼科技	5,000	128,650.00	0.04
470	688687	凯因科技	5,158	128,537.36	0.04
471	688345	博力威	4,100	127,920.00	0.04
472	688244	永信至诚	5,200	127,088.00	0.04
473	688051	佳华科技	3,200	126,752.00	0.04
474	688207	格灵深瞳	8,229	125,080.80	0.04
475	688199	久日新材	5,290	124,685.30	0.04
476	688314	康拓医疗	3,766	124,503.96	0.04
477	688045	必易微	3,200	123,808.00	0.04
478	688246	嘉和美康	5,259	122,271.75	0.04
479	688098	申联生物	13,700	121,656.00	0.04
480	688633	星球石墨	5,107	120,933.76	0.04
481	688251	井松智能	4,100	120,540.00	0.04
482	688316	青云科技	2,000	120,340.00	0.04
483	688618	三旺通信	4,500	119,970.00	0.04
484	688576	西山科技	1,900	119,624.00	0.04

485	688569	铁科轨道	5,406	118,769.82	0.04
486	688089	嘉必优	5,093	118,565.04	0.04
487	688589	力合微	5,204	118,391.00	0.04
488	688323	瑞华泰	5,200	117,052.00	0.04
489	688060	云涌科技	2,755	116,619.15	0.04
490	688015	交控科技	5,105	116,291.90	0.04
491	688669	聚石化学	5,000	116,200.00	0.04
492	688137	近岸蛋白	2,900	116,145.00	0.04
493	688071	华依科技	3,500	116,095.00	0.04
494	688229	博睿数据	1,800	112,824.00	0.03
495	688133	泰坦科技	5,092	112,736.88	0.03
496	688693	锆威特	3,000	112,320.00	0.03
497	688218	江苏北人	4,900	111,818.00	0.03
498	688613	奥精医疗	5,500	111,705.00	0.03
499	688338	赛科希德	4,300	111,284.00	0.03
500	688328	深科达	3,800	110,884.00	0.03
501	688057	金达莱	9,036	110,419.92	0.03
502	688288	鸿泉技术	4,100	109,921.00	0.03
503	688426	康为世纪	4,600	109,618.00	0.03
504	688367	工大高科	3,500	108,360.00	0.03
505	688468	科美诊断	14,680	107,751.20	0.03
506	688737	中自科技	4,800	107,712.00	0.03
507	688216	气派科技	4,800	106,944.00	0.03
508	688317	之江生物	5,300	106,901.00	0.03
509	688571	杭华股份	14,335	106,795.75	0.03
510	688285	高铁电气	12,263	106,442.84	0.03
511	688069	德林海	4,700	105,421.00	0.03
512	688130	晶华微	5,000	104,700.00	0.03
513	688113	联测科技	2,600	102,778.00	0.03
514	688455	科捷智能	5,100	102,459.00	0.03
515	688272	富吉瑞	3,100	101,246.00	0.03
516	688670	金迪克	5,000	101,150.00	0.03
517	688129	东来技术	4,900	99,127.00	0.03
518	688030	山石网科	5,400	98,118.00	0.03
519	688163	赛伦生物	4,500	97,965.00	0.03
520	688479	友车科技	5,200	97,916.00	0.03
521	688118	普元信息	3,800	96,976.00	0.03
522	688695	中创股份	3,500	96,005.00	0.03
523	688529	豪森智能	5,200	95,888.00	0.03
524	688132	邦彦技术	5,200	95,784.00	0.03
525	688056	莱伯泰科	2,800	94,108.00	0.03
526	688655	迅捷兴	5,400	92,502.00	0.03
527	688393	安必平	3,900	92,391.00	0.03
528	688496	清越科技	15,466	91,868.04	0.03

529	688573	信宇人	4,000	91,160.00	0.03
530	688485	九州一轨	5,100	90,984.00	0.03
531	688355	明志科技	5,000	89,000.00	0.03
532	688026	洁特生物	5,500	88,605.00	0.03
533	688420	美腾科技	3,700	88,319.00	0.03
534	688597	煜邦电力	10,713	87,953.73	0.03
535	688395	正弦电气	3,600	87,552.00	0.03
536	688058	宝兰德	3,200	87,136.00	0.03
537	688178	万德斯	3,600	86,508.00	0.03
538	688398	赛特新材	5,087	86,479.00	0.03
539	688517	金冠电气	5,500	85,745.00	0.03
540	688530	欧莱新材	5,200	85,488.00	0.03
541	688092	爱科科技	3,400	85,476.00	0.03
542	688638	誉辰智能	2,300	83,559.00	0.03
543	688038	中科通达	4,700	83,049.00	0.03
544	688560	明冠新材	5,800	82,882.00	0.03
545	688078	龙软科技	3,000	82,500.00	0.03
546	688466	金科环境	5,000	81,350.00	0.03
547	688310	迈得医疗	5,200	79,716.00	0.02
548	688309	恒誉环保	3,300	79,629.00	0.02
549	688671	碧兴物联	3,200	79,264.00	0.02
550	688793	倍轻松	3,600	78,480.00	0.02
551	688022	瀚川智能	5,101	78,045.30	0.02
552	688193	仁度生物	1,600	77,392.00	0.02
553	688004	博汇科技	3,300	76,329.00	0.02
554	688450	光格科技	2,700	74,466.00	0.02
555	688681	科汇股份	4,200	73,836.00	0.02
556	688619	罗普特	5,100	69,360.00	0.02
557	688121	卓然股份	6,300	68,796.00	0.02
558	688718	唯赛勃	5,250	68,670.00	0.02
559	688329	艾隆科技	3,200	68,128.00	0.02
560	688203	海正生材	5,200	66,456.00	0.02
561	688067	爱威科技	2,700	66,312.00	0.02
562	688156	路德科技	4,100	65,641.00	0.02
563	688616	西力科技	5,200	63,596.00	0.02
564	688189	南新制药	7,900	62,963.00	0.02
565	688217	睿昂基因	2,300	60,605.00	0.02
566	688296	和达科技	4,500	59,625.00	0.02
567	688565	力源科技	5,100	57,069.00	0.02
568	688021	奥福科技	3,100	56,885.00	0.02
569	688528	秦川物联	5,100	54,927.00	0.02
570	688096	京源环保	6,200	48,980.00	0.02
571	688659	元琛科技	5,100	48,195.00	0.01
572	688701	卓锦股份	5,200	42,380.00	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
2	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
3	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
4	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
5	603092	德力佳	106	5,899.96	0.00
6	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
7	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
8	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
9	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	688256	寒武纪	79,737,055.35	24.64
2	688041	海光信息	76,625,753.18	23.67
3	688981	中芯国际	43,961,719.41	13.58
4	688111	金山办公	43,261,562.82	13.37
5	688012	中微公司	27,354,124.82	8.45
6	688036	传音控股	25,990,995.68	8.03
7	688271	联影医疗	25,840,640.35	7.98
8	688008	澜起科技	25,595,647.78	7.91
9	688506	百利天恒	22,444,239.16	6.93
10	688249	晶合集成	16,293,584.37	5.03
11	688777	中控技术	15,889,893.82	4.91
12	688469	芯联集成	15,445,628.09	4.77
13	688235	百济神州	15,313,837.67	4.73
14	688169	石头科技	14,632,643.55	4.52
15	688220	翱捷科技	14,151,592.04	4.37
16	688538	和辉光电	14,116,470.64	4.36
17	688223	晶科能源	12,910,119.27	3.99
18	688188	柏楚电子	12,837,209.54	3.97
19	688617	惠泰医疗	12,792,622.34	3.95
20	689009	九号公司	12,659,025.95	3.91

21	688266	泽璟制药	12,353,750.34	3.82
22	688120	华海清科	12,233,951.90	3.78
23	688114	华大智造	12,187,187.35	3.77
24	688009	中国通号	11,644,591.69	3.60
25	688303	大全能源	11,391,280.60	3.52
26	688082	盛美上海	11,295,753.28	3.49
27	688396	华润微	11,150,910.46	3.45
28	688278	特宝生物	11,071,569.94	3.42
29	688019	安集科技	11,071,246.49	3.42
30	688686	奥普特	10,939,288.79	3.38
31	688608	恒玄科技	10,813,705.77	3.34
32	688029	南微医学	10,785,950.03	3.33
33	688065	凯赛生物	10,675,410.44	3.30
34	688578	艾力斯	10,635,696.54	3.29
35	688475	萤石网络	10,414,620.04	3.22
36	688522	纳睿雷达	10,166,189.17	3.14
37	688582	芯动联科	10,143,581.66	3.13
38	688072	拓荆科技	10,078,441.40	3.11
39	688562	航天软件	9,916,936.09	3.06
40	688005	容百科技	9,808,381.94	3.03
41	688192	迪哲医药	9,441,888.59	2.92
42	688739	成大生物	9,363,361.36	2.89
43	688521	芯原股份	9,277,296.92	2.87
44	688128	中国电研	9,026,622.66	2.79
45	688047	龙芯中科	9,016,812.26	2.79
46	688361	中科飞测	8,980,834.63	2.77
47	688599	天合光能	8,952,434.60	2.77
48	688702	盛科通信	8,894,837.75	2.75
49	688126	沪硅产业	8,675,044.35	2.68
50	688472	阿特斯	8,668,687.69	2.68
51	688728	格科微	8,550,497.42	2.64
52	688711	宏微科技	8,193,068.35	2.53
53	688568	中科星图	8,165,750.62	2.52
54	688248	南网科技	8,025,719.18	2.48
55	688375	国博电子	8,020,293.44	2.48
56	688280	精进电动	7,998,547.71	2.47
57	688099	晶晨股份	7,979,081.99	2.47
58	688425	铁建重工	7,934,471.75	2.45
59	688333	铂力特	7,588,609.84	2.34
60	688697	纽威数控	7,531,116.11	2.33
61	688239	航宇科技	7,508,521.84	2.32
62	688185	康希诺	7,488,162.73	2.31
63	688315	诺禾致源	7,473,551.21	2.31
64	688349	三一重能	7,364,739.23	2.28

65	688213	思特威	7,353,823.00	2.27
66	688063	派能科技	7,340,906.47	2.27
67	688202	美迪西	7,308,353.47	2.26
68	688343	云天励飞	7,305,703.18	2.26
69	688798	艾为电子	7,296,070.88	2.25
70	688322	奥比中光	7,273,091.49	2.25
71	688055	龙腾光电	7,241,917.94	2.24
72	688166	博瑞医药	7,196,110.15	2.22
73	688525	佰维存储	7,185,582.28	2.22
74	688208	道通科技	7,151,737.18	2.21
75	688772	珠海冠宇	7,140,997.34	2.21
76	688165	埃夫特	7,138,544.09	2.21
77	688819	天能股份	7,107,242.30	2.20
78	688017	绿的谐波	7,080,124.47	2.19
79	688408	中信博	6,995,356.83	2.16
80	688776	国光电气	6,967,995.03	2.15
81	688148	芳源股份	6,942,399.80	2.14
82	688468	科美诊断	6,925,232.89	2.14
83	688234	天岳先进	6,908,859.98	2.13
84	688200	华峰测控	6,888,265.86	2.13
85	688685	迈信林	6,797,642.08	2.10
86	688089	嘉必优	6,792,429.93	2.10
87	688122	西部超导	6,667,876.03	2.06
88	688331	荣昌生物	6,661,342.79	2.06
89	688002	睿创微纳	6,617,082.41	2.04
90	688095	福昕软件	6,590,549.90	2.04
91	688246	嘉和美康	6,574,138.66	2.03

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	688585	上纬新材	15,680,063.35	4.84
2	688005	容百科技	7,398,776.57	2.29
3	688686	奥普特	7,207,153.36	2.23
4	688498	源杰科技	6,900,167.16	2.13
5	688776	国光电气	6,652,173.51	2.06
6	688552	航天南湖	6,603,607.49	2.04
7	688148	芳源股份	6,285,122.93	1.94
8	688331	荣昌生物	6,019,978.28	1.86

9	688171	纬德信息	5,571,238.21	1.72
10	688248	南网科技	5,527,160.98	1.71
11	688711	宏微科技	5,321,946.42	1.64
12	688202	美迪西	5,224,070.10	1.61
13	688648	中邮科技	4,962,049.76	1.53
14	688239	航宇科技	4,934,312.22	1.52
15	688199	久日新材	4,933,817.92	1.52
16	688111	金山办公	4,920,616.69	1.52
17	688359	三孚新科	4,884,470.42	1.51
18	688151	华强科技	4,872,771.39	1.51
19	688027	国盾量子	4,839,219.27	1.50
20	688522	纳睿雷达	4,815,561.81	1.49

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

买入股票的成本（成交）总额	2,200,872,551.26
卖出股票的收入（成交）总额	684,185,864.03

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）	64,000.98	0.02
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	64,000.98	0.02

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	640	64,000.98	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

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未发现存在被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.4.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	6,776,819.28	2.09	重大事项

8.12.4.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603418	友升股份	8,209.34	0.00	新股锁定
2	603175	超颖电子	8,206.64	0.00	新股锁定
3	601026	道生天合	6,440.28	0.00	新股锁定
4	603406	天富龙	6,144.48	0.00	新股锁定
5	603092	德力佳	5,899.96	0.00	新股锁定

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		科创板综指数联接	
		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
2,473	98,515.57	51,090,953.00	20.97%	172,379,300.00	70.75%	20,158,747.00	8.27%

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	严建亚	10,006,000.00	4.11%
2	招商证券股份有限公司	7,616,981.00	3.13%
3	财通证券资管—中航信托 中金财富【859】号家族信托—财通证券资管	5,999,000.00	2.46%

	智选 FOF16 号		
4	王锦华	5,000,000.00	2.05%
5	中国国际金融股份有限公司	4,908,187.00	2.01%
6	中信建投证券股份有限公司	4,149,378.00	1.70%
7	申万宏源证券有限公司	3,391,131.00	1.39%
8	交银国际信托有限公司—交银国 信 蓝色宝鼎 5 号集合资金信托计划	3,100,000.00	1.27%
9	林琴怡	3,000,000.00	1.23%
10	中荷人寿保险有限公司	3,000,000.00	1.23%
-	国泰上证科创板综合交易型开放式 指数证券投资基金发起式联接基金	20,158,747.00	8.27%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

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	10,000.00	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 3 月 4 日)基金份额总额	1,503,629,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,085,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,345,000,000.00
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	243,629,000.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 5 月 30 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第三十六次会议审议通过，刘国华女士离任公司督察长，公司总经理李昇代任督察长。

2025 年 12 月 2 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第三十九次会议审议通过，倪莹女士离任公司首席信息官，转任公司督察长。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效之日起聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 48,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	国泰基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 5 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
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	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
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）	公司已采取完善管控机制、加强管理等整改措施，现已完成整改，并经中国证监会上海监管局验收通过。
其他	无

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人无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

本报告期内基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理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	
国泰海通	3	2,884,776,553.98	100.00%	505,322.66	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- (1) 实力雄厚、信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- (3) 具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

(4) 研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内所有席位均为新增。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
国泰海通	64,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰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	《中国证券报》	2025-03-05
2	国泰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与赎回业务的公告	《中国证券报》	2025-03-07
3	国泰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	公司官网	2025-03-07
4	国泰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	《中国证券报》	2025-03-12
5	国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》	2025-04-12
6	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2025-05-30
7	国泰基金管理有限公司关于旗下部分上交所ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2025-11-17
8	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2025-12-02

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰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
- 2、国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所或办公场所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二六年三月三十日