嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放 式指数证券投资基金 2025 年第3季度报告

2025年9月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司基金托管人:华泰证券股份有限公司报告送出日期:2025年10月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实上证科创板综合增强策略 ETF
场内简称	科综增强(扩位证券简称:科创综指增强 ETF)
基金主代码	588670
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025年6月5日
报告期末基金份额总额	71, 792, 000. 00 份
投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数,实现基金资产的长期增值。本基金力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差不超过 6.5%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略,以上证科创板综合指数为本基金的标的指数,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 具体投资策略包括:股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,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。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司

基金托管人

华泰证券股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2025年7月1日-2025年9月30日)
1. 本期已实现收益	29, 799, 093. 17
2. 本期利润	40, 648, 533. 93
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 4032
4. 期末基金资产净值	107, 112, 941. 02
5. 期末基金份额净值	1. 4920

- 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)上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

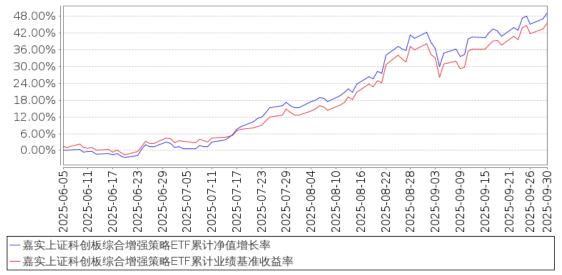
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	44. 88%	1.65%	39. 61%	1.70%	5. 27%	-0. 05%
自基金合同	40. 20%	1 590	4F 70%	1 500	2 50%	0.05%
生效起至今	49. 20%	1. 53%	45. 70%	1.58%	3. 50%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

嘉实上证科创板综合增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走 势对比图

(2025年06月05日至2025年09月30日)



- 注: (1) 本基金合同生效日 2025 年 06 月 05 日至报告期末未满 1 年。
- (2) 按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日6个月为建仓期,本报告期处于建仓期内。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

抽片灯	町 夕	任本基金的基金	金经理期限	证券从业	2H BB
姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
	本嘉科100ETF和第科100ETF新和100E实技的ETF、业策、近至F、业策、证证互际、业策、证证,实现,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明,是证明	日 日	_		2020 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司 指数投资部任研究员。博士研究生, 具有 基金从业资格。中国国籍。

ASOUTT K						T
A50ETF联接、 嘉实生 上证综合 增强						
接、嘉实上证综合的		嘉实中证				
上证综合 增强策略 ETF、嘉实 ETF、高实 国证企流 ETF、高实 国证企流 ETF、高实 中证破型 室济生上证 科创数综合 ETF 联接 家自由现金流 ETF 联接、高自由现金流 ETF 联接、高实由时现金的型型。 在基金是比 阿尔克斯·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里·斯里		A50ETF 联				
增强策率 ETF、嘉实 上证综合 ETF、嘉实 国证金数字 经济ETF、漏实 中证或通 国金数字 经济ETF、 素实上证 科创板综合 合ETF 联接、 嘉实 国证金数字 经济ETF 实上证 科创板点 工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工		接、嘉实				
ETF、嘉实 上证科创 板综合。 ETF、嘉实 电企数字 经济ETF、嘉实 中证级数字 经济ETF、嘉实 自正企取接、高自由现金流 ETF 联接、高少上证 科创能指式数全经球 本基金全 风沉东嘉实 绝对的定期。 定许或是。 经对定规。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个		上证综合				
ETF、嘉实 上证科创 板综合。 ETF、嘉实 电企数字 经济ETF、嘉实 中证级数字 经济ETF、嘉实 自正企取接、高自由现金流 ETF 联接、高少上证 科创能指式数全经球 本基金全 风沉东嘉实 绝对的定期。 定许或是。 经对定规。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个		增强策略				
上证科创 板综合 ETF、嘉实 国证金流 ETF、嘉实 中证金流 ETF、嘉实 中证金数字 经济生TF、高实上证 科创板综合 ETF 联						
板综合 ETF、嘉实 国证完 嘉实 国证完 嘉实 中证数字 经济 ETF、 嘉实上证 科创板球 合 ETF、嘉实 国证数字 经济 ETF、 嘉实上证 科创板质 工智能指数发金经理 本基金量化 阿尔克索实 绝对收定期 混合、深 多沙指数 一个 12年 一个						
ETF、嘉实 国证自由 现金流 ETF、嘉实上证 科创板综合 ETF 联接 医家实上证 科创板指 数发起式 基金经理 本基金、 高实量化 阿尔·嘉实 绝对收益 策略定期 混合介、嘉实 绝对收益 策略定期 混合介、嘉实 绝对的指数 可究增 强、流 实实)的指数 可究增 强、高实 中证 500 指数增 强、高实量化 阿尔第安 强、高级基础。 是2025 年 6 月 5 日						
国证自由 现金流 ETF、嘉实 中证诚通 国企数字 经济ETF、 嘉实上证 科创板综 合 ETF 联接、 嘉实 国证自由 现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实全伦对收益 策略方、嘉实 绝对收益 资格。						
现金流 ETF、嘉实 中证诚通 国企数字 经济ETF、嘉实上证 科创板综 合ETF 联 接、嘉实 国证自由 现金流 ETF 联接、嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 "绝对收益 强格"。 家实沪深 龙昌伦 研究增 强、嘉实 中证500 指数。嘉实 中证500 指数。嘉实 量化精选 股票、嘉						
ETF、嘉实 中证被通 国企数字 经济 ETF、 嘉实上证 科创板综 合 ETF 联接 、嘉实 国证自由 现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、高。实 作对完增 强、高实 中证500 指数增 强、嘉实 中证500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
中证诚通 国企数字 经济ETF、 嘉实上证 科创板约 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金 高、实量化 阿尔法混合、 高实 绝对收益 策略定期 混合、 嘉实 绝对收益 策略定期 混合、 高实 绝对的指数 研究增 强、 嘉实 中证 500 指数增 强、 嘉实 量化精选 股票、 嘉						
国企数字 经济 ETF、 嘉实上证 科创板综合 ETF 联接、 嘉实 国证金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指数发起式 基金经型 本基金、 嘉实量化 阿尔法混合、 嘉实						
经济 ETF、 嘉实上证 科创板综 合 ETF 联 接、嘉实 国证自由 现金旅 医TF 联接、 嘉实自板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、 家文沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、高实 量化精选 股票、						
嘉实上证 科创板综 合 ETF 联 接、嘉实 国证自由 现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、高实 绝对收益 策略定期 混合介。 300 指数 研究增 强、嘉实 上证 12 年						
科创板综合 ETF 联接、嘉实国证自由现金流 ETF 联接、嘉实上证 科创板人工智能指数发起式基金经理 本基金、嘉实量化 阿尔法混合、嘉实绝外收益 策略定期 混合、嘉实沪深 约 12 年 曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部,从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于 股票投研体系。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。						
合 ETF 联接、嘉实国证自由现金流 ETF 联接、嘉实上证料创板人工智能指数发起式基金经理 本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实中深 300 指数 研究增强、嘉实中证 500 指数增强、嘉实量化研究 工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于股票投研体系。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。						
接、嘉实 国证自由 现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
国证自由 现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 产产深 300 指数 研究增强、嘉实 中证 500 指数增强、嘉实 量化精选 股票、嘉		合 ETF 联				
现金流 ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
ETF 联接、 嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉		国证自由				
嘉实上证 科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉		现金流				
科创板人 工智能指 数发起式 基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混 合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉		ETF联接、				
工智能指数发起式基金经理 本基金、嘉实量化 阿尔法混合、嘉实绝对收益 策略定期 混合、嘉实绝对收益 策略定期 混合、嘉实治疗 2025年6月5日 本基金、嘉实产深 2025年6月5日 12年 月加入嘉实基金管理有限责任公司投资管理部,从事量化研究工作。2015年4月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于股票投研体系。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。		嘉实上证				
数发起式 基金经理		科创板人				
数发起式 基金经理		工智能指				
基金经理 本基金、 嘉实量化 阿尔法混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 沙深 300 指数 研究增强、嘉实 中证 500 指数增强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
本基金、 嘉实量化 阿尔法混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉实 字沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
嘉实量化 阿尔法混合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉		+				
阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实沪深 300 指数 研究增强、嘉实中证 500 指数增强、嘉实量化精选股票、嘉						
合、嘉实 绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 龙昌伦 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
绝对收益 策略定期 混合、嘉 实沪深 龙昌伦 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
策略定期 混合、嘉 实沪深 龙昌伦 300 指数 研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
混合、嘉实沪深 龙昌伦 300 指数 研究增 强、嘉实中证 500 指数增 强、嘉实量化精选 股票、嘉						
次目伦 实沪深 2025年6月5日 - 12年 资管理部,从事量化研究工作。2015年4月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于股票投研体系。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。 日 指数增强、嘉实量化精选股票、嘉 量化精选股票、嘉 12年 方面 12年 月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于股票投研体系。硕士研究生,具有基金从业资格。中国国籍。						总 尼丽工社社社人校和 七 四主尼八司机
龙昌伦						
一			2025年6月5			
研究增 强、嘉实 中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉	龙昌伦			_	· -	
中证 500 指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
指数增 强、嘉实 量化精选 股票、嘉						业资格。中国国籍。
强、嘉实 量化精选 股票、嘉						
量化精选 股票、嘉						
股票、嘉		强、嘉实				
		量化精选				
字创业板		股票、嘉				
		实创业板				

增强策略			
ETF、嘉实			
中证1000			
指数增强			
发起式、			
嘉实中证			
A100指数			
增强发起			
式基金经			
理			

注:(1)首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日,此后的非首任基金经理的"任职日期" 指根据公司决定确定的聘任日期;"离任日期"指根据公司决定确定的解聘日期。

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值 (元)	任职时间
	公募基金	9	2, 691, 401, 644. 11	2018年9月12日
龙昌伦	私募资产管 理计划	1	4, 918, 647. 89	2022年7月19日
	其他组合	3	17, 812, 024, 818. 96	2017年3月13日
	合计	13	20, 508, 345, 110. 96	_

注:"任职时间"为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和 公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资 建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、 严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单 边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计1次,为不同基金经理管理的组合间因投资策略不 同而发生的反向交易,未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2025 年第三季度,A股市场呈现典型的慢牛格局,整体呈现单边上行态势,波动率有所下降。 上证综指季度累计上涨 12.73%,市场结构呈现普涨特征,主线集中在AI产业链、反内卷政策受 益板块以及受地缘政治影响的供给收缩领域。市场风格明显偏向成长类资产,在增量资金入场的 推动下,权重资产表现更为突出,科创 50 和创业板指涨幅居前,而防御属性较强的红利资产则表 现相对平淡。

股市的活跃与上行与经济基本面的改善密切相关。投资者普遍认为国内经济已周期性触底,市场走势与多项重要经济数据的回暖相互印证。大宗商品价格回升以及工业企业利润增速改善一一特别是8月工业企业利润增速大幅转正至20.4%,被市场视为积极的经济信号。此外,在反内卷政策持续推动下,工业企业盈利水平预计仍将处于修复通道。另一方面,以AI为代表的新兴产业在资本开支、企业盈利及渗透率等方面持续超预期,推动市场主线从海外算力链向国产算力、消费电子及半导体自主可控等方向扩散。持续的景气轮动和赚钱效应有效提振了市场风险偏好。第三,美联储降息及其进一步宽松的预期,叠加对美元资产的谨慎情绪和地缘政治不确定性,共同促使资金流向新兴市场,为A股和港股带来边际增量资金,也推动了亚太地区多数股市的上涨。

从市场结构看,三季度 A 股的核心特征是成长板块领涨,并展现出较强的动量效应。市场始终围绕几条核心主线轮动,直至季末成交缩量、赚钱效应减弱,主线才逐渐发散。行业表现分化显著:通信、电子、电力设备、有色金属和机械等行业涨幅居前;而银行、交通运输、石油石化、公用事业和食品饮料等行业则相对滞涨。

报告期内,本基金作为一只科创综指增强策略的投资管理产品,我们在组合管理中积极应对基金申购赎回等因素对跟踪效果带来的冲击,力争给投资者提供一个以科创综指为基准的增强策略投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4920 元; 本报告期基金份额净值增长率为 44.88%, 业

绩比较基准收益率为39.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	106, 100, 590. 78	98. 92
	其中: 股票	106, 100, 590. 78	98. 92
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	ı	_
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, 154, 163. 81	1.08
8	其他资产		_
9	合计	107, 254, 754. 59	100.00

注: 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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		_
В	采矿业		_
С	制造业	83, 842, 019. 53	78. 27
D	电力、热力、燃气及水生产和	_	_
D	供应业		
Е	建筑业	-	_
F	批发和零售业	-	_
G	交通运输、仓储和邮政业	-	_
Н	住宿和餐饮业	-	_
т	信息传输、软件和信息技术服	20, 419, 056. 28	19.06
1	务业	20, 413, 030. 20	13.00
J	金融业	_	=
K	房地产业		=

	1		
L	租赁和商务服务业	_	_
M	科学研究和技术服务业	1, 636, 469. 42	1.53
N	水利、环境和公共设施管理业	198, 550. 56	0.19
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	_	-
Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	-	_
S	综合	_	_
	合计	106, 096, 095. 79	99. 05

5.2.2 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	_	_
В	采矿业	_	_
С	制造业	4, 494. 99	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和		
D	供应业	_	_
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	-	_
G	交通运输、仓储和邮政业	-	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
Ι	信息传输、软件和信息技术服		
1	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	-	_
0	居民服务、修理和其他服务业	_	-
Р	教育	-	_
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业	-	=
S	综合	-	=
	合计	4, 494. 99	0.00

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

- 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

	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	27, 364	6, 912, 146. 40	6. 45
2	688256	寒武纪	4,808	6, 370, 600. 00	5. 95
3	688981	中芯国际	25, 529	3, 577, 378. 77	3. 34
4	688008	澜起科技	18, 117	2, 804, 511. 60	2. 62
5	688012	中微公司	7, 531	2, 251, 693. 69	2. 10
6	688271	联影医疗	11,655	1, 768, 063. 50	1.65
7	688122	西部超导	20, 847	1, 356, 931. 23	1. 27
8	688111	金山办公	3, 960	1, 253, 340. 00	1. 17
9	688082	盛美上海	6,049	1, 220, 688. 20	1. 14
10	688126	沪硅产业	46, 505	1, 199, 829. 00	1. 12

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	603418	友升股份	31	1, 741. 89	0.00
2	603406	天富龙	42	1, 542. 24	0.00
3	603370	华新精科	31	1, 210. 86	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述3只积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

- 5.5 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债券投资明细 无。
- 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

- 5.7 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。
- 5.8 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权证投资明细 无。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

- 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

- 5.11 投资组合报告附注
- 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

无。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

- 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净	流通受限情况
万 5	双示石 你	允价值 (元)	值比例(%)	说明	
1	603418	友升股份	1, 741. 89	0.00	新股锁定

2	603406	天富龙	1, 542. 24	0.00	新股锁定
3	603370	华新精科	1, 210. 86	0.00	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	235, 792, 000. 00
报告期期间基金总申购份额	108, 000, 000. 00
减:报告期期间基金总赎回份额	272, 000, 000. 00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	
少以"-"填列)	
报告期期末基金份额总额	71, 792, 000. 00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1)中国证监会准予嘉实上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复文件。
 - (2) 《嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
 - (3)《嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
 - (4) 《嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
 - (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
 - (6)报告期内嘉实上证科创板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

- (1) 书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。
- (2) 网站查询:基金管理人网址: http://www.jsfund.cn 投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话 400-600-8800,或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司 2025年10月28日