

鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券
投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 10 月 28 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	13
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	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	50

8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	67
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	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	70
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	76
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金	
基金简称	鑫元上证科创板综合价格指数增强	
基金主代码	025323	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 28 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	264,001,011.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	鑫元上证科创板综合价格指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025323	025324
报告期末下属分级基金的份额总额	167,099,297.37 份	96,901,713.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理和风险控制，力争实现超越标的指数的业绩表现。
投资策略	本基金投资于股票（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%；建仓期后，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，综合分析比较不同金融资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	上证科创板综合价格指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金如果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。

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	鑫元基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕
	联系电话	021-20892000 转
	电子邮箱	service@xyamc.com
客户服务电话	4006066188	95559

传真	021-20892111	021-62701216
注册地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200070	200336
法定代表人	龙艺	任德奇

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	http://www.xyamc.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

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）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 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 10 月 28 日(基金合同生效日)-2025 年 12 月 31 日	
	鑫元上证科创板综合价格指数 增强 A	鑫元上证科创板综合价格指数 增强 C
本期已实现收益	4,635,744.81	2,495,926.18
本期利润	7,722,631.01	3,925,523.97
加权平均基金份额本期利润	0.0308	0.0276
本期加权平均净值利润率	3.07%	2.74%
本期基金份额净值增长率	3.40%	3.32%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	4,042,915.30	2,273,696.74
期末可供分配基金份额利润	0.0242	0.0235
期末基金资产净值	172,774,424.03	100,121,490.23
期末基金份额净值	1.0340	1.0332
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	3.40%	3.32%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（3）期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（4）本基金合同于 2025 年 10 月 28 日生效，截止 2025 年 12 月 31 日不满一年。

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

鑫元上证科创板综合价格指数增强 A

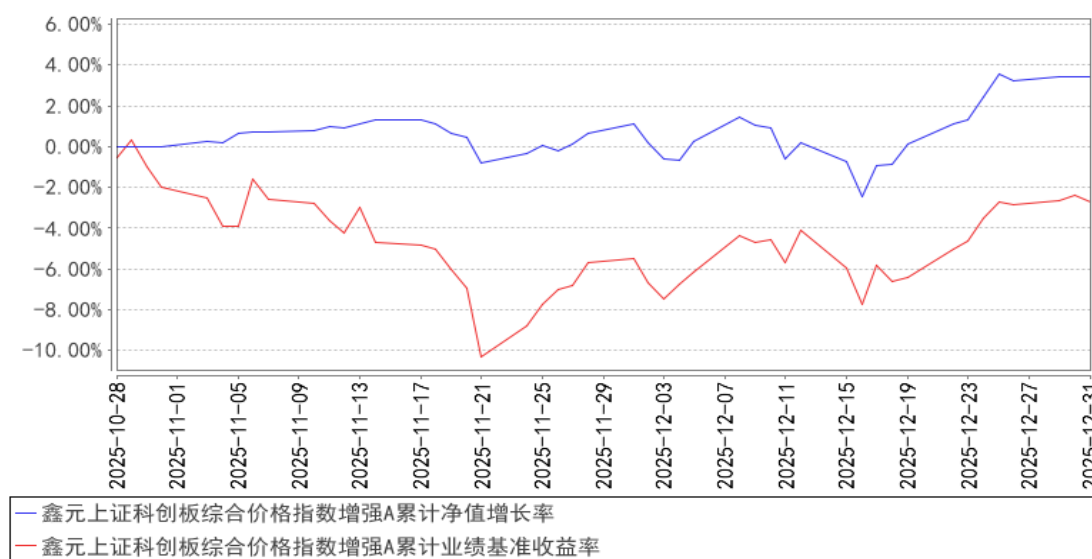
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同生效 起至今	3.40%	0.67%	-2.74%	1.22%	6.14%	-0.55%

鑫元上证科创板综合价格指数增强 C

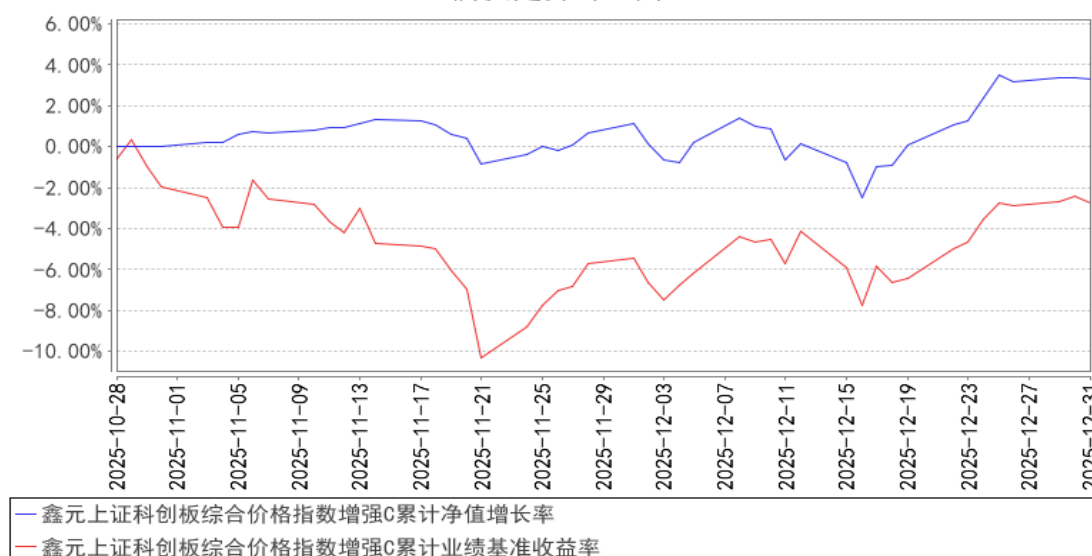
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同生效 起至今	3.32%	0.67%	-2.74%	1.22%	6.06%	-0.55%

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

鑫元上证科创板综合价格指数增强A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



鑫元上证科创板综合价格指数增强C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

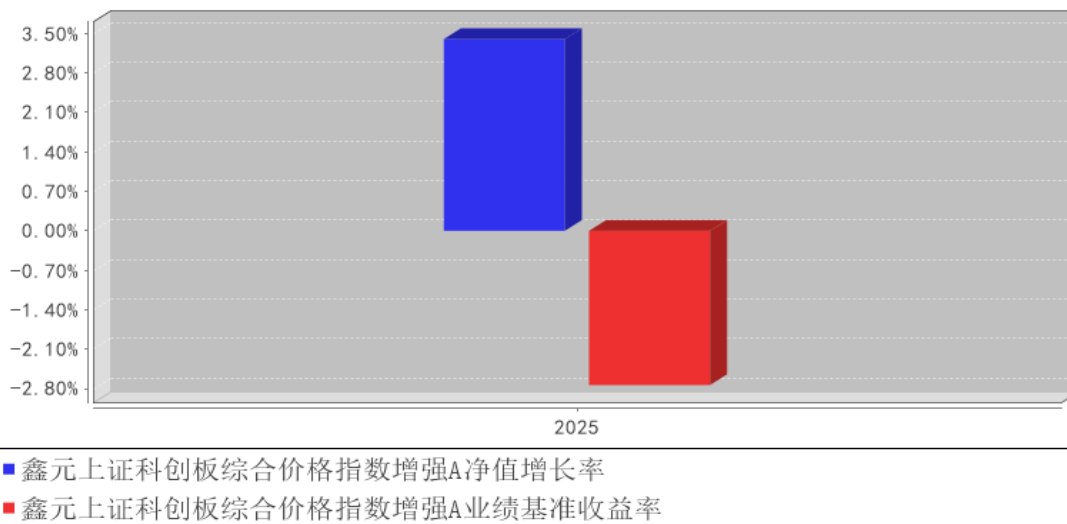


注：本基金的合同生效日为 2025 年 10 月 28 日，截止 2025 年 12 月 31 日不满一年。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期

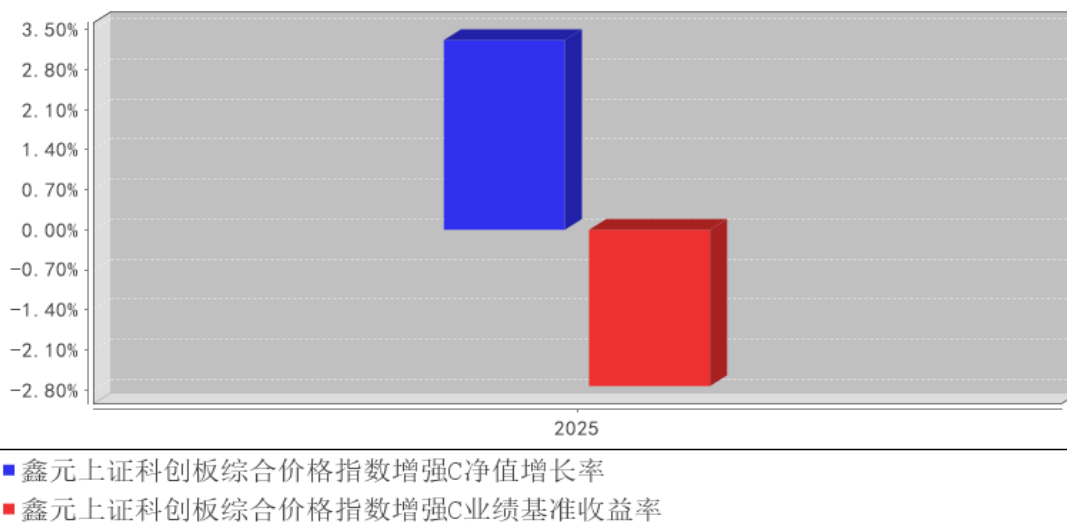
结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

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

鑫元上证科创板综合价格指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鑫元上证科创板综合价格指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，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

注：本基金过去三年未实施利润分配。

§ 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

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115号文批准于2013年8月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。基金管理人管理的公募基金覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、FOF等不同类别。

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		
刘宇涛	本基金的基金经理	2025年10月28日	-	10年	学历：工学博士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021年6月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元中证1000指数增强型发起式证券投资基金、鑫元国证2000指数增强型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利50指数型证券投资基金、鑫元中证800红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、鑫元中证A100指数型证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元创业板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元中证800自由现金流指数型证券投资基金、鑫元诚鑫添益债券型证券投资基金、鑫元锦鑫回报混合型证券投资基金、鑫元中证800红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的基金

					经理。
肖涵	本基金的基金经理	2025 年 12 月 10 日	-	4 年	学历：金融学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任上海智慧数投科技有限公司量化研究员。2021 年 9 月加入鑫元基金，历任研究员、交易员、投资经理助理，现任基金经理。现任鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金、鑫元中证 A100 指数型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金的基金经理。
方仁杰	本基金的基金经理助理	2025 年 10 月 30 日	-	7 年	学历：金融数学与金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任嘉合基金管理有限公司分析师，山西证券股份有限公司研究员，山证（上海）资产管理有限公司研究员。2025 年 1 月加入鑫元基金管理有限公司，现任基金经理助理。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、鑫元中证 A100 指数型证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元创业板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、鑫元诚鑫添益债券型证券投资基金、鑫元锦鑫回报混合型证券投资基金、鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的基金经理助理。

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.1.3 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

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本期报告末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

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

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定并不断完善公司内部关于公平交易管理的各项制度和要求，规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖授权、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，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究工作层面，公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。在投资决策层面，公司执行自上而下的分级投资权限管理体系，依次为投资决策委员会、投资分管领导、投资组合经理，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。投资决策委员会和投资分管领导等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行不合理干预。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行层面，公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。不同投资组合下达同一证券的同向交易指令时，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易部询价机制，严格防范交易对手风险并审查价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易管理的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现违反公平交易要求的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司已制订并不断完善内部异常交易监控管理相关制度，通过系统和人工相结合的方式对基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易共 2 次，均为量化策略投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金属于指数增强型股票基金。投资管理上主要采用量化多因子选股策略，精选一篮子股票组合，持股较为分散。同时，采用量化风险模型合理控制组合风险，控制风格和行业偏离，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。在此基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金股票组合中 80% 以上权重为上证科创综指成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

在报告期内，管理团队在高频和另类数据上投入了大量的精力。一方面，将高频因子低频化，把信息从高频数据中提炼出来，转化为更长周期的因子，以便在更宽的时间范围内进行有效的交易决策。另一方面，通过高频数据对低频因子进行实时监测和调整，更及时的捕捉市场的变化和机会，提高交易策略的灵活性和适应性。

具体到组合操作方面，我们严格按照量化选股模型运作，并不断挖掘表现较好的新因子，持续优化选股模型。后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，配合新股申购、股指期货仓位替代等策略，追求长期稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元上证科创板综合价格指数增强 A 的基金份额净值增长率为 3.40%，同期业绩比较基准收益率为-2.74%。本报告期内鑫元上证科创板综合价格指数增强 C 的基金份额净值增长率为 3.32%，同期业绩比较基准收益率为-2.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场自 2024 年 9 月底以来走过了估值修复和估值扩张两个阶段，沪深 300、中证 500 和中证 1000 等宽基指数市净率已经超过近五年历史分位数 90% 水平，估值进一步扩张的压力增大。

在当前阶段，精选个股的重要性愈发突出，一方面是绝对低估但基本面有所改善的股票，另一方面是估值相对合理但业绩持续且确定性较强的个股，这两类股票将是 2026 年权益市场获取超额收益的关键。

分行业板块来看。科技板块将迎来业绩兑现压力，除了业绩确定性较强的海外算力，国产算力、半导体设备材料、创新药及商业航天等板块若能实现订单加速落地与现金流加速上涨，这些板块有望从主题走向核心资产。周期行业将迎来供需再平衡，在 PPI 温和回升、全球再工业化和供给端持续出清的推动下，铜、铝等关键资源品及化工龙头盈利拐点显现。制造业永远不缺少投资机会，尤其是电力设备和智能汽车相关产业链凭借技术突破与全球竞争力，将成为新质生产力的主阵地。消费板块虽具备防御价值，但整体弹性有限，投资需精耕细作，从估值修复和新消费细分赛道两个角度着手挖掘个股机会。

全年维度看，主题性机会大概会减少，回归盈利本质，聚焦基本面有望是今年投资的主旋律。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在监察稽核工作中一方面将坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；另一方面依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。监察稽核工作致力于保障本基金运作合法合规，切实维护基金份额持有人利益；致力于保障各项法律法规和内部管理制度贯彻执行，推动各项内部控制与风险管理机制的逐步优化与完善，促进公司各项业务合法合规运作。

本报告期内完成的监察稽核工作主要包括：一是密切关注法律法规与监管规范性文件的更新情况，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；三是从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；四是通过外部和内部培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；五是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；六是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。估值委员会对估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理。估值委员会成员具有多年从业经验，具备投资、研究、交易、运营、风险管理、法律合规等方面的专业胜任能力。本公司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；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。公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。截止报告期末，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

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§ 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，基金托管人在鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，鑫元基金管理有限公司在鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70074312_B94 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	鑫元上证科创板综合价格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>我们审计了鑫元上证科创板综合价格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 10 月 28 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，后附的鑫元上证科创板综合价格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，公允反映了鑫元上证科创板综合价格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 10 月 28 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，我们独立于鑫元上证科创板综合价格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	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>鑫元上证科创板综合价格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。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</p>

	<p>报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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，管理层负责评估鑫元上证科创板综合价格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>治理层负责监督鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对鑫元上证科创板综合价格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鑫元上证科创板综合价格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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

注册会计师的姓名	许培菁	李莉
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鑫元上证科创板综合价格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	8,490,177.79
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	270,108,676.44
其中：股票投资		255,878,515.56
基金投资		-
债券投资		14,230,160.88
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	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		102,363.78
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		278,701,218.01
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		5,362,927.20
应付管理人报酬		229,194.46
应付托管费		28,649.29
应付销售服务费		38,532.80
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	7.4.7.9	146,000.00
负债合计		5,805,303.75
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	264,001,011.35
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	8,894,902.91
净资产合计		272,895,914.26
负债和净资产总计		278,701,218.01

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 264,001,011.35 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0340 元，份额总额 167,099,297.37 份；下属 C 类基金份额净值 1.0332 元，份额总额 96,901,713.98 份。

2、本基金合同于 2025 年 10 月 28 日生效。

7.2 利润表

会计主体：鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 10 月 28 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 10 月 28 日（基金合同 生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,517,751.37
1. 利息收入		288,257.14
其中：存款利息收入	7.4.7.13	31,642.76
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		256,614.38
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,712,618.67
其中：股票投资收益	7.4.7.14	7,622,349.19
基金投资收益		-

债券投资收益	7.4.7.15	24,643.70
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	65,625.78
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	4,516,483.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	391.57
减：二、营业总支出		869,596.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	552,731.80
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	69,091.45
3. 销售服务费		100,033.45
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		923.81
8. 其他费用	7.4.7.23	146,815.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,648,154.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,648,154.98
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		11,648,154.98

7.3 净资产变动表

会计主体：鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 10 月 28 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 10 月 28 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	446,207,285.08	-	446,207,285.08
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-182,206,273.73	8,894,902.91	-173,311,370.82

（一）、综合收益总额	-	11,648,154.98	11,648,154.98
（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）	-182,206,273.73	-2,753,252.07	-184,959,525.80
其中：1. 基金申购款	3,339,266.32	36,698.55	3,375,964.87
2. 基金赎回款	-185,545,540.05	-2,789,950.62	-188,335,490.67
（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	264,001,011.35	8,894,902.91	272,895,914.26

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：

<u>于景亮</u>	<u>杨晓宇</u>	<u>包颖</u>
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

鑫元上证科创板综合价格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]1685 号文核准,由鑫元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《鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、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 446,100,809.39 元,已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70074312_B17 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 10 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 446,207,285.08 份基金份额,其中有效认购资金在初始募集期内产生的利息折合 106,475.69 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成

份股及备选成份股（含存托凭证）、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他国内依法发行或上市 的股票（包括科创板、主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、 港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府 债、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、可转换债券（含交易分离可转债）、可交换债券、 短期融资券、超短期融资券等）、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等）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中 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、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（含存托凭证）资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于标的指数成份股及其备选成份股 的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易 日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到 期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金 和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适 当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：上证科创板综合价格 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*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 10 月 28 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。

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，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2025 年 10 月 28 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

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，所有公允价值变动计入当期损益；

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内含票面利率或合同利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形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入金额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定、《基金合同》的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

7.4.4.12 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，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 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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

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‰；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；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 号文《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 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局公告[2025]4 号文《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。

3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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 号文《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。

5、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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》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 号文《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。

6、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 号文《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 号文《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	3,304,585.76
等于：本金	3,302,402.74
加：应计利息	2,183.02
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	5,185,592.03
等于：本金	5,185,357.70
加：应计利息	234.33
减：坏账准备	-
合计	8,490,177.79

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	251,364,469.32	-	255,878,515.56	4,514,046.24
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	14,101,492.25	126,230.88	14,230,160.88	2,437.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,101,492.25	126,230.88	14,230,160.88	2,437.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		265,465,961.57	126,230.88	270,108,676.44	4,516,483.99

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

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 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	146,000.00
合计	146,000.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元上证科创板综合价格指数增强 A		
项目	本期 2025 年 10 月 28 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	276,245,323.46	276,245,323.46
本期申购	331,363.33	331,363.33
本期赎回（以“-”号填列）	-109,477,389.42	-109,477,389.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	167,099,297.37	167,099,297.37

金额单位：人民币元

鑫元上证科创板综合价格指数增强 C		
项目	本期 2025 年 10 月 28 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	169,961,961.62	169,961,961.62

本期申购	3,007,902.99	3,007,902.99
本期赎回（以“-”号填列）	-76,068,150.63	-76,068,150.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	96,901,713.98	96,901,713.98

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2025 年 10 月 28 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 446,100,809.39 元，其中 A 类基金为人民币 276,167,836.76 元，C 类基金为人民币 169,932,972.63 元，在募集期间产生活期存款利息为人民币 106,475.69 元，其中 A 类基金为人民币 77,486.70 元，C 类基金为人民币 28,988.99 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 446,207,285.08 元，折合 446,207,285.08 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鑫元上证科创板综合价格指数增强 A

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	4,635,744.81	3,086,886.20	7,722,631.01
本期基金份额交易产生的变动数	-592,829.51	-1,454,674.84	-2,047,504.35
其中：基金申购款	2,116.17	3,530.76	5,646.93
基金赎回款	-594,945.68	-1,458,205.60	-2,053,151.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,042,915.30	1,632,211.36	5,675,126.66

鑫元上证科创板综合价格指数增强 C

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	2,495,926.18	1,429,597.79	3,925,523.97
本期基金份额交易产生的变动数	-222,229.44	-483,518.28	-705,747.72
其中：基金申购款	13,278.70	17,772.92	31,051.62
基金赎回款	-235,508.14	-501,291.20	-736,799.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,273,696.74	946,079.51	3,219,776.25

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	28,772.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,868.88
结算备付金利息收入	-
其他	1.58
合计	31,642.76

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月28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	7,622,349.19
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	7,622,349.19

7.4.7.14.2 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10月28日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	423,897,793.31
减：卖出股票成本总额	415,791,449.45
减：交易费用	483,994.67
买卖股票差价收入	7,622,349.19

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年10月28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	22,556.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,087.04

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	24,643.70

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月28日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	11,003,146.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,899,481.75
减：应计利息总额	101,541.40
减：交易费用	36.21
买卖债券差价收入	2,087.04

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 10 月 28 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	65,625.78
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	65,625.78

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 10 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,516,483.99
——股票投资	4,514,046.24
——债券投资	2,437.75
——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	4,516,483.99

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 10 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	391.57
合计	391.57

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 10 月 28 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	26,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
开户费	800.00
存托服务费	15.88
合计	146,815.88

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
南京高科股份有限公司（“南京高科”）	基金管理人的股东
上海鑫沅股权投资管理有限公司（“鑫沅股权”）	基金管理人的子公司
鑫沅资产管理有限公司（“鑫沅资产”）	基金管理人的子公司

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

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月28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	552,731.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	267,140.35
应支付基金管理人的净管理费	285,591.45

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年10月28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	69,091.45

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计

提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 10 月 28 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		
	鑫元上证科创板综合 价格指数增强 A	鑫元上证科创板综合 价格指数增强 C	合计
鑫元基金	-	0.11	0.11
南京银行	-	112.01	112.01
交通银行	-	42,884.99	42,884.99
合计	-	42,997.11	42,997.11

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年10月28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
交通银行	3,304,585.76	28,772.30

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：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

注：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年12月19日	重大事项停牌	283.76	2026年1月5日	278.00	13,200	3,529,108.41	3,745,632.00	-

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

注：无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本部门发生风险事件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

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。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，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。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	14,230,160.88
合计	14,230,160.88

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券资产。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

除本报告持有的流通受限证券部分章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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。

本基金开展银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等各类计息业务，因此存在相应的利率风险。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,487,760.44	-	-	-	-	2,417.35	8,490,177.79
交易性金融资产	-	-	14,103,930.00	-	-	256,004,746.44	270,108,676.44
应收申购款	0.00	-	-	-	-	102,363.78	102,363.78

其他资产	0.00	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	8,487,760.44	-14,103,930.00	-	-256,109,527.57	278,701,218.01	
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	5,362,927.20	5,362,927.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	229,194.46	229,194.46
应付托管费	-	-	-	-	28,649.29	28,649.29
应付销售服务费	-	-	-	-	38,532.80	38,532.80
其他负债	-	-	-	-	146,000.00	146,000.00
负债总计	-	-	-	-	5,805,303.75	5,805,303.75
利率敏感度缺口	8,487,760.44	-14,103,930.00	-	-250,304,223.82	272,895,914.26	

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利率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）
	1. 市场利率下降 25 个基点	12,210.84
	2. 市场利率上升 25 个基点	-12,187.43

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。于本报告期末，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关

联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	255,878,515.56	93.76
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	255,878,515.56	93.76

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变 2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变	
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 1%	1,108,933.79
	业绩比较基准下降 1%	-1,108,933.79

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	252,132,883.56
第二层次	17,975,792.88
第三层次	-
合计	270,108,676.44

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

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

注：无。

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

1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

2、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	255,878,515.56	91.81
	其中：股票	255,878,515.56	91.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,230,160.88	5.11
	其中：债券	14,230,160.88	5.11
	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	8,490,177.79	3.05
8	其他各项资产	102,363.78	0.04
9	合计	278,701,218.01	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	150,042,225.31	54.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,824,709.76	12.76
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	2,792,777.49	1.02

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	291,192.00	0.11
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	187,950,904.56	68.87

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	766,800.00	0.28
B	采矿业	-	-
C	制造业	47,046,450.00	17.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,294,552.00	0.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,337,859.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	843,022.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	778,757.00	0.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,081,512.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	5,351,468.00	1.96
N	水利、环境和公共设施管理业	3,091,942.00	1.13
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	2,335,249.00	0.86
S	综合	-	-
	合计	67,927,611.00	24.89

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	8,141	11,035,532.55	4.04
2	688041	海光信息	45,107	10,122,461.87	3.71
3	688981	中芯国际	38,767	4,761,750.61	1.74
4	688012	中微公司	13,200	3,745,632.00	1.37
5	688111	金山办公	9,020	2,769,771.40	1.01
6	688008	澜起科技	22,151	2,609,387.80	0.96
7	688506	百利天恒	8,028	2,593,846.80	0.95
8	688271	联影医疗	16,000	2,008,000.00	0.74
9	688775	影石创新	7,800	1,832,220.00	0.67
10	688072	拓荆科技	5,363	1,769,790.00	0.65
11	688082	盛美上海	9,400	1,654,870.00	0.61
12	688183	生益电子	16,200	1,550,178.00	0.57
13	688036	传音控股	22,371	1,480,065.36	0.54
14	688521	芯原股份	10,279	1,407,914.63	0.52
15	688396	华润微	25,772	1,362,307.92	0.50
16	688126	沪硅产业	62,019	1,342,091.16	0.49
17	688249	晶合集成	38,974	1,293,547.06	0.47
18	688702	盛科通信	7,987	1,131,678.03	0.41
19	688303	大全能源	41,723	1,119,010.86	0.41
20	688110	东芯股份	8,483	1,114,242.05	0.41
21	688223	晶科能源	194,111	1,094,786.04	0.40
22	688469	芯联集成	162,723	1,088,616.87	0.40
23	688375	国博电子	11,600	1,080,076.00	0.40
24	688472	阿特斯	71,505	1,066,139.55	0.39
25	688361	中科飞测	6,816	1,042,779.84	0.38
26	688120	华海清科	6,943	1,042,005.44	0.38
27	688525	佰维存储	9,000	1,033,110.00	0.38
28	688047	龙芯中科	7,800	1,030,458.00	0.38
29	688498	源杰科技	1,600	1,027,184.00	0.38
30	688027	国盾量子	2,000	1,007,580.00	0.37
31	688585	上纬新材	7,800	993,486.00	0.36
32	688122	西部超导	12,600	939,708.00	0.34
33	688568	中科星图	15,724	927,716.00	0.34
34	688578	艾力斯	8,800	916,520.00	0.34
35	688009	中国通号	167,323	915,256.81	0.34
36	688002	睿创微纳	9,000	907,200.00	0.33

37	688629	华丰科技	9,000	900,540.00	0.33
38	688101	三达膜	53,531	880,049.64	0.32
39	688075	安旭生物	22,566	872,627.22	0.32
40	688569	铁科轨道	39,456	866,848.32	0.32
41	688623	二元科技	9,200	863,880.00	0.32
42	688459	哈铁科技	89,312	861,860.80	0.32
43	688187	时代电气	16,800	861,672.00	0.32
44	688347	华虹公司	7,941	856,595.67	0.31
45	688387	信科移动	66,274	854,934.60	0.31
46	688633	星球石墨	35,383	837,869.44	0.31
47	688558	国盛智科	28,915	836,510.95	0.31
48	688358	祥生医疗	27,751	835,305.10	0.31
49	688676	金盘科技	8,892	803,303.28	0.29
50	688172	燕东微	27,681	801,088.14	0.29
51	688313	仕佳光子	9,000	799,020.00	0.29
52	689009	九号公司	14,000	778,260.00	0.29
53	688113	联测科技	19,684	778,108.52	0.29
54	688479	友车科技	41,273	777,170.59	0.28
55	688355	明志科技	43,425	772,965.00	0.28
56	688385	复旦微电	10,400	766,480.00	0.28
57	688517	金冠电气	48,836	761,353.24	0.28
58	688169	石头科技	5,005	761,060.30	0.28
59	688777	中控技术	15,400	759,836.00	0.28
60	688188	柏楚电子	5,573	757,314.97	0.28
61	688728	格科微	50,436	753,513.84	0.28
62	688778	厦钨新能	9,734	753,119.58	0.28
63	688234	天岳先进	8,416	748,014.08	0.27
64	688213	思特威	7,767	738,564.03	0.27
65	688608	恒玄科技	3,200	726,208.00	0.27
66	688336	三生国健	12,057	718,235.49	0.26
67	688099	晶晨股份	8,205	715,722.15	0.26
68	688538	和辉光电	268,025	712,946.50	0.26
69	688599	天合光能	42,275	699,651.25	0.26
70	688065	凯赛生物	14,000	697,200.00	0.26
71	688019	安集科技	3,195	696,254.40	0.26
72	688322	奥比中光	7,757	695,570.19	0.25
73	688017	绿的谐波	3,595	690,599.50	0.25
74	688220	翱捷科技	8,108	669,801.88	0.25
75	688318	财富趋势	5,000	661,600.00	0.24
76	688617	惠泰医疗	2,714	660,234.78	0.24
77	688278	特宝生物	7,822	654,544.96	0.24
78	688615	合合信息	2,800	637,224.00	0.23
79	688297	中无人机	13,000	624,260.00	0.23

80	688819	天能股份	18,786	624,070.92	0.23
81	688333	铂力特	5,400	602,154.00	0.22
82	688349	三一重能	23,711	599,414.08	0.22
83	688235	百济神州	2,200	590,920.00	0.22
84	688102	斯瑞新材	15,000	581,100.00	0.21
85	688037	芯源微	3,874	575,327.74	0.21
86	688692	达梦数据	2,200	574,794.00	0.21
87	688295	中复神鹰	17,400	570,894.00	0.21
88	688709	成都华微	12,400	570,276.00	0.21
89	688147	微导纳米	8,973	563,414.67	0.21
90	688018	乐鑫科技	3,287	558,790.00	0.20
91	688433	华曙高科	8,119	537,234.23	0.20
92	688331	荣昌生物	6,897	536,517.63	0.20
93	688343	云天励飞	7,000	532,560.00	0.20
94	688425	铁建重工	103,422	524,349.54	0.19
95	688582	芯动联科	7,844	518,566.84	0.19
96	688563	航材股份	8,800	514,360.00	0.19
97	688192	迪哲医药	8,852	509,875.20	0.19
98	688180	君实生物	14,800	505,568.00	0.19
99	688270	臻镭科技	4,091	499,388.37	0.18
100	688248	南网科技	11,000	492,140.00	0.18
101	688005	容百科技	13,800	488,520.00	0.18
102	688200	华峰测控	2,565	487,863.00	0.18
103	688114	华大智造	8,000	486,080.00	0.18
104	688708	佳驰科技	7,800	485,550.00	0.18
105	688208	道通科技	13,000	478,400.00	0.18
106	688772	珠海冠宇	21,951	472,605.03	0.17
107	688266	泽璟制药	5,082	471,101.40	0.17
108	688561	奇安信	13,200	469,656.00	0.17
109	688475	萤石网络	15,200	457,672.00	0.17
110	688052	纳芯微	2,800	442,904.00	0.16
111	688195	腾景科技	2,600	440,830.00	0.16
112	688660	电气风电	25,896	440,490.96	0.16
113	688523	航天环宇	7,800	436,488.00	0.16
114	688301	奕瑞科技	4,200	424,662.00	0.16
115	688205	德科立	3,064	421,238.72	0.15
116	688048	长光华芯	3,342	418,919.70	0.15
117	688536	思瑞浦	2,600	415,688.00	0.15
118	688146	中船特气	10,200	412,080.00	0.15
119	688363	华熙生物	9,400	410,592.00	0.15
120	688166	博瑞医药	8,299	407,148.94	0.15
121	688449	联芸科技	9,000	406,620.00	0.15
122	688627	精智达	1,800	402,462.00	0.15

123	688698	伟创电气	4,060	401,452.80	0.15
124	688502	茂莱光学	1,000	399,050.00	0.15
125	688409	富创精密	5,898	397,525.20	0.15
126	688123	聚辰股份	3,158	396,581.64	0.15
127	688281	华秦科技	5,249	387,376.20	0.14
128	688088	虹软科技	7,800	386,100.00	0.14
129	688400	凌云光	9,026	382,521.88	0.14
130	688141	杰华特	8,800	382,184.00	0.14
131	688100	威胜信息	9,600	377,280.00	0.14
132	688520	神州细胞	8,669	375,454.39	0.14
133	688519	南亚新材	4,600	371,956.00	0.14
134	688567	孚能科技	23,725	371,296.25	0.14
135	688548	广钢气体	25,503	370,813.62	0.14
136	688279	峰昭科技	1,778	361,805.22	0.13
137	688766	普冉股份	2,800	356,188.00	0.13
138	688798	艾为电子	4,600	350,106.00	0.13
139	688630	芯碁微装	2,600	349,778.00	0.13
140	688668	鼎通科技	2,800	347,200.00	0.13
141	688006	杭可科技	11,800	345,622.00	0.13
142	688484	南芯科技	8,400	341,544.00	0.13
143	688353	华盛锂电	3,000	341,100.00	0.12
144	688116	天奈科技	7,200	339,480.00	0.12
145	688388	嘉元科技	8,200	336,036.00	0.12
146	688800	瑞可达	4,011	332,913.00	0.12
147	688097	博众精工	8,600	324,650.00	0.12
148	688652	京仪装备	3,247	319,212.57	0.12
149	688332	中科蓝讯	2,400	315,144.00	0.12
150	688167	炬光科技	1,800	315,126.00	0.12
151	688153	唯捷创芯	8,339	313,879.96	0.12
152	688372	伟测科技	2,800	305,452.00	0.11
153	688382	益方生物	11,200	305,088.00	0.11
154	688062	迈威生物	7,834	301,373.98	0.11
155	688131	皓元医药	4,168	300,429.44	0.11
156	688127	蓝特光学	7,800	300,222.00	0.11
157	688432	有研硅	24,123	299,366.43	0.11
158	688390	固德威	4,800	298,224.00	0.11
159	688686	奥普特	2,400	297,912.00	0.11
160	688029	南微医学	3,600	293,616.00	0.11
161	688300	联瑞新材	4,724	293,313.16	0.11
162	688206	概伦电子	8,400	292,572.00	0.11
163	688352	颀中科技	23,134	291,719.74	0.11
164	688068	热景生物	1,800	291,600.00	0.11
165	688327	云从科技	20,156	289,641.72	0.11

166	688584	上海合晶	13,000	285,220.00	0.10
167	688326	经纬恒润	2,400	282,000.00	0.10
168	688789	宏华数科	3,450	281,416.50	0.10
169	688726	拉普拉斯	7,800	280,800.00	0.10
170	688503	聚和材料	4,600	280,600.00	0.10
171	688779	五矿新能	37,350	279,751.50	0.10
172	688198	佰仁医疗	2,600	278,226.00	0.10
173	688306	均普智能	23,737	275,349.20	0.10
174	688160	步科股份	1,800	274,500.00	0.10
175	688516	奥特维	6,034	273,098.84	0.10
176	688063	派能科技	4,800	272,736.00	0.10
177	688228	开普云	1,400	272,454.00	0.10
178	688403	汇成股份	16,582	271,613.16	0.10
179	688612	威迈斯	8,200	270,354.00	0.10
180	688549	中巨芯	28,661	261,388.32	0.10
181	688001	华兴源创	8,595	259,397.10	0.10
182	688362	甬矽电子	8,000	259,280.00	0.10
183	688605	先锋精科	4,000	257,040.00	0.09
184	688025	杰普特	1,800	254,826.00	0.09
185	688031	星环科技	2,345	253,705.55	0.09
186	688543	国科军工	4,076	252,997.32	0.09
187	688380	中微半导	7,800	250,770.00	0.09
188	688158	优刻得	8,883	249,523.47	0.09
189	688392	骄成超声	2,200	246,840.00	0.09
190	688439	振华风光	3,800	245,480.00	0.09
191	688691	灿芯股份	2,400	244,752.00	0.09
192	688239	航宇科技	3,600	243,612.00	0.09
193	688165	埃夫特	10,200	242,352.00	0.09
194	688032	禾迈股份	2,400	241,896.00	0.09
195	688233	神工股份	3,400	238,102.00	0.09
196	688552	航天南湖	6,529	237,133.28	0.09
197	688190	云路股份	2,400	233,760.00	0.09
198	688055	龙腾光电	64,642	232,711.20	0.09
199	688522	纳睿雷达	5,821	232,432.53	0.09
200	688559	海目星	4,800	230,688.00	0.08
201	688321	微芯生物	7,894	230,662.68	0.08
202	688050	爱博医疗	3,800	230,508.00	0.08
203	688182	灿勤科技	7,800	230,256.00	0.08
204	688083	中望软件	3,377	230,007.47	0.08
205	688128	中国电研	7,800	226,824.00	0.08
206	688776	国光电气	2,200	221,628.00	0.08
207	688016	心脉医疗	2,402	220,167.32	0.08
208	688161	威高骨科	7,800	217,776.00	0.08

209	688003	天准科技	3,671	216,221.90	0.08
210	688513	苑东生物	3,512	216,163.60	0.08
211	688125	安达智能	1,600	216,080.00	0.08
212	688351	微电生理	9,213	213,280.95	0.08
213	688107	安路科技	7,844	213,199.92	0.08
214	688577	浙海德曼	2,200	213,092.00	0.08
215	688289	圣湘生物	11,200	211,792.00	0.08
216	688531	日联科技	3,200	211,296.00	0.08
217	688150	莱特光电	7,800	210,834.00	0.08
218	688631	莱斯信息	3,083	209,890.64	0.08
219	688739	成大生物	8,000	206,080.00	0.08
220	688700	东威科技	5,800	204,624.00	0.07
221	688368	晶丰明源	1,771	204,426.53	0.07
222	688109	品茗科技	1,600	203,360.00	0.07
223	688788	科思科技	3,000	202,020.00	0.07
224	688535	华海诚科	1,800	201,744.00	0.07
225	688690	纳微科技	7,800	201,318.00	0.07
226	688591	泰凌微	4,729	201,266.24	0.07
227	688586	江航装备	15,400	200,816.00	0.07
228	688262	国芯科技	6,600	200,310.00	0.07
229	688093	世华科技	5,400	198,990.00	0.07
230	688319	欧林生物	7,800	197,808.00	0.07
231	688658	悦康药业	8,736	197,520.96	0.07
232	688717	艾罗能源	3,200	197,120.00	0.07
233	688139	海尔生物	6,194	196,845.32	0.07
234	688261	东微半导	2,400	196,824.00	0.07
235	688443	智翔金泰	7,201	196,155.24	0.07
236	688028	沃尔德	3,000	193,620.00	0.07
237	688626	翔宇医疗	3,200	193,600.00	0.07
238	688486	龙迅股份	2,600	193,206.00	0.07
239	688091	上海谊众	4,000	188,000.00	0.07
240	688177	百奥泰	8,120	187,896.80	0.07
241	688562	航天软件	7,766	185,452.08	0.07
242	688556	高测股份	16,200	185,004.00	0.07
243	688499	利元亨	3,200	184,704.00	0.07
244	688656	浩欧博	1,200	184,560.00	0.07
245	688106	金宏气体	9,400	184,146.00	0.07
246	688258	卓易信息	2,400	183,768.00	0.07
247	688596	正帆科技	5,800	183,454.00	0.07
248	688222	成都先导	7,800	182,910.00	0.07
249	688401	路维光电	3,739	182,500.59	0.07
250	688539	高华科技	3,686	182,493.86	0.07
251	688593	新相微	9,000	181,620.00	0.07

252	688507	索辰科技	1,800	180,522.00	0.07
253	688408	中信博	4,284	180,399.24	0.07
254	688603	天承科技	2,400	179,904.00	0.07
255	688750	金天钛业	9,000	179,730.00	0.07
256	688275	万润新能	2,372	178,848.80	0.07
257	688049	炬芯科技	3,400	178,840.00	0.07
258	688210	统联精密	3,200	177,024.00	0.06
259	688138	清溢光电	6,097	171,691.52	0.06
260	688252	天德钰	8,000	169,360.00	0.06
261	688209	英集芯	8,390	167,296.60	0.06
262	688007	光峰科技	9,000	167,130.00	0.06
263	688366	昊海生科	3,800	166,820.00	0.06
264	688418	震有科技	3,800	165,224.00	0.06
265	688257	新锐股份	4,800	164,544.00	0.06
266	688066	航天宏图	5,000	162,800.00	0.06
267	688095	福昕软件	1,800	160,686.00	0.06
268	688518	联赢激光	6,600	160,314.00	0.06
269	688648	中邮科技	2,600	159,796.00	0.06
270	688230	芯导科技	2,200	159,456.00	0.06
271	688305	科德数控	2,554	157,837.20	0.06
272	688386	泛亚微透	1,800	157,680.00	0.06
273	688508	芯朋微	2,586	157,487.40	0.06
274	688383	新益昌	2,000	156,540.00	0.06
275	688575	亚辉龙	11,000	156,200.00	0.06
276	688105	诺唯赞	7,800	156,156.00	0.06
277	688639	华恒生物	4,791	156,090.78	0.06
278	688515	裕太微	1,521	155,978.55	0.06
279	688456	有研粉材	2,000	155,400.00	0.06
280	688685	迈信林	2,800	155,344.00	0.06
281	688661	和林微纳	3,000	155,280.00	0.06
282	688570	天玛智控	8,400	154,728.00	0.06
283	688550	瑞联新材	3,400	154,054.00	0.06
284	688108	赛诺医疗	8,000	153,920.00	0.06
285	688232	新点软件	6,200	153,884.00	0.06
286	688611	杭州柯林	3,000	152,550.00	0.06
287	688625	呈和科技	3,698	152,357.60	0.06
288	688696	极米科技	1,362	151,835.76	0.06
289	688225	亚信安全	7,800	151,320.00	0.06
290	688276	百克生物	8,000	150,880.00	0.06
291	688348	昱能科技	2,984	150,363.76	0.06
292	688376	美埃科技	2,600	150,332.00	0.06
293	688191	智洋创新	4,598	147,963.64	0.05
294	688311	盟升电子	3,224	147,014.40	0.05

295	688202	美迪西	2,600	146,640.00	0.05
296	688553	汇宇制药	8,200	145,878.00	0.05
297	688636	智明达	3,400	145,656.00	0.05
298	688155	先惠技术	2,400	145,080.00	0.05
299	688227	品高股份	2,200	143,022.00	0.05
300	688059	华锐精密	1,800	141,660.00	0.05
301	688622	禾信仪器	1,400	141,582.00	0.05
302	688196	卓越新能	2,400	141,360.00	0.05
303	688325	赛微微电	1,600	140,048.00	0.05
304	688365	光云科技	8,200	138,334.00	0.05
305	688377	迪威尔	3,755	137,808.50	0.05
306	688268	华特气体	2,400	137,736.00	0.05
307	688526	科前生物	9,000	137,340.00	0.05
308	688337	普源精电	3,722	137,304.58	0.05
309	688707	振华新材	9,851	136,436.35	0.05
310	688151	华强科技	6,600	136,092.00	0.05
311	688185	康希诺	2,163	135,944.55	0.05
312	688787	海天瑞声	1,172	135,940.28	0.05
313	688621	阳光诺和	2,187	135,922.05	0.05
314	688697	纽威数控	8,800	135,344.00	0.05
315	688510	航亚科技	5,000	134,500.00	0.05
316	688488	艾迪药业	8,200	133,906.00	0.05
317	688277	天智航	8,800	133,672.00	0.05
318	688226	威腾电气	3,600	133,560.00	0.05
319	688711	宏微科技	4,200	133,266.00	0.05
320	688035	德邦科技	2,731	131,770.75	0.05
321	688219	会通股份	10,600	131,652.00	0.05
322	688378	奥来德	4,800	131,040.00	0.05
323	688221	前沿生物	7,215	130,230.75	0.05
324	688359	三孚新科	1,938	129,128.94	0.05
325	688236	春立医疗	5,600	128,128.00	0.05
326	688011	新光光电	2,000	127,680.00	0.05
327	688720	艾森股份	1,800	126,684.00	0.05
328	688136	科兴制药	4,000	126,680.00	0.05
329	688176	亚虹医药	11,000	126,610.00	0.05
330	688231	隆达股份	4,800	124,800.00	0.05
331	688799	华纳药厂	2,600	124,020.00	0.05
332	688710	益诺思	2,800	123,620.00	0.05
333	688046	药康生物	8,000	122,880.00	0.05
334	688678	福立旺	5,073	122,665.14	0.04
335	688290	景业智能	2,063	122,624.72	0.04
336	688186	广大特材	5,400	122,472.00	0.04
337	688119	中钢洛耐	21,747	121,565.73	0.04

338	688721	龙图光罩	2,600	120,978.00	0.04
339	688143	长盈通	2,400	120,504.00	0.04
340	688371	菲沃泰	6,503	120,110.41	0.04
341	688334	西高院	6,200	120,032.00	0.04
342	688112	鼎阳科技	3,200	119,840.00	0.04
343	688173	希荻微	8,035	118,114.50	0.04
344	688598	金博股份	4,000	117,440.00	0.04
345	688087	英科再生	3,800	117,116.00	0.04
346	688084	晶品特装	1,400	115,920.00	0.04
347	688085	三友医疗	6,400	115,328.00	0.04
348	688505	复旦张江	13,800	114,540.00	0.04
349	688282	理工导航	1,800	114,300.00	0.04
350	688212	澳华内镜	2,600	113,646.00	0.04
351	688566	吉贝尔	3,800	113,430.00	0.04
352	688117	圣诺生物	3,000	113,370.00	0.04
353	688320	禾川科技	3,000	111,960.00	0.04
354	688588	凌志软件	7,800	111,618.00	0.04
355	688135	利扬芯片	4,000	111,040.00	0.04
356	688360	德马科技	5,200	110,552.00	0.04
357	688733	壹石通	3,800	110,124.00	0.04
358	688073	毕得医药	1,800	109,890.00	0.04
359	688399	硕世生物	1,600	109,600.00	0.04
360	688381	帝奥微	4,800	109,488.00	0.04
361	688103	国力电子	1,800	109,062.00	0.04
362	688389	普门科技	8,400	109,032.00	0.04
363	688020	方邦股份	1,600	108,832.00	0.04
364	688601	力芯微	2,554	108,774.86	0.04
365	688157	松井股份	3,000	108,690.00	0.04
366	688663	新风光	2,800	108,556.00	0.04
367	688293	奥浦迈	2,200	107,800.00	0.04
368	688090	瑞松科技	2,400	106,752.00	0.04
369	688428	诺诚健华	5,200	106,704.00	0.04
370	688315	诺禾致源	8,000	106,240.00	0.04
371	688682	霍莱沃	2,000	105,820.00	0.04
372	688767	博拓生物	2,800	105,784.00	0.04
373	688168	安博通	1,400	105,224.00	0.04
374	688269	凯立新材	2,600	104,026.00	0.04
375	688478	晶升股份	2,770	103,625.70	0.04
376	688023	安恒信息	2,000	102,820.00	0.04
377	688339	亿华通	3,800	102,448.00	0.04
378	688606	奥泰生物	1,600	102,224.00	0.04
379	688716	中研股份	2,400	101,640.00	0.04
380	688429	时创能源	7,740	101,316.60	0.04

381	688330	宏力达	2,800	101,164.00	0.04
382	688489	三未信安	2,200	100,562.00	0.04
383	688677	海泰新光	2,328	100,476.48	0.04
384	688512	慧智微	9,000	100,440.00	0.04
385	688609	九联科技	9,800	100,058.00	0.04
386	688665	四方光电	2,049	99,929.73	0.04
387	688070	纵横股份	1,800	99,720.00	0.04
388	688653	康希通信	8,200	99,630.00	0.04
389	688010	福光股份	3,200	99,584.00	0.04
390	688379	华光新材	1,800	99,108.00	0.04
391	688280	精进电动	11,382	99,023.40	0.04
392	688356	键凯科技	1,200	98,640.00	0.04
393	688039	当虹科技	2,200	98,450.00	0.04
394	688302	海创药业	2,000	98,340.00	0.04
395	688197	首药控股	2,800	97,272.00	0.04
396	688719	爱科赛博	2,200	97,130.00	0.04
397	688267	中触媒	3,400	95,778.00	0.04
398	688299	长阳科技	5,653	95,648.76	0.04
399	688683	莱尔科技	3,000	95,100.00	0.03
400	688308	欧科亿	3,000	94,920.00	0.03
401	688312	燕麦科技	2,835	94,065.30	0.03
402	688298	东方生物	4,005	93,837.15	0.03
403	688581	安杰思	1,600	93,808.00	0.03
404	688283	坤恒顺维	2,326	93,737.80	0.03
405	688699	明微电子	2,200	93,522.00	0.03
406	688590	新致软件	5,003	93,355.98	0.03
407	688410	山外山	6,200	92,814.00	0.03
408	688480	赛恩斯	1,800	92,682.00	0.03
409	688662	富信科技	1,800	92,250.00	0.03
410	688595	芯海科技	2,800	91,840.00	0.03
411	688620	安凯微	7,600	91,504.00	0.03
412	688201	信安世纪	6,200	90,706.00	0.03
413	688079	美迪凯	8,000	90,560.00	0.03
414	688259	创耀科技	2,166	90,538.80	0.03
415	688533	上声电子	3,089	90,322.36	0.03
416	688291	金橙子	2,069	88,387.68	0.03
417	688416	恒烁股份	1,600	88,208.00	0.03
418	688237	超卓航科	1,800	87,750.00	0.03
419	688458	美芯晟	2,200	87,208.00	0.03
420	688580	伟思医疗	1,800	87,120.00	0.03
421	688159	有方科技	1,800	87,012.00	0.03
421	688215	瑞晟智能	1,200	87,012.00	0.03
422	688292	浩瀚深度	3,000	87,000.00	0.03

423	688602	康鹏科技	10,000	86,800.00	0.03
424	688610	埃科光电	1,400	86,534.00	0.03
425	688500	慧辰股份	1,400	86,464.00	0.03
426	688722	同益中	4,400	86,020.00	0.03
427	688148	芳源股份	9,800	85,946.00	0.03
428	688181	八亿时空	2,659	85,938.88	0.03
429	688247	宣泰医药	8,800	85,360.00	0.03
430	688273	麦澜德	2,000	85,040.00	0.03
431	688687	凯因科技	3,400	84,728.00	0.03
432	688033	天宜新材	11,000	84,700.00	0.03
433	688579	山大地纬	7,800	84,084.00	0.03
434	688238	和元生物	12,600	83,916.00	0.03
435	688175	高凌信息	2,600	83,746.00	0.03
436	688015	交控科技	3,623	82,531.94	0.03
437	688509	正元地信	15,000	82,350.00	0.03
438	688253	英诺特	2,675	80,731.50	0.03
439	688255	凯尔达	2,200	80,586.00	0.03
440	688162	巨一科技	2,600	80,080.00	0.03
440	688211	中科微至	2,600	80,080.00	0.03
441	688179	阿拉丁	6,400	79,936.00	0.03
442	688786	悦安新材	2,800	78,988.00	0.03
443	688286	敏芯股份	1,000	78,950.00	0.03
444	688115	思林杰	1,200	78,696.00	0.03
445	688768	容知日新	1,800	78,192.00	0.03
446	688307	中润光学	1,807	78,080.47	0.03
447	688152	麒麟信安	1,929	77,835.15	0.03
448	688373	盟科药业	12,800	77,312.00	0.03
449	688607	康众医疗	1,800	77,040.00	0.03
450	688013	天臣医疗	1,600	76,928.00	0.03
451	688317	之江生物	3,800	76,646.00	0.03
452	688323	瑞华泰	3,400	76,534.00	0.03
453	688207	格灵深瞳	5,000	76,000.00	0.03
454	688335	复洁科技	2,800	75,488.00	0.03
455	688199	久日新材	3,200	75,424.00	0.03
456	688080	映翰通	1,483	74,891.50	0.03
457	688435	英方软件	1,600	74,832.00	0.03
458	688171	纬德信息	1,600	74,656.00	0.03
459	688089	嘉必优	3,200	74,496.00	0.03
460	688689	银河微电	2,600	73,788.00	0.03
461	688244	永信至诚	3,000	73,320.00	0.03
462	688557	兰剑智能	2,000	72,860.00	0.03
463	688081	兴图新科	2,000	72,160.00	0.03
464	688061	灿瑞科技	2,200	71,742.00	0.03

465	688098	申联生物	8,000	71,040.00	0.03
466	688133	泰坦科技	3,200	70,848.00	0.03
467	688667	菱电电控	1,000	70,420.00	0.03
468	688628	优利德	2,200	70,048.00	0.03
469	688679	通源环境	2,600	69,160.00	0.03
470	688260	昀冢科技	2,400	69,120.00	0.03
471	688448	磁谷科技	1,400	67,858.00	0.02
472	688077	大地熊	2,200	67,210.00	0.02
473	688357	建龙微纳	2,000	66,100.00	0.02
474	688057	金达莱	5,400	65,988.00	0.02
475	688592	司南导航	1,600	65,760.00	0.02
476	688265	南模生物	1,600	65,616.00	0.02
477	688455	科捷智能	3,200	64,288.00	0.02
478	688600	皖仪科技	2,566	64,278.30	0.02
479	688419	耐科装备	2,285	63,957.15	0.02
480	688657	浩辰软件	1,200	63,852.00	0.02
481	688501	青达环保	2,400	63,432.00	0.02
482	688051	佳华科技	1,600	63,376.00	0.02
483	688370	丛麟科技	2,600	63,362.00	0.02
484	688170	德龙激光	2,000	62,920.00	0.02
485	688285	高铁电气	7,200	62,496.00	0.02
486	688345	博力威	2,000	62,400.00	0.02
487	688391	钜泉科技	2,200	62,326.00	0.02
488	688589	力合微	2,729	62,084.75	0.02
489	688030	山石网科	3,400	61,778.00	0.02
490	688350	富淼科技	2,400	61,752.00	0.02
491	688651	盛邦安全	1,400	61,628.00	0.02
492	688680	海优新材	1,600	61,200.00	0.02
493	688571	杭华股份	8,200	61,090.00	0.02
494	688551	科威尔	1,644	60,548.52	0.02
495	688246	嘉和美康	2,600	60,450.00	0.02
496	688529	豪森智能	3,200	59,008.00	0.02

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	603344	星德胜	22,600	844,336.00	0.31
2	603967	中创物流	61,400	843,022.00	0.31
3	603787	新日股份	59,000	829,540.00	0.30
4	301276	嘉曼服饰	27,300	818,454.00	0.30
5	605577	龙版传媒	60,600	792,042.00	0.29
6	603948	建业股份	28,900	788,970.00	0.29
7	603238	诺邦股份	44,700	787,614.00	0.29
8	002983	芯瑞达	34,300	787,185.00	0.29

9	301003	江苏博云	17,600	784,960.00	0.29
10	301283	聚胶股份	16,300	778,814.00	0.29
11	300845	捷安高科	69,100	778,757.00	0.29
12	002887	绿茵生态	83,200	778,752.00	0.29
13	003011	海象新材	35,300	778,012.00	0.29
14	301203	国泰环保	23,800	776,832.00	0.28
15	603231	索宝蛋白	42,400	776,768.00	0.28
16	603586	金麒麟	40,700	776,556.00	0.28
17	300625	三雄极光	65,400	774,990.00	0.28
18	603682	锦和商管	117,600	774,984.00	0.28
19	603661	恒林股份	24,200	774,642.00	0.28
20	603307	扬州金泉	19,700	774,407.00	0.28
21	301106	骏成科技	26,000	774,020.00	0.28
22	001219	青岛食品	54,300	773,775.00	0.28
23	605567	春雪食品	70,300	773,300.00	0.28
24	600796	钱江生化	127,600	773,256.00	0.28
25	001229	魅视科技	17,800	772,876.00	0.28
26	605258	协和电子	24,700	772,369.00	0.28
27	301167	建研设计	47,500	771,875.00	0.28
28	001368	通达创智	31,400	771,812.00	0.28
29	301006	迈拓股份	46,800	771,732.00	0.28
30	603096	新经典	44,300	771,706.00	0.28
31	601999	出版传媒	112,300	771,501.00	0.28
32	603511	爱慕股份	49,800	771,402.00	0.28
33	301429	森泰股份	40,600	771,400.00	0.28
34	603373	安邦护卫	20,300	770,588.00	0.28
35	603073	彩蝶实业	41,000	770,390.00	0.28
36	603706	东方环宇	39,700	770,180.00	0.28
37	603153	上海建科	45,300	770,100.00	0.28
38	002817	黄山胶囊	101,300	769,880.00	0.28
39	301223	中荣股份	41,900	769,703.00	0.28
40	003013	地铁设计	54,300	769,431.00	0.28
41	003027	同兴科技	34,500	769,350.00	0.28
42	002732	燕塘乳业	45,200	769,304.00	0.28
43	605058	澳弘电子	25,200	769,104.00	0.28
44	300833	浩洋股份	18,900	768,852.00	0.28
45	001228	永泰运	29,300	768,832.00	0.28
46	603326	我乐家居	86,380	768,782.00	0.28
47	301170	锡南科技	27,500	768,625.00	0.28
48	300732	设研院	102,472	768,540.00	0.28
49	002972	科安达	64,300	768,385.00	0.28
50	603091	众鑫股份	9,700	768,337.00	0.28
51	603856	东宏股份	61,600	768,152.00	0.28

52	301503	智迪科技	21,300	768,078.00	0.28
53	603041	美思德	63,700	767,585.00	0.28
54	002811	郑中设计	51,700	767,228.00	0.28
55	603115	海星股份	41,000	767,110.00	0.28
56	300864	南大环境	38,900	767,108.00	0.28
57	001296	长江材料	29,200	767,084.00	0.28
58	301151	冠龙节能	40,800	767,040.00	0.28
59	001230	劲旅环境	35,200	767,008.00	0.28
60	600097	开创国际	67,500	766,800.00	0.28
61	603075	热威股份	35,100	766,584.00	0.28
62	300800	力合科技	65,900	766,417.00	0.28
63	301552	科力装备	20,400	764,796.00	0.28
64	001322	箭牌家居	86,200	764,594.00	0.28
65	301065	本立科技	35,800	764,330.00	0.28
66	001387	雪祺电气	55,300	764,246.00	0.28
67	603207	小方制药	26,700	764,154.00	0.28
68	600287	苏豪时尚	139,900	763,854.00	0.28
69	603161	科华控股	55,600	763,388.00	0.28
70	003008	开普检测	35,400	762,870.00	0.28
71	301587	中瑞股份	32,600	762,840.00	0.28
72	301088	戎美股份	44,400	761,460.00	0.28
73	603006	黎明股份	58,000	760,960.00	0.28
74	002687	乔治白	157,800	760,596.00	0.28
75	603391	力聚热能	11,600	759,452.00	0.28
76	603182	嘉华股份	48,000	759,360.00	0.28
77	301386	未来电器	32,300	759,050.00	0.28
78	301222	浙江恒威	26,600	758,632.00	0.28
79	001218	丽臣实业	33,300	758,574.00	0.28
80	600697	欧亚集团	57,500	758,425.00	0.28
81	603350	安乃达	19,900	757,991.00	0.28
82	001216	华瓷股份	44,200	756,262.00	0.28
83	605001	威奥股份	99,100	756,133.00	0.28
84	301373	凌玮科技	23,500	754,350.00	0.28
85	603095	越剑智能	42,200	752,848.00	0.28
86	603080	新疆火炬	31,800	751,116.00	0.28
87	002763	汇洁股份	103,400	746,548.00	0.27
88	301365	矩阵股份	31,100	741,424.00	0.27
89	600865	百大集团	3,300	54,120.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	20,126,310.17	7.38

2	688256	寒武纪	19,411,382.17	7.11
3	688981	中芯国际	12,453,470.55	4.56
4	688111	金山办公	7,553,126.18	2.77
5	688036	传音控股	6,751,750.51	2.47
6	688012	中微公司	6,574,190.15	2.41
7	688271	联影医疗	5,908,591.19	2.17
8	688506	百利天恒	5,537,755.57	2.03
9	688008	澜起科技	5,234,204.82	1.92
10	688396	华润微	4,247,697.20	1.56
11	688223	晶科能源	3,833,000.56	1.40
12	688126	沪硅产业	3,505,135.66	1.28
13	688072	拓荆科技	3,156,490.60	1.16
14	001368	通达创智	3,128,557.00	1.15
15	688249	晶合集成	3,050,209.51	1.12
16	688082	盛美上海	3,044,995.78	1.12
17	688303	大全能源	3,024,796.98	1.11
18	688047	龙芯中科	2,988,474.29	1.10
19	688009	中国通号	2,978,028.90	1.09
20	003011	海象新材	2,824,117.60	1.03

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 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	10,288,187.02	3.77
2	688256	寒武纪	8,439,329.84	3.09
3	688981	中芯国际	8,137,285.05	2.98
4	688036	传音控股	5,601,028.22	2.05
5	002969	嘉美包装	5,136,578.00	1.88
6	688111	金山办公	4,670,707.88	1.71
7	688271	联影医疗	3,727,565.68	1.37
8	600865	百大集团	3,328,844.00	1.22
9	688396	华润微	3,270,682.24	1.20
10	688012	中微公司	3,012,783.51	1.10
11	301408	华人健康	2,856,793.00	1.05
12	002871	伟隆股份	2,710,598.00	0.99
13	688223	晶科能源	2,685,768.68	0.98
14	688008	澜起科技	2,628,522.94	0.96
15	688506	百利天恒	2,503,279.15	0.92
16	605155	西大门	2,461,174.04	0.90
17	301028	鼎熔岩	2,433,806.00	0.89
18	001368	通达创智	2,430,981.00	0.89
19	001210	金房能源	2,423,509.67	0.89
20	603065	宿迁联盛	2,399,971.00	0.88

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	667,155,918.77
卖出股票收入（成交）总额	423,897,793.31

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	14,230,160.88	5.21
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,230,160.88	5.21

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	019773	25 国债 08	111,000	11,212,070.47	4.11
2	102310	国债 2513	30,000	3,018,090.41	1.11

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

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 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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	102,363.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	102,363.78

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688012	中微公司	3,745,632.00	1.37	重大事项停牌

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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 (%)
鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	929	179,870.07	-	-	167,099,297.37	100.0000
鑫元上证科创板综合价格指数增强 C	1,633	59,339.69	1,415,386.35	1.4606	95,486,327.63	98.5394
合计	2,562	103,044.89	1,415,386.35	0.5361	262,585,625.00	99.4639

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	鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	24,753.38	0.0148
	鑫元上证科创板综合价格指数增强 C	0.00	0.0000
	合计	24,753.38	0.0094

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	0
	鑫元上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	0
	鑫元上证科创板综合价格指数增强 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元上证科创板综合价格指数增强 A	鑫元上证科创板综合价格指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 10 月 28 日) 基金份额总额	276,245,323.46	169,961,961.62
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	331,363.33	3,007,902.99
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	109,477,389.42	76,068,150.63
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	167,099,297.37	96,901,713.98

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 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

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2025 年 6 月 18 日起，张鹏飞先生任公司副总经理，杨晓宇先生任公司副总经理、首席信息官；自 2025 年 8 月 29 日起，王辉先生离任公司副总经理；自 2025 年 11 月 10 日起，王雁女士任公司副总经理。

2、基金托管人：本报告期内，孟羽任交通银行资产托管部/资产托管业务发展中心总经理。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、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无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为本基金进行审计的会计师事务所为：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未发生改聘。本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 26,000.00 元。目前的会计师事务所为本基金提供审计服务的年限为 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

注：本报告期内，基金管理人未受到稽查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员未受到稽查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门未受到任何调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的相关从业人员未受到任何调查或处罚。

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 (%)	
山西证券	2	644,814,198.91	59.10	123,998.55	59.91	-
东海证券	3	446,239,513.17	40.90	82,975.94	40.09	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范；
- 2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需；
- 3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；
- 4) 收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

- 1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：相关券商交易单元均为报告期内新增租用。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
山西证券	32,900,559.00	91.64	4,830,040,000.00	91.48	-	-
东海证券	3,002,020.00	8.36	449,900,000.00	8.52	-	-

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	鑫元上证科创板综合价格指数增强型	公司网站	2025年9月24日

	证券投资基金（鑫元上证科创板综合价格指数增强 A）基金产品资料概要		
2	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	公司网站、证券时报	2025 年 9 月 24 日
3	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	公司网站、证券时报	2025 年 9 月 24 日
4	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金托管协议	公司网站	2025 年 9 月 24 日
5	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同	公司网站	2025 年 9 月 24 日
6	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金招募说明书	公司网站	2025 年 9 月 24 日
7	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（鑫元上证科创板综合价格指数增强 C）基金产品资料概要	公司网站	2025 年 9 月 24 日
8	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 10 月 28 日
9	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	公司网站、证券时报	2025 年 10 月 29 日
10	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、上交所	2025 年 11 月 11 日
11	鑫元基金管理有限公司关于鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司网站、证券时报	2025 年 11 月 26 日
12	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报	2025 年 12 月 10 日
13	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（鑫元上证科创板综合价格指数增强 C）基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 12 月 15 日
14	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金（鑫元上证科创板综合价格指数增强 A）基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 12 月 15 日
15	鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	公司网站	2025 年 12 月 15 日
16	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台申购费率优惠活动的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 12 月 23 日

17	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券估值调整的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 12 月 24 日
18	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票变更估值方法的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 12 月 26 日

§ 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

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告中部分比例指标以 0.00%、0.0000%、100.00%或 100.0000%列示，均系四舍五入保留小数位数所致，不代表实际值为零或精确为 100%。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

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。

鑫元基金管理有限公司

2026 年 3 月 31 日