

汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证 券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 29 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。本中期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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 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	75
7.7 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	75
7.8 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	75
7.9 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	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
7.12 投资组合报告附注	75
§ 8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末上市基金前十名持有人	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
8.4 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情况.....	77
§ 9 开放式基金份额变动	78
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
10.2 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.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
10.8 其他重大事件	80
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§ 12 备查文件目录	83
12.1 备查文件目录	83
12.2 存放地点	83
12.3 查阅方式	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富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	汇添富上证科创板综合 ETF
场内简称	科创综 E
基金主代码	589080
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 02 月 26 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	643,061,000.00
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 03 月 05 日

注：扩位证券简称：科创综指 ETF 汇添富。

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	本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。 在特殊情形下，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	李鹏	张姗

负责人	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-9918	400-61-95555
传真		021-28932998	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区外马路 728 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040
法定代表人		鲁伟铭	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2025 年 02 月 26 日(基金合同生效日) – 2025 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	4,250,783.08
本期利润	4,313,376.15
加权平均基金份额本期利润	0.0057
本期加权平均净值利润率	0.60%
本期基金份额净值增长率	-1.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
期末可供分配利润	-11,744,304.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0183
期末基金资产净值	631,316,695.55
期末基金份额净值	0.9817
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 06 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-1.83%

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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用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、本基金的《基金合同》生效日为 2025 年 02 月 26 日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至 2025 年 06 月 30 日数据，特此说明。

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
过去一个月	5.64%	1.00%	5.71%	1.01%	-0.07%	-0.01%
过去三个月	3.12%	1.98%	3.27%	1.99%	-0.15%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.83%	1.79%	-2.89%	1.88%	1.06%	-0.09%

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

汇添富上证科创板综合ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2025 年 02 月 26 日，截至本报告期末，基金成立未满一年。本基金建仓期为本《基金合同》生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国及新加坡设有子公司——汇添富资产管理（香港）有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司、汇添富投资管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富基金现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2025 上半年，汇添富基金新成立 22 只公开募集证券投资基金。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 363 只公开募集证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征，较为完善、有效的产品线。

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 (年)	说明
		任职日期	离任日期		
罗昊	本基金的 基金经理	2025 年 02 月 26 日	-	9	国籍：中国。学历：上海交通大学工学学士、美国东北大学管理学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2016 年 6 月至 2019 年 3 月就职于上海游马地投资中心（有限合伙），2019 年 6 月至 2023 年 11 月就职于威廉欧奈尔投资管理（上海）有限公司。2023 年 12 月起加入汇添富基金管理股份有限公司。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券

					投资基金的基金经理。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月 11 日至今任汇添富华证专精特新 100 指数型发起式证券投资基金的基金经理。 2025 年 1 月 20 日至今任汇添富上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 2025 年 2 月 21 日至今任汇添富中证全指软件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 2 月 26 日至今任汇添富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 3 月 19 日至 2025 年 5 月 12 日任汇添富上证科创板 100 指数型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 25 日至今任汇添富上
--	--	--	--	--	--

					证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 4 月 25 日至今任汇添富上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月 29 日至今任汇添富中证光伏产业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 5 月 13 日至今任汇添富上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2025 年 6 月 5 日至今任汇添富上证科创板新材料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“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。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,

力争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。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 4 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，A 股市场在震荡中寻找新的平衡点，主要受到政策预期和资金流向的双重影响。其中，人工智能和创新药板块表现尤为突出，成为推动市场向上的重要引擎。

春节后的市场表现主要围绕政策预期展开。政府工作报告明确提出要实现经济增长的目标，同时将通胀水平设为 2%。货币政策方面，央行采取了相对宽松的流动性投放策略，降准降息的预期不断升温。这些政策信号释放出明确的稳增长意图，为市场注入了积极因素，同时也体现了对经济下行压力的重视和应对决心。

进入二季度，外部冲击明显加剧，主要包括关税政策和地缘冲突。4 月初，美国宣布将对贸易伙伴征收对等关税，此后多国陆续表态。中国对美国的关税政策进行了有力回击，调升了美国进口商品的关税，并加强了稀土出口管制。资本市场对此次关税政策反应剧烈，全球权益市场普遍下挫。5 月，经过反复磋商，中美两国开展了经贸会谈并取得了一定进展，双方均大幅下调关税，贸易争端得到有效缓和。至 6 月，美国与其他国家或地区的贸易谈判陆续推进，市场风险偏好也逐渐修复。然而，6 月在贸易争端有所缓和之际，中东地缘冲突又引发了新一轮市场冲击。

面对外部环境的挑战，中国在产业政策方面展现出更加积极的态度。政府加大了对战略性新兴产业的支持力度，特别是在半导体、新材料等关键领域的投入明显增加。同时，绿色发展和数字化转型也成为政策重点，相关产业链上的企业获得了更多政策红利。

从宏观经济数据来看，二季度整体呈现稳中向好的态势：消费复苏势头逐步明朗，工业生产增速相对稳健，投资则略有下滑。5 月份社会消费品零售总额同比增长 6.4%，表现超出预期，显示出内需的韧性。制造业 PMI 连续三个月保持在荣枯线之上，显示生产端的景气度有所改善。固定资产投资增速虽然有所放缓，但结构性优化特征明显，高技术制造业投资保持了较快增长。在这种背景下，中国生物技术行业的发展势头强劲，在人工智能和电动汽车等领域的突破性进展同样令人瞩目，正在缩小与美国的技术差距。

在经济温和修复的背景下，上市公司的基本面预期表现稳健，A 股主要宽基指数的估值处于适中水平。

本基金跟踪上证科创板综合指数，上证科创板综合指数由上海证券交易所符合条件的科创板上市公司证券组成指数样本，并将样本分红计入指数收益，反映上海证券交易所科创板上市公司证券在计入分红收益后的整体表现。

报告期内，本基金遵循指数基金的被动投资原则，基本实现了有效跟踪业绩比较基准的投资目的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-1.83%。同期业绩比较基准收益率为-2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年全球经济发展仍处于波动期。国际方面，美国贸易政策的不稳定性持续扰动国际市场秩序，叠加部分地区地缘局势紧张，为世界经济复苏蒙上阴影。反观国内经济，在经历上半年的平稳回升后，下半年增长动能有望进一步增强。从最新数据来看，消费市场表现亮眼：CPI 保持温和上涨态势，零售销售数据更是呈现强劲增长，充分彰显国内消费市场的活力正在持续释放。不过，PPI 指数的波动也提示着制造业领域仍存在一些挑战。展望未来，随着“反内卷”系列政策的深入实施，相关行业的价格压力或将得到缓解。特别值得注意的是，7 月政治局会议即将召开，市场普遍预期会议将释放更多稳增长政策信号，这或将成为下半年经济走势的重要转折点。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；基金管理人可对基金相对标的指数的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇添富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 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	4,585,751.86
结算备付金		—
存出保证金		—

交易性金融资产	6.4.7.2	626,776,352.63
其中：股票投资		626,660,350.09
基金投资		—
债券投资		116,002.54
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
应收清算款		119,732.20
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		631,481,836.69
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		—
应付管理人报酬		84,414.23
应付托管费		28,138.07
应付销售服务费		—
应付投资顾问费		—
应交税费		0.09
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.7	52,588.75
负债合计		165,141.14
净资产：		
实收基金	6.4.7.8	643,061,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-11,744,304.45
净资产合计		631,316,695.55
负债和净资产总计		631,481,836.69

注：1、报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9817 元，基金份额总额

643,061,000.00 份。

2、本基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示 2025 年 06 月 30 日数据，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：汇添富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 02 月 26 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合 同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		4,844,992.47
1. 利息收入		135,970.68
其中：存款利息收入	6.4.7.10	135,970.68
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）		4,592,469.60
其中：股票投资收益	6.4.7.11	2,275,104.48
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	2.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	2,317,362.66
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）	6.4.7.18	62,593.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	53,959.12
减：二、营业总支出		531,616.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	358,763.16
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	119,587.72
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	6. 4. 7. 20	-
7. 税金及附加		0. 01
8. 其他费用	6. 4. 7. 21	53, 265. 43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4, 313, 376. 15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4, 313, 376. 15
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4, 313, 376. 15

注：本基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，本报无上年度可比期间，特此说明。

6.3 净资产变动表

会计主体：汇添富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 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 493, 061, 000. 00	-	1, 493, 061, 000. 00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-850, 000, 000. 00	-11, 744, 304. 45	-861, 744, 304. 45
（一）、综合收益总额	-	4, 313, 376. 15	4, 313, 376. 15
（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）	-850, 000, 000. 00	-16, 057, 680. 60	-866, 057, 680. 60
其中：1. 基金申购款	370, 000, 000. 00	-14, 868, 285. 75	355, 131, 714. 25
2. 基金赎回款	-1, 220, 000, 000. 00	-1, 189, 394. 85	-1, 221, 189, 394. 85
（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	643,061,000.00	-11,744,304.45	631,316,695.55

注：本基金合同于 2025 年 02 月 26 日生效，本报表无上年度可比期间，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇添富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”），系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]126 号文《关于准予汇添富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，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2025 年 2 月 17 日起至 2025 年 2 月 21 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,493,061,000.00 元，在募集期间产生的利息为人民币 82,767.72 元，全部归入基金财产，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,493,143,767.72 元，折合 1,493,061,000.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2025）验字第 70015647_B05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2025 年 2 月 26 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 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 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采用现金分红；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、基金管理人可对基金相对标的指数的超额收益率和/或基金的可供分配利润进行评价，当收益评价日核定的超额收益率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收

益分配；

5、当基金收益分配根据基金相对标的指数的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	380,439.63
等于：本金	380,411.60
加：应计利息	28.03
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	4,205,312.23
等于：本金	4,205,243.56
加：应计利息	68.67
减：坏账准备	-
合计	4,585,751.86

注：其他存款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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	626,597,757.02	-	626,660,350.09	62,593.07

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	116,000.00	2.54	116,002.54	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	116,000.00	2.54	116,002.54	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		626,713,757.02	2.54	626,776,352.63	62,593.07

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 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	-

应付审计费	24,271.25
应付信息披露费	28,317.50
应付指数使用费	-
应付账户维护费	-
应付汇划费	-
应付上市费	-
应付持有人大会费-公证费	-
应付持有人大会费-律师费	-
应付或有管理费	-
申购款利息	-
应付登记结算费	-
应付 IOPV 计算与发布费	-
其他	-
合计	52,588.75

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,493,061,000.00	1,493,061,000.00
本期申购	370,000,000.00	370,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,220,000,000.00	-1,220,000,000.00
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	643,061,000.00	643,061,000.00

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 02 月 26 日生效，募集期间净认购人民币金额为 1,493,061,000.00 元，基金合同生效日的人民币基金份额总额为 1,493,061,000.00 份，其中认购资金利息折合 0.00 份人民币基金份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,250,783.08	62,593.07	4,313,376.15
本期基金份额交易产生的变动数	-5,078,720.69	-10,978,959.91	-16,057,680.60
其中：基金申购款	2,114,364.36	-16,982,650.11	-14,868,285.75
基金赎回款	-7,193,085.05	6,003,690.20	-1,189,394.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-827,937.61	-10,916,366.84	-11,744,304.45

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	134,000.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,970.08
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	135,970.68

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-213,451.91
股票投资收益——赎回差价收入	2,488,556.39
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	2,275,104.48

6.4.7.11.2 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 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	211,697,619.46
减：卖出股票成本总额	211,345,612.39
减：交易费用	565,458.98
买卖股票差价收入	-213,451.91

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,221,189,394.85
减：现金支付赎回款总额	-840,242.15
减：赎回股票成本总额	1,219,541,080.61
减：交易费用	-
赎回差价收入	2,488,556.39

6.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2.46
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	2.46

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,317,362.66
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	2,317,362.66

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	62,593.07
——股票投资	62,593.07
——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	-
——期货投资	-
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	62,593.07

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	53,959.12
其他	-
合计	53,959.12

6.4.7.20 信用减值损失

注：本基金无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	24,271.25
信息披露费	28,317.50
证券出借违约金	-
账户维护费	-
银行费用	434.39
指数使用费	-
登记结算服务费	-
IOPV 计算与发布费	-
持有人大会-公证费	-
持有人大会-律师费	-
开户费	-
上市费	-
或有管理费	-
其他	242.29
合计	53,265.43

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内未发生与本基金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。

6.4.9.2 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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
东方证券	1,914,716,177.64	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
东方证券	336,970.45	100.00	-	-

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	358,763.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	128,117.77
应支付基金管理人的净管理费	230,645.39

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	119,587.72

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 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：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 06 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
东方证券股份有限公司	620,500.00	0.10
汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	150,223,200.00	23.36

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符合基金招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.6 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 02 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	380,439.63	134,000.60
东方证券	4,205,312.23	1,970.08

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
					-	-	-	-	-	
6.4.12.1.2 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
118057	甬矽转债	2025 年 06 月 27 日	13 个交易日	新债流通受限	100.00	100.00	1,160	116,000.00	116,002.54	

6.4.12.2 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
688313	仕佳光子	2025 年 06 月 30	重大事项停	38.05	2025 年 07 月 11	39.98	42,221	903,738.64	1,606,509.05	

		日	牌		日					
--	--	---	---	--	---	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

6.4.13.2 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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于

基金份额持有人可随时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。

6.4.13.3.1 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“期末本基金持有的流通受限证券”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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年06 月30 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	4,585,751.86	-	-	-	-	-	4,585,751.86
结算 备付 金	-	-	-	-	-	-	-
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	116,002.54	-	-	626,660,350.09	626,776,352.63
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	119,732.20	119,732.20
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税资 产	-	-	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-	-	-	-
资产	4,585,751.86	-	116,002.54	-	-	626,780,082.29	631,481,836.69

总计							
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	84,414.23	84,414.23
应付托管费	-	-	-	-	-	28,138.07	28,138.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.09	0.09
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负	-	-	-	-	-	-	-

债							
其他 负债	-	-	-	-	-	52,588.75	52,588.75
负债 总计	-	-	-	-	-	165,141.14	165,141.14
利率 敏感 度缺 口	4,585,751.86	-	116,002.54	-	-	626,614,941.15	631,316,695.55

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 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	626,660,350.09	99.26
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	116,002.54	0.02
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	626,776,352.63	99.28

6.4.13.4.3.2 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. 以下分析中，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 06 月 30 日
	上证科创板综合指数上涨 5%	29,329,278.01
	上证科创板综合指数下跌 5%	-29,329,278.01

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 06 月 30 日
第一层次	625,053,841.04
第二层次	1,722,511.59
第三层次	—
合计	626,776,352.63

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市

场交易的股票、债券等投资，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	626,660,350.09	99.24
	其中：股票	626,660,350.09	99.24
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	116,002.54	0.02
	其中：债券	116,002.54	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	4,585,751.86	0.73
8	其他各项资产	119,732.20	0.02
9	合计	631,481,836.69	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	502,832,426.97	79.65
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	111,292,559.15	17.63
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	10,527,630.55	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	2,007,733.42	0.32
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	626,660,350.09	99.26

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 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。

7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	688041	海光信息	213,323	30,140,406.67	4.77
2	688256	寒武纪科技	38,280	23,025,420.00	3.65
3	688981	中芯国际	182,673	16,106,278.41	2.55

4	688111	金山办公	42,588	11,926,769.40	1.89
5	688506	百利天恒药业	36,860	10,914,983.20	1.73
6	688012	中微半导体设备	57,387	10,461,650.10	1.66
7	688271	联影医疗	75,643	9,662,636.82	1.53
8	688008	澜起科技	105,182	8,624,924.00	1.37
9	688036	传音控股	104,750	8,348,575.00	1.32
10	688396	华润微电子	121,770	5,742,673.20	0.91
11	688047	龙芯中科	36,850	4,915,421.50	0.78
12	688223	晶科能源	918,848	4,768,821.12	0.76
13	688126	上海硅产业集团	252,013	4,717,683.36	0.75
14	688082	盛美上海半导体	40,531	4,618,102.14	0.73
15	688521	芯原微电子	45,885	4,427,902.50	0.70
16	688303	大全能源	197,195	4,204,197.40	0.67
17	688009	中国通号	791,787	4,069,785.18	0.64
18	688072	拓荆科技	25,705	3,951,115.55	0.63
19	688183	生益电子	76,283	3,905,689.60	0.62
20	689009	九号公司	66,006	3,905,575.02	0.62
21	688578	艾力斯医药科技	41,492	3,860,415.68	0.61
22	688608	恒玄科技	10,966	3,815,948.68	0.60
23	688213	思特威电子科	36,897	3,771,611.34	0.60

		技			
24	688249	晶集成	184,516	3,740,139.32	0.59
25	688617	惠泰医疗	12,547	3,726,459.00	0.59
26	688169	石头科技	23,647	3,701,937.85	0.59
27	688728	格科微有限公司	238,819	3,677,812.60	0.58
28	688120	华海清科	21,539	3,633,629.30	0.58
29	688188	上海柏楚电子科技	26,506	3,489,779.96	0.55
30	688187	时代电气	79,847	3,405,474.55	0.54
31	688297	中航无人机	62,001	3,310,853.40	0.52
32	688375	国博电子	54,959	3,298,089.59	0.52
33	688777	中控技术	72,339	3,248,744.49	0.51
34	688065	凯赛生物	66,273	3,121,458.30	0.49
35	688469	芯联集成	648,980	3,095,634.60	0.49
36	688472	阿特斯阳光电力	338,182	3,094,365.30	0.49
37	688122	西部超导	59,504	3,087,067.52	0.49
38	688336	三生国健	56,791	3,080,343.84	0.49
39	688220	翱捷科技	38,373	3,004,605.90	0.48
40	688538	和辉光电	1,270,309	2,972,523.06	0.47
41	688002	睿创微纳	41,982	2,926,985.04	0.46
42	688599	天合光能	200,029	2,906,421.37	0.46
43	688525	佰维存储	42,468	2,862,343.20	0.45

44	688349	三一重能	112,563	2,807,321.22	0.44
45	688099	晶晨半导体	38,669	2,745,885.69	0.43
46	688278	特宝生物	37,296	2,689,414.56	0.43
47	688318	财富趋势	23,379	2,686,714.68	0.43
48	688027	科大国盾量子	9,743	2,679,422.43	0.42
49	688568	中科星图公司	74,355	2,677,523.55	0.42
50	688266	泽璟制药	24,170	2,598,516.70	0.41
51	688235	百济神州	10,889	2,544,105.96	0.40
52	688192	迪哲医药	42,272	2,527,865.60	0.40
53	688819	天能电池集团股份	89,439	2,482,826.64	0.39
54	688361	中科飞测	29,446	2,479,058.74	0.39
55	688114	华大智造	38,170	2,474,561.10	0.39
56	688582	芯动联科	36,789	2,472,220.80	0.39
57	688520	神州细胞集团公司	41,049	2,456,782.65	0.39
58	688385	复旦微电	49,409	2,434,381.43	0.39
59	688629	四川华丰科技	42,500	2,431,000.00	0.39
60	688180	君实生物	70,455	2,394,060.90	0.38
61	688692	达梦数据	10,734	2,392,501.26	0.38
62	688563	航空材料股份	41,420	2,345,614.60	0.37
63	688234	天岳先进	39,567	2,316,647.85	0.37
64	688702	盛科通信	37,682	2,301,616.56	0.36

65	688019	安集科技	15,117	2,294,760.60	0.36
66	688363	华熙生物	44,367	2,278,245.45	0.36
67	688475	萤石网络	71,997	2,269,345.44	0.36
68	688052	纳芯微电子	12,695	2,215,150.55	0.35
69	688172	燕东微电子股份	110,252	2,167,554.32	0.34
70	688778	厦钨新能源	38,707	2,164,495.44	0.34
71	688322	奥比中光	36,550	2,156,815.50	0.34
72	688561	奇安信集团	62,870	2,136,322.60	0.34
73	688166	博瑞生物医药	38,799	2,083,894.29	0.33
74	688017	绿的谐波	16,537	2,065,305.93	0.33
75	688347	华虹半导体公司	37,399	2,053,579.09	0.33
76	688018	乐鑫科技	14,046	2,052,120.60	0.33
77	688425	铁建重工	490,104	1,999,624.32	0.32
78	688331	荣昌生物	32,470	1,964,435.00	0.31
79	688037	芯源微电子	18,232	1,954,470.40	0.31
80	688709	成都华微	58,313	1,909,167.62	0.30
81	688208	道通科技	61,639	1,886,153.40	0.30
82	688088	虹软科技	36,933	1,782,017.25	0.28
83	688387	中信科移动	314,156	1,774,981.40	0.28
84	688382	益方生物科技	53,188	1,745,630.16	0.28
85	688200	华峰测控	12,011	1,731,986.20	0.27

86	688295	中复神鹰碳纤维	82,855	1,723,384.00	0.27
87	688100	威胜信息	44,942	1,665,101.10	0.26
88	688248	南方电网电力科技	51,977	1,635,196.42	0.26
89	688536	思瑞浦股份	11,772	1,633,011.84	0.26
90	688567	孚能科技	112,044	1,624,638.00	0.26
91	688279	峰昭科技	8,747	1,622,568.50	0.26
92	688313	仕佳光子	42,221	1,606,509.05	0.25
93	688343	云天励飞股份	32,425	1,602,443.50	0.25
94	688301	奕瑞科技股份有限公司	18,163	1,591,260.43	0.25
95	688498	源杰科技	8,134	1,586,130.00	0.25
96	688409	富创精密	28,199	1,551,226.99	0.25
97	688484	南芯科技	38,979	1,541,619.45	0.24
98	688116	天奈科技	33,592	1,537,505.84	0.24
99	688281	华秦科技实业	24,975	1,511,237.25	0.24
100	688772	珠海冠宇电池	104,260	1,489,875.40	0.24
101	688333	西安铂力特	24,992	1,488,523.52	0.24
102	688005	容百科技	65,740	1,467,316.80	0.23
103	688798	艾为电子	21,319	1,453,955.80	0.23
104	688522	纳睿雷达科技	27,895	1,428,781.90	0.23
105	688502	茂莱光学	4,915	1,413,848.90	0.22
106	688676	海南金盘智能	42,207	1,411,824.15	0.22

		科技			
107	688146	中船派瑞特气	48,513	1,402,510.83	0.22
108	688433	华曙高科	37,877	1,391,979.75	0.22
109	688141	杰华特微电子	41,025	1,336,594.50	0.21
110	688327	云从科技	95,441	1,316,131.39	0.21
111	688631	莱斯信息	14,686	1,309,991.20	0.21
112	688147	微导纳米科技	42,583	1,285,154.94	0.20
113	688432	有研硅	114,279	1,261,640.16	0.20
114	688198	佰仁医疗科技	12,228	1,255,693.32	0.20
115	688110	东芯股份	40,723	1,248,567.18	0.20
116	688552	航天南湖	31,057	1,239,484.87	0.20
117	688068	热景生物	8,783	1,230,849.62	0.19
118	688352	颀中科技	109,018	1,224,272.14	0.19
119	688153	唯捷创芯	39,471	1,223,995.71	0.19
120	688165	埃夫特智能	47,868	1,221,591.36	0.19
121	688548	广钢气体股份	121,355	1,215,977.10	0.19
122	688050	爱博诺德医疗	17,505	1,205,219.25	0.19
123	688789	杭州宏华数码科技	16,185	1,182,152.40	0.19
124	688400	凌云光技术	42,415	1,169,381.55	0.19
125	688206	概伦电子	39,832	1,158,314.56	0.18
126	688543	国科军工	19,145	1,152,337.55	0.18
127	688029	南微医学科技	17,028	1,150,241.40	0.18

128	688123	聚辰半 导体	14,151	1,146,089.49	0.18
129	688097	博众精 工科技	41,018	1,144,812.38	0.18
130	688055	昆山龙 腾光电	306,881	1,135,459.70	0.18
131	688032	禾迈股 份	11,365	1,134,908.90	0.18
132	688332	中科蓝 讯	10,985	1,132,333.80	0.18
133	688362	甬矽电 子	37,435	1,114,814.30	0.18
134	688306	均普智 能制造	112,896	1,110,896.64	0.18
135	688584	上海合 晶硅材 料	61,141	1,093,201.08	0.17
136	688289	圣湘生 物	53,155	1,088,614.40	0.17
137	688700	东威科 技	27,536	1,086,295.20	0.17
138	688076	诺泰生 物	29,148	1,084,888.56	0.17
139	688776	国光电 气	10,280	1,084,334.40	0.17
140	688006	浙江杭 可科技	55,482	1,081,899.00	0.17
141	688686	奥普特 科技	11,189	1,069,892.18	0.17
142	688660	电气风 电	122,414	1,062,553.52	0.17
143	688439	振华风 光	18,175	1,058,693.75	0.17
144	688591	泰凌微	21,932	1,050,542.80	0.17
145	688549	中巨芯 科技	135,523	1,048,948.02	0.17
146	688107	安路科 技	36,765	1,038,243.60	0.16
147	688612	威迈斯	38,769	1,036,683.06	0.16
148	688001	苏州华 兴源创 科技	40,982	1,035,615.14	0.16
149	688062	迈威生 物	36,551	1,033,662.28	0.16

150	688300	联瑞新材	22,170	1,032,013.50	0.16
151	688190	云路先进材料股份	10,984	1,016,679.04	0.16
152	688063	派能科技	22,454	1,012,226.32	0.16
153	688182	灿勤科技	36,623	1,009,329.88	0.16
154	688739	成大生物	38,187	1,008,136.80	0.16
155	688016	心脉医疗	11,260	995,609.20	0.16
156	688380	中微半导	36,708	994,786.80	0.16
157	688161	威高骨科	36,699	983,166.21	0.16
158	688083	中望软件	15,212	979,804.92	0.16
159	688326	经纬恒润	10,944	976,642.56	0.15
160	688519	南亚新材料	21,780	975,744.00	0.15
161	688516	奥特维科技	28,991	963,660.84	0.15
162	688779	五矿新能	176,924	962,466.56	0.15
163	688390	固德威电源	22,101	960,288.45	0.15
164	688158	优刻得科技	42,191	954,360.42	0.15
165	688177	百奥泰生物	38,065	953,908.90	0.15
166	688127	蓝特光学	36,912	949,007.52	0.15
167	688443	智翔金泰	33,600	932,064.00	0.15
168	688131	皓元医药	19,239	930,205.65	0.15
169	688630	芯碁微装	11,715	929,819.55	0.15
170	688408	中信博新能源	19,891	928,511.88	0.15
171	688800	瑞可达	18,692	919,646.40	0.15

		连接系统			
172	688503	聚和材料股份公司	22,157	917,078.23	0.15
173	688252	天德钰科技	37,574	916,054.12	0.15
174	688048	长光华芯	15,844	914,832.56	0.14
175	688232	国泰新点软件	30,415	913,666.60	0.14
176	688150	莱特光电股份	36,954	913,502.88	0.14
177	688596	正帆科技	26,857	910,989.44	0.14
178	688128	中国电器研究院	37,172	910,714.00	0.14
179	688698	伟创电气	19,255	908,836.00	0.14
180	688139	海尔生物	29,398	908,104.22	0.14
181	688270	浙江臻镭科技股份有限公司	19,499	907,873.44	0.14
182	688366	昊海生物科技	17,588	901,209.12	0.14
183	688151	华强科技	31,942	900,444.98	0.14
184	688102	陕西斯瑞新材股份	66,748	899,763.04	0.14
185	688321	微芯生物	37,367	888,587.26	0.14
186	688091	上海谊众药业	18,832	880,960.96	0.14
187	688205	德科立光电子	14,041	880,230.29	0.14
188	688652	京仪装备	15,148	868,283.36	0.14
189	688351	微创电生理股份	43,307	853,147.90	0.14
190	688690	纳微科	37,195	849,161.85	0.13

		技			
191	688766	普冉半 导体	13,151	831,143.20	0.13
192	688105	诺唯赞 生物	36,477	825,474.51	0.13
193	688262	苏州国 芯科技	30,912	824,423.04	0.13
194	688570	天玛智 控	39,953	818,237.44	0.13
195	688586	江航飞 机装备	72,376	814,230.00	0.13
196	688003	天准科 技	17,581	806,967.90	0.13
197	688523	航天环 宇科技	37,347	803,333.97	0.13
198	688403	汇成股 份	77,243	802,554.77	0.13
199	688656	浩欧博 生物	5,905	801,899.00	0.13
200	688372	伟测科 技	13,249	800,239.60	0.13
201	688276	长春百 克生物 科技	37,829	794,409.00	0.13
202	688106	金宏气 体	44,291	792,365.99	0.13
203	688049	炬芯科 技	13,067	790,553.50	0.13
204	688486	龙迅股 份	11,785	788,180.80	0.12
205	688627	精智达 技术	8,936	786,457.36	0.12
206	688658	悦康药 业	41,271	785,799.84	0.12
207	688138	清溢光 电	28,895	785,655.05	0.12
208	688388	嘉元科 技	39,085	784,826.80	0.12
209	688531	日联科 技股份	10,829	775,356.40	0.12
210	688717	艾罗能 源	14,333	771,545.39	0.12
211	688668	鼎通科 技	12,305	768,570.30	0.12

212	688575	亚辉龙生物	52,404	764,574.36	0.12
213	688696	极米科技	6,609	755,805.24	0.12
214	688093	世华科技	24,204	751,534.20	0.12
215	688392	骄成超声波	10,998	749,293.74	0.12
216	688225	亚信安全	36,624	746,763.36	0.12
217	688559	海目星激光	22,519	740,875.10	0.12
218	688209	英集芯科技	39,624	731,855.28	0.12
219	688368	晶丰明源半导体	8,296	728,637.68	0.12
220	688639	华恒生物	22,815	723,235.50	0.11
221	688685	迈信林航空股份	12,920	721,582.00	0.11
222	688593	新相微	42,407	692,506.31	0.11
223	688136	科兴生物制药	18,090	691,399.80	0.11
224	688167	西安炬光科技	8,561	691,300.75	0.11
225	688515	裕太微电子	7,545	691,122.00	0.11
226	688562	航天软件股份	36,690	687,570.60	0.11
227	688160	步科自动化	7,941	680,543.70	0.11
228	688691	灿芯半导体股份	10,957	677,800.02	0.11
229	688526	武汉科前生物	42,956	669,254.48	0.11
230	688550	瑞联新材料	15,521	667,558.21	0.11
231	688513	苑东生物	15,996	656,795.76	0.10
232	688305	科德数控	11,764	656,548.84	0.10

233	688535	华海诚科新材料	7,623	655,501.77	0.10
234	688311	盟升电子	15,121	650,959.05	0.10
235	688508	芯朋微电子	11,652	650,414.64	0.10
236	688185	康希诺生物	10,828	645,673.64	0.10
237	688025	杰普特光电	8,985	642,427.50	0.10
238	688788	科思科技	14,051	641,709.17	0.10
239	688518	联赢激光股份	31,441	641,081.99	0.10
240	688320	禾川科技	13,462	636,617.98	0.10
241	688553	汇宇制药	38,922	634,039.38	0.10
242	688626	翔宇医疗	14,370	632,567.40	0.10
243	688499	广东利元亨	15,187	631,931.07	0.10
244	688707	振华新材料	46,566	630,969.30	0.10
245	688084	晶品特装	7,160	630,080.00	0.10
246	688337	普源精电	17,613	628,255.71	0.10
247	688159	有方科技	8,707	624,030.69	0.10
248	688507	索辰科技	8,397	615,752.01	0.10
249	688401	路维光电	17,606	610,928.20	0.10
250	688239	贵州航宇科技	17,415	609,176.70	0.10
251	688787	海天瑞声	5,735	608,942.30	0.10
252	688007	光峰科技	42,107	608,867.22	0.10
253	688348	昱能科技	13,957	599,732.29	0.09
254	688365	光云科	39,206	596,715.32	0.09

		技			
255	688230	芯导科技	10,701	593,156.43	0.09
256	688428	诺诚健华	24,214	591,548.02	0.09
257	688222	成都先导	36,775	591,342.00	0.09
258	688155	先惠技术	11,404	588,674.48	0.09
259	688095	福昕软件开发	8,642	586,878.22	0.09
260	688319	欧林生物	37,389	585,511.74	0.09
261	688212	澳华内镜	11,935	584,815.00	0.09
262	688277	天智航医疗	41,512	577,016.80	0.09
263	688648	中邮科技	12,115	571,464.55	0.09
264	688510	航亚科技	23,583	570,236.94	0.09
265	688505	复旦张江股份	65,554	567,697.64	0.09
266	688046	药康生物	37,517	564,255.68	0.09
267	688697	纽威数控装备	42,065	561,147.10	0.09
268	688186	张家港广大特材	19,521	558,495.81	0.09
269	688268	广东华特气体	11,045	556,336.65	0.09
270	688219	会通股份	44,211	554,848.05	0.09
271	688023	安恒信息	9,668	548,562.32	0.09
272	688103	国力股份	9,016	548,533.44	0.09
273	688661	和林微纳科技	13,663	543,377.51	0.09
274	688488	艾迪药业	38,836	537,878.60	0.09
275	688315	诺禾致源科技	37,996	536,503.52	0.08

276	688588	凌志软件	36,742	535,330.94	0.08
277	688258	江苏卓易信息科技	11,019	533,650.17	0.08
278	688621	阳光诺和	10,627	530,181.03	0.08
279	688429	时创能源	36,463	530,172.02	0.08
280	688112	鼎阳科技	14,287	528,190.39	0.08
281	688196	卓越新能	10,937	525,741.59	0.08
282	688299	长阳科技	26,435	522,619.95	0.08
283	688622	禾信仪器	6,631	521,660.77	0.08
284	688625	呈和科技	16,982	519,309.56	0.08
285	688031	星环科技	11,115	518,292.45	0.08
286	688195	腾景科技	11,504	517,680.00	0.08
287	688173	希荻微电子	37,801	516,361.66	0.08
288	688168	北京安博通	7,282	516,075.34	0.08
289	688371	菲沃泰纳米科技	30,948	512,498.88	0.08
290	688035	德邦科技股份有限公司	12,596	511,649.52	0.08
291	688389	深圳普门科技	39,398	509,022.16	0.08
292	688636	智明达电子	15,013	507,289.27	0.08
293	688603	天承科技	11,446	505,913.20	0.08
294	688334	西高院	29,447	505,899.46	0.08
295	688556	高测科技股份有限公司	70,443	505,780.74	0.08
296	688290	景业智能	9,666	503,791.92	0.08
297	688606	奥泰生	7,488	503,193.60	0.08

		物			
298	688073	毕得医药科技股份	8,648	501,756.96	0.08
299	688191	智洋创新科技	21,072	501,092.16	0.08
300	688298	东方基因生物	18,246	499,028.10	0.08
301	688581	安杰思医学	7,682	498,024.06	0.08
302	688458	美芯晟科技	10,558	497,915.28	0.08
303	688590	新致软件	24,210	497,273.40	0.08
304	688577	海德曼装备	10,552	494,783.28	0.08
305	688566	吉贝尔药业	18,150	493,498.50	0.08
306	688236	春立正达医疗	26,393	490,645.87	0.08
307	688383	新益昌科技	9,643	490,442.98	0.08
308	688085	三友医疗	25,468	489,749.64	0.08
309	688381	帝奥微电子	22,541	488,238.06	0.08
310	688293	奥浦迈生物	10,799	486,062.99	0.08
311	688233	神工半导体	15,230	483,857.10	0.08
312	688359	三孚新材料科技	9,148	482,465.52	0.08
313	688609	广东九联科技	45,895	480,520.65	0.08
314	688197	首药控股	13,257	479,903.40	0.08
315	688799	华纳大药厂	11,562	477,510.60	0.08
316	688767	杭州博拓生物科技	13,330	477,214.00	0.08
317	688117	圣诺生物	14,134	475,609.10	0.08

318	688653	康希通信	38,761	474,822.25	0.08
319	688595	芯海科技	12,672	473,806.08	0.08
320	688598	金博碳素股份	18,612	473,117.04	0.07
321	688353	华盛锂电	14,299	473,010.92	0.07
322	688601	力芯微股份	11,830	472,608.50	0.07
323	688176	亚虹医药科技	52,722	467,644.14	0.07
324	688386	泛亚微透	8,585	466,251.35	0.07
325	688275	万润新能源	11,496	466,162.80	0.07
326	688066	北京航天宏图	23,791	465,827.78	0.07
327	688719	爱科赛博	10,949	465,332.50	0.07
328	688261	东微半导体	11,224	462,990.00	0.07
329	688418	震有科技	17,476	462,414.96	0.07
330	688512	慧智微电子	42,365	462,202.15	0.07
331	688267	中触媒股份	15,859	456,422.02	0.07
332	688152	麒麟信安	9,625	451,027.50	0.07
333	688620	安凯微电子	36,045	450,922.95	0.07
334	688360	德马科技	24,292	450,616.60	0.07
335	688678	福立旺精密	23,638	450,067.52	0.07
336	688539	高华科技	16,838	447,890.80	0.07
337	688376	美埃科技	12,006	447,463.62	0.07
338	688010	福光股份	14,395	446,820.80	0.07
339	688611	杭州柯林股份	13,652	445,464.76	0.07

340	688075	安旭生物	11,598	445,015.26	0.07
341	688489	三未信安	10,935	444,835.80	0.07
342	688226	威腾电气集团股份	16,909	442,001.26	0.07
343	688302	海创药业	9,352	437,673.60	0.07
344	688722	同益新材料	20,547	437,034.69	0.07
345	688143	长盈通光电	11,147	434,733.00	0.07
346	688087	英科再生	16,877	433,738.90	0.07
347	688202	美迪西生物医药	11,976	430,297.68	0.07
348	688247	宣泰医药	41,618	429,913.94	0.07
349	688119	中钢洛耐	102,585	428,805.30	0.07
350	688677	青岛海泰新光	10,975	428,134.75	0.07
351	688101	三达膜环境技术	30,644	427,177.36	0.07
352	688665	四方光电股份	9,548	426,986.56	0.07
353	688459	哈铁科技	44,426	426,489.60	0.07
354	688108	赛诺医疗科学	37,985	426,191.70	0.07
355	688580	伟思医疗	9,116	423,802.84	0.07
356	688377	迪威尔高端制造	17,749	423,668.63	0.07
357	688410	山外山血液净化	29,651	421,044.20	0.07
358	688157	松井新材料	10,557	421,013.16	0.07
359	688259	创耀通	10,584	419,655.60	0.07

		信科技			
360	688579	山大地纬软件	36,940	413,358.60	0.07
361	688231	隆达超合金股份	22,803	411,594.15	0.07
362	688687	北京凯因科技	15,400	409,486.00	0.06
363	688356	键凯科技	5,761	406,726.60	0.06
364	688070	成都纵横	8,358	403,691.40	0.06
365	688399	硕世生物	7,943	401,121.50	0.06
366	688602	康鹏科技	47,672	399,491.36	0.06
367	688282	理工导航	8,318	396,269.52	0.06
368	688533	上声电子股份	14,693	395,682.49	0.06
369	688716	中研股份	11,064	393,878.40	0.06
370	688280	精进电动	53,904	391,882.08	0.06
371	688325	赛微微电子	8,159	391,632.00	0.06
372	688569	铁科轨道	18,953	390,431.80	0.06
373	688496	清越科技	41,762	388,386.60	0.06
374	688179	阿拉丁科技	30,530	388,341.60	0.06
375	688269	西安凯立新材	11,642	386,514.40	0.06
376	688059	株洲华锐精密	8,232	384,928.32	0.06
377	688090	瑞松科技	11,179	384,445.81	0.06
378	688228	开普云信息科技	6,402	380,150.76	0.06
379	688378	奥来德光电	22,556	380,068.60	0.06
380	688339	亿华通	17,754	379,047.90	0.06

		科技			
381	688089	嘉必优生物	15,055	378,633.25	0.06
382	688478	晶升股份	12,317	376,900.20	0.06
383	688201	信安世纪	29,035	376,003.25	0.06
384	688373	盟科药业	59,923	375,717.21	0.06
385	688135	利扬芯片	18,074	374,312.54	0.06
386	688286	敏芯股份	5,289	373,879.41	0.06
387	688079	美迪凯股份	37,190	373,387.60	0.06
388	688253	英诺特生物股份	12,077	372,696.22	0.06
389	688181	八亿时空液晶股份	11,911	370,670.32	0.06
390	688238	和元生物	59,528	369,073.60	0.06
391	688211	中科微至	11,582	366,570.30	0.06
392	688768	容知日新	8,231	365,374.09	0.06
393	688080	映翰通网络	7,037	358,112.93	0.06
394	688246	嘉和美康科技	12,167	357,588.13	0.06
395	688015	交控科技	17,158	357,572.72	0.06
396	688207	格灵深瞳	23,669	357,401.90	0.06
397	688628	优利德科技	10,638	356,904.90	0.06
398	688720	艾森股份	8,315	355,798.85	0.06
399	688456	有研粉材	9,875	355,006.25	0.06
400	688061	灿瑞科技	10,797	354,141.60	0.06
401	688244	永信至	13,439	353,714.48	0.06

		诚			
402	688623	双元科技	5,630	353,395.10	0.06
403	688633	星球石墨	12,899	351,239.77	0.06
404	688039	当虹科技	10,667	350,090.94	0.06
405	688683	莱尔科技	13,841	349,070.02	0.06
406	688680	海优新材	7,884	348,472.80	0.06
407	688255	凯尔达机器人	10,330	348,017.70	0.06
408	688221	前沿生物	34,495	346,329.80	0.05
409	688077	大地熊新材料	10,818	345,635.10	0.05
410	688133	泰坦股份	14,833	341,455.66	0.05
411	688711	江苏宏微科技	19,314	339,733.26	0.05
412	688199	久日新材料	14,394	339,698.40	0.05
413	688733	壹石通	17,935	339,688.90	0.05
414	688663	新风光科技	12,552	338,276.40	0.05
415	688699	明微电子	10,415	337,237.70	0.05
416	688257	新锐股份	22,876	335,133.40	0.05
417	688227	品高股份	10,630	334,207.20	0.05
418	688033	天宜新材	51,767	331,826.47	0.05
419	688162	巨一科技	12,124	330,257.76	0.05
420	688210	泛海统联精密制造	14,457	329,619.60	0.05
421	688391	钜泉科技	11,012	326,946.28	0.05
422	688115	思林杰科技	6,293	323,460.20	0.05

423	688330	宏力达 信息	12,549	322,258.32	0.05
424	688573	信宇人	9,222	319,081.20	0.05
425	688312	燕麦科 技	13,120	315,273.60	0.05
426	688416	恒烁股 份	7,828	315,155.28	0.05
427	688317	上海之 江生物	17,444	314,340.88	0.05
428	688501	青岛达 能环保	11,259	313,563.15	0.05
429	688358	祥生医 疗科技	10,575	313,548.75	0.05
430	688057	金达莱 环保	25,567	311,917.40	0.05
431	688398	赛特新 材	14,893	308,434.03	0.05
432	688283	坤恒顺 维	11,170	306,616.50	0.05
433	688500	慧辰资 讯股份 公司	6,995	305,681.50	0.05
434	688509	正元地 信	71,158	305,267.82	0.05
435	688662	广东富 信科技	8,283	301,915.35	0.05
436	688129	东来涂 料技术 股份	11,057	300,750.40	0.05
437	688682	霍莱沃 技术	9,594	300,292.20	0.05
438	688571	杭华油 墨股份	38,706	298,423.26	0.05
439	688379	华光新 材	8,567	296,932.22	0.05
440	688020	方邦股 份	7,830	296,522.10	0.05
441	688028	沃尔德 金刚石	13,639	295,966.30	0.05
442	688786	悦安新 材	12,693	295,746.90	0.05
443	688053	思科瑞 微电子	9,510	294,144.30	0.05
444	688558	国盛智	11,625	293,415.00	0.05

		科股份			
445	688291	金橙子科技	9,636	292,067.16	0.05
446	688557	兰剑智能	9,732	291,278.76	0.05
447	688071	华依科技集团	7,974	290,652.30	0.05
448	688419	耐科装备	7,771	289,702.88	0.05
449	688585	上纬新材	37,217	289,548.26	0.05
450	688480	赛恩斯环保	8,993	289,124.95	0.05
451	688369	致远互联	10,887	287,307.93	0.05
452	688273	麦澜德医疗	9,412	284,336.52	0.05
453	688125	安达智能	7,717	283,213.90	0.04
454	688316	青云科技	4,450	281,996.50	0.04
455	688285	高铁电气	34,369	281,825.80	0.04
456	688576	西山科技	4,417	280,921.20	0.04
457	688600	皖仪科技	11,927	280,284.50	0.04
458	688132	邦彦技术股份	13,753	279,185.90	0.04
459	688560	明冠新材料	18,272	277,186.24	0.04
460	688793	倍轻松科技	8,302	276,373.58	0.04
461	688589	力合微电子	12,840	274,647.60	0.04
462	688288	鸿泉物联	9,460	274,434.60	0.04
463	688529	豪森智能股份	15,246	273,513.24	0.04
464	688292	浩瀚深度信息技术	14,146	272,169.04	0.04
465	688592	司南导航	5,854	270,981.66	0.04

466	688657	浩辰软件	6,362	270,194.14	0.04
467	688357	建龙微纳	9,368	269,704.72	0.04
468	688468	科美诊断	36,462	268,360.32	0.04
469	688345	博力威	9,663	266,215.65	0.04
470	688689	常州银河微电	11,433	263,759.31	0.04
471	688308	欧科亿数控刀具	14,270	263,281.50	0.04
472	688667	菱电电控	4,947	263,229.87	0.04
473	688435	英方软件	7,975	262,696.50	0.04
474	688030	山石网科	16,387	262,028.13	0.04
475	688610	埃科光电	6,542	259,455.72	0.04
476	688338	赛科希德	10,164	255,929.52	0.04
477	688393	安必平医药	8,889	255,469.86	0.04
478	688121	卓然技术	21,109	254,996.72	0.04
479	688137	近岸蛋白	6,657	254,963.10	0.04
480	688618	三旺通信	10,405	253,882.00	0.04
481	688148	芳源股份	46,680	252,538.80	0.04
482	688655	迅捷兴科技	11,831	250,698.89	0.04
483	688237	超卓航科	8,521	249,068.83	0.04
484	688011	新光光电科技股份有限公司	9,519	248,921.85	0.04
485	688170	德龙激光	9,842	248,018.40	0.04
486	688171	纬德信息	8,029	246,972.04	0.04
487	688130	晶华微	11,135	246,083.50	0.04

		电子			
488	688597	煜邦电力	31,140	243,826.20	0.04
489	688651	远江盛邦安全	7,132	243,415.16	0.04
490	688479	用友汽车信息科技	12,784	241,617.60	0.04
491	688022	瀚川智能	16,071	238,172.22	0.04
492	688218	江苏北人	10,961	237,853.70	0.04
493	688695	中创股份	8,007	237,807.90	0.04
494	688314	康拓医疗	7,693	237,559.84	0.04
495	688323	瑞华泰薄膜科技	16,367	237,485.17	0.04
496	688307	中润光学	8,340	237,189.60	0.04
497	688265	南方模式生物	7,357	236,968.97	0.04
498	688426	康为世纪生物科技	10,684	236,864.28	0.04
499	688737	中自科技	10,977	236,005.50	0.04
500	688203	海正生物材料	18,597	235,438.02	0.04
501	688370	从麟环保科技	12,242	233,944.62	0.04
502	688175	珠海高凌信息	11,491	233,612.03	0.04
503	688530	欧莱新材	14,181	233,561.07	0.04
504	688551	科威尔股份	7,931	233,092.09	0.04
505	688613	奥精医疗	12,153	232,365.36	0.04
506	688216	气派科技	10,128	232,235.04	0.04
507	688109	品茗科技	7,427	231,202.51	0.04

508	688045	必易微电子	6,639	228,381.60	0.04
509	688693	锆威特	6,897	227,669.97	0.04
510	688098	申联生物医药	37,203	227,310.33	0.04
511	688455	科捷智能	16,132	226,977.24	0.04
512	688013	天臣国际医疗科技	7,748	226,474.04	0.04
513	688096	江苏京源环保	14,867	226,275.74	0.04
514	688619	罗普特科技	16,818	223,679.40	0.04
515	688310	迈得医疗	15,099	222,559.26	0.04
516	688078	龙软科技	6,955	220,473.50	0.03
517	688113	联测科技	6,053	219,058.07	0.03
518	688060	江苏云涌电子科技	5,854	214,197.86	0.03
519	688058	宝兰德软件	7,462	213,935.54	0.03
520	688229	博睿宏远数据	4,153	211,595.35	0.03
521	688056	莱伯泰科仪器	6,316	210,828.08	0.03
522	688669	聚石化学股份	11,075	208,985.25	0.03
523	688616	西力科技	16,409	208,722.48	0.03
524	688069	德林海环保	10,724	208,581.80	0.03
525	688026	洁特生物股份	12,499	204,983.60	0.03
526	688328	深科达智能装备	8,987	203,555.55	0.03
527	688638	誉辰智能	5,236	203,470.96	0.03
528	688081	兴图新科	9,739	202,668.59	0.03

529	688466	金科环境	11,436	202,188.48	0.03
530	688355	明志科技	11,450	201,176.50	0.03
531	688420	天津美腾科技	8,409	200,470.56	0.03
532	688163	赛伦生物	10,302	200,373.90	0.03
533	688448	南京磁谷科技	6,741	197,443.89	0.03
534	688718	唯赛勃科技	15,903	196,879.14	0.03
535	688272	富吉瑞光电	7,243	195,923.15	0.03
536	688118	普元信息	8,695	194,333.25	0.03
537	688215	瑞晟智能科技	5,017	190,746.34	0.03
538	688395	深圳正弦电气股份	8,261	187,359.48	0.03
539	688189	南新制药	25,099	186,736.56	0.03
540	688260	昀冢科技	11,162	183,949.76	0.03
541	688178	万德斯环保	7,975	183,584.50	0.03
542	688350	富淼科技	11,361	181,094.34	0.03
543	688051	罗克佳华科技	7,269	180,925.41	0.03
544	688251	井松智能科技	8,384	180,759.04	0.03
545	688092	爱科科技股份有限公司	7,890	175,947.00	0.03
546	688517	金冠电气	12,199	175,421.62	0.03
547	688679	通源环境	11,671	174,714.87	0.03
548	688038	武汉中科通达	10,621	168,555.27	0.03
549	688450	光格科技	6,172	163,064.24	0.03
550	688156	路德环	9,617	162,623.47	0.03

		境			
551	688335	复洁环 保科技	13,281	162,028.20	0.03
552	688670	金迪克 生物	11,450	159,727.50	0.03
553	688671	碧兴物 联	7,334	156,580.90	0.02
554	688193	仁度生 物	3,712	156,015.36	0.02
555	688528	秦川物 联网	15,005	155,451.80	0.02
556	688607	康众数 字医疗 科技	8,216	154,050.00	0.02
557	688004	北京博 汇科技	7,506	149,369.40	0.02
558	688367	工大高 科	8,448	149,107.20	0.02
559	688485	九州一 轨环科	13,237	144,150.93	0.02
560	688329	苏州艾 隆科技	7,336	141,144.64	0.02
561	688067	爱威科 技	6,519	140,223.69	0.02
562	688309	恒誉环 保	7,698	137,871.18	0.02
563	688681	科汇电 力自动 化	9,743	136,402.00	0.02
564	688296	和达科 技	10,279	134,963.27	0.02
565	688217	上海睿 昂基因	5,177	130,978.10	0.02
566	688565	力源科 技	13,758	127,261.50	0.02
567	688659	元琛科 技	14,312	124,943.76	0.02
568	688021	奥福科 技	7,242	110,730.18	0.02
569	688701	浙江卓 锦股份	11,760	96,902.40	0.02

7.3.2 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	80,235,363.15	12.71
2	688256	寒武纪科技	65,705,805.72	10.41
3	688981	中芯国际	43,104,302.13	6.83
4	688111	金山办公	37,109,585.95	5.88
5	688012	中微半导体设备	29,332,989.11	4.65
6	688271	联影医疗	24,581,546.50	3.89
7	688036	传音控股	23,397,297.13	3.71
8	688506	百利天恒药业	19,897,903.09	3.15
9	688008	澜起科技	19,765,319.47	3.13
10	688223	晶科能源	15,057,219.27	2.39
11	688396	华润微电子	14,229,096.62	2.25
12	688608	恒玄科技	14,052,069.96	2.23
13	688169	石头科技	12,899,584.90	2.04
14	688047	龙芯中科	12,030,351.11	1.91
15	688617	惠泰医疗	11,495,731.24	1.82
16	688009	中国通号	11,113,326.23	1.76
17	688072	拓荆科技	10,840,542.70	1.72
18	688249	晶合集成	10,619,201.11	1.68
19	688188	上海柏楚电子科技	10,553,586.94	1.67
20	688303	大全能源	10,358,284.84	1.64

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	688608	恒玄科技	5,427,769.80	0.86
2	688617	惠泰医疗	4,063,380.79	0.64

3	688279	峰昭科技	3,913,404.70	0.62
4	688027	科大国盾量子	3,483,667.68	0.55
5	688235	百济神州	2,956,234.61	0.47
6	688041	海光信息	2,569,482.06	0.41
7	688018	乐鑫科技	2,402,961.48	0.38
8	688502	茂莱光学	2,295,836.37	0.36
9	688019	安集科技	2,122,507.15	0.34
10	688111	金山办公	2,019,576.90	0.32
11	688126	上海硅产业集团	1,931,962.48	0.31
12	688052	纳芯微电子	1,854,141.32	0.29
13	688498	源杰科技	1,802,776.85	0.29
14	688536	思瑞浦股份	1,713,502.99	0.27
15	688200	华峰测控	1,615,747.48	0.26
16	688332	中科蓝讯	1,553,530.11	0.25
17	688486	龙迅股份	1,522,865.94	0.24
18	688696	极米科技	1,513,358.45	0.24
19	688515	裕太微电子	1,389,460.54	0.22
20	688068	热景生物	1,352,243.99	0.21

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	1,703,018,558.18
卖出股票收入（成交）总额	211,697,619.46

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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）	116,002.54	0.02
8	同业存单	—	—
9	地方政府债	—	—

10	其他	-	-
11	合计	116,002.54	0.02

7.6 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	118057	甬矽转债	1,160	116,002.54	0.02

7.7 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。

7.8 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投资。

7.9 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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	119,732.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,732.20

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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		招商银行股份有限公司-汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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(%)
6,063	106,063.17	235,522,800.00	36.63	407,538,200.00	63.37	150,223,200.00	23.36

注:机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	28,813,600.00	4.48
2	方正证券股份有限公司	8,552,900.00	1.33
3	招商证券股份有限公司	7,585,900.00	1.18
4	国泰海通证券股份有限公司	6,931,400.00	1.08
5	华泰证券股份有限公司	5,500,000.00	0.86
6	申万宏源证券有限公司	4,533,900.00	0.71
7	广发证券股份有限公司	4,474,800.00	0.70
8	中信建投证券股份有限公司	4,456,900.00	0.69
9	中国银河证券股份有限公司	3,615,800.00	0.56
10	国信证券股份有限公司	3,111,300.00	0.48
11	招商银行股份有限公司—汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金	150,223,200.00	23.36

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 02 月 26 日） 基金份额总额	1,493,061,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	370,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	1,220,000,000.00
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	643,061,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	3	1,914,716,177.64	100.00	336,970.45	100.00	

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的

基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。)

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

10.8 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	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金发行文件	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 01 月 25 日
2	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金上网发售提示性公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 17 日
3	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加网下现金发售代理机构的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 17 日
4	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集期认购申请确认比例的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 22 日
5	汇添富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	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 27 日
6	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 28 日
7	汇添富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	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 02 月 28 日
8	关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 04 日
9	汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2025 年 3 月 5 日更新)	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加申	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日

	购赎回代理券商的公告		
11	汇添富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	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 05 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	上证报, 上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 03 月 07 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年度)	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上交所, 深交所, 上证报	2025 年 03 月 31 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	公司网站, 中国证监会基金电子披露网站, 上证报, 上交所, 深交所	2025 年 04 月 30 日
15	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与民商基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加瑞银证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 深交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2025 年 06 月 23 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与大华银行(中国)有限公司合作关系的公告	上证报, 中国证监会基金电子披露网站, 公司网站	2025 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间					
机构	1	2025 年 3 月 18 日至 2025 年 3 月 19 日	-	145,288,100.00	116,474,500.00	28,813,600.00	4.48
招商 银行 股份 有限 公司 — 汇 添富 上 证 科 创 板 综 合 交 易 型 开 放 式 指 数 证 券 投 资 基 金	1	2025 年 5 月 13 日至 2025 年 6 月 30 日	-	228,719,100.00	78,495,900.00	150,223,200.00	23.36

联接基金							
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富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、《汇添富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、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 08 月 29 日